

# NN (L)

## Société d'Investissement à Capital Variable

R.C.S. Luxembourg N° B 44 873

### Halbjahresbericht und ungeprüfte Finanzabschlüsse

LUXEMBOURG für den Berichtszeitraum zum 31. März 2022

Weitere Informationen sind erhältlich bei:

NN Investment Partners B.V.  
P.O. Box 90470  
Prinses Beatrixlaan 35  
2509 LL The Hague  
The Netherlands  
E-mail: [info@nnip.com](mailto:info@nnip.com)  
oder [www.nnip.com](http://www.nnip.com)

## Hinweis

Es wird darauf hingewiesen, dass für die Teilfonds, NN (L) Belgian Government Bond, NN (L) Euro Short Duration , NN (L) European Enhanced Index Sustainable Equity, NN (L) Global Enhanced Index Sustainable Equity NN (L)Multi Asset High Income, NN (L) North America Enhanced Index Sustainable Equity, keine Anzeige zum Vertrieb der Anteile in der Bundesrepublik Deutschland gemäß § 310 Kapitalanlagegesetzbuch erstattet wurde. Daher dürfen Anteile dieser Teilfonds in der Bundesrepublik Deutschland nicht vertrieben werden.

Es können keine Zeichnungen lediglich auf der Basis der Finanzabschlüsse entgegengenommen werden. Eine Zeichnung ist nur gültig, wenn sie auf der Grundlage des aktuellen Prospekts in Verbindung mit dem letzten Jahresbericht und dem aktuellsten Halbjahresbericht (falls nach dem letzten Jahresbericht veröffentlicht) vorgenommen wurde.

Der Prospekt, die Satzung sowie die Jahres- und Halbjahresberichte werden den Anteilshabern bei der Depotbank und am Sitz der Gesellschaft sowie bei den in diesem Bericht genannten lokalen Vertriebsstellen oder Hauptansprechpartnern in der Kundenbetreuung zur Verfügung gestellt. Darüber hinaus werden sie auf Anfrage kostenlos versandt.

Die Angaben in diesem Bericht dienen lediglich der Information. Sie stellen keine Indikatoren für zukünftige Ergebnisse dar.

Inhaltsverzeichnis	Seite
Organisation	16
Konsolidierter Abschluss	
Konsolidierte Aufstellung des Nettovermögens zum 31.03.2022	22
NN (L) AAA ABS	
Statistische Angaben	23
Finanzabschlüsse	24
Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022	24
Wertpapierbestand zum 31.03.2022	25
Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022	26
Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick	26
NN (L) Alternative Beta	
Statistische Angaben	27
Finanzabschlüsse	29
Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022	29
Wertpapierbestand zum 31.03.2022	30
Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022	30
Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick	31
NN (L) Asia Income	
Statistische Angaben	32
Finanzabschlüsse	34
Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022	34
Wertpapierbestand zum 31.03.2022	35
Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022	35
Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick	36
NN (L) Asian Debt (Hard Currency)	
Statistische Angaben	37
Finanzabschlüsse	41
Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022	41
Wertpapierbestand zum 31.03.2022	42
Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022	44
Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick	45
NN (L) Asian High Yield	
Statistische Angaben	46
Finanzabschlüsse	48
Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022	48
Wertpapierbestand zum 31.03.2022	49

## Inhaltsverzeichnis (Fortsetzung)

Seite

Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022	50
Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick	51
<b>NN (L) Banking &amp; Insurance</b>	
Statistische Angaben	52
Finanzabschlüsse	54
Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022	54
Wertpapierbestand zum 31.03.2022	55
Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022	56
Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick	56
<b>NN (L) Belgian Government Bond</b>	
Statistische Angaben	57
Finanzabschlüsse	58
Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022	58
Wertpapierbestand zum 31.03.2022	59
Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick	59
<b>NN (L) Climate &amp; Environment</b>	
Statistische Angaben	60
Finanzabschlüsse	62
Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022	62
Wertpapierbestand zum 31.03.2022	63
Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022	63
Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick	64
<b>NN (L) Commodity Enhanced</b>	
Statistische Angaben	65
Finanzabschlüsse	67
Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022	67
Wertpapierbestand zum 31.03.2022	68
Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022	68
Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick	68
<b>NN (L) Corporate Green Bond</b>	
Statistische Angaben	69
Finanzabschlüsse	70
Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022	70
Wertpapierbestand zum 31.03.2022	71
Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022	73
Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick	73

## Inhaltsverzeichnis (Fortsetzung)

Seite

### NN (L) Emerging Europe Equity

Statistische Angaben	74
Finanzabschlüsse	75
Nettovermögensaufstellung zum 28.02.2022	75
Wertpapierbestand zum 28.02.2022	76
Nettovermögen zum 28.02.2022 im Überblick	76

### NN (L) Emerging Markets Corporate Debt

Statistische Angaben	77
Finanzabschlüsse	78
Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022	78
Wertpapierbestand zum 31.03.2022	79
Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022	81
Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick	82

### NN (L) Emerging Markets Debt (Hard Currency)

Statistische Angaben	83
Finanzabschlüsse	89
Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022	89
Wertpapierbestand zum 31.03.2022	90
Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022	97
Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick	98

### NN (L) Emerging Markets Debt (Local Bond)

Statistische Angaben	99
Finanzabschlüsse	101
Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022	101
Wertpapierbestand zum 31.03.2022	102
Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022	104
Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick	104

### NN (L) Emerging Markets Debt (Local Currency)

Statistische Angaben	105
Finanzabschlüsse	107
Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022	107
Wertpapierbestand zum 31.03.2022	108
Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022	108
Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick	110

### NN (L) Emerging Markets Debt Short Duration (Hard Currency)

Statistische Angaben	111
----------------------	-----

## Inhaltsverzeichnis (Fortsetzung)

Seite

Finanzabschlüsse	112
Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022	112
Wertpapierbestand zum 31.03.2022	113
Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022	116
Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick	116
<b>NN (L) Emerging Markets Enhanced Index Sustainable Equity</b>	
Statistische Angaben	117
Finanzabschlüsse	119
Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022	119
Wertpapierbestand zum 31.03.2022	120
Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022	126
Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick	126
<b>NN (L) Emerging Markets High Dividend</b>	
Statistische Angaben	127
Finanzabschlüsse	130
Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022	130
Wertpapierbestand zum 31.03.2022	131
Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022	133
Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick	133
<b>NN (L) Energy</b>	
Statistische Angaben	134
Finanzabschlüsse	136
Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022	136
Wertpapierbestand zum 31.03.2022	137
Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022	137
Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick	137
<b>NN (L) Euro Covered Bond</b>	
Statistische Angaben	138
Finanzabschlüsse	139
Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022	139
Wertpapierbestand zum 31.03.2022	140
Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022	141
Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick	142
<b>NN (L) Euro Credit</b>	
Statistische Angaben	143
Finanzabschlüsse	145

## Inhaltsverzeichnis (Fortsetzung)

Seite

Nettvermögensaufstellung zum 31.03.2022	145
Wertpapierbestand zum 31.03.2022	146
Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022	152
Nettvermögen zum 31.03.2022 im Überblick	152
<b>NN (L) EURO Equity</b>	
Statistische Angaben	153
Finanzabschlüsse	154
Nettvermögensaufstellung zum 31.03.2022	154
Wertpapierbestand zum 31.03.2022	155
Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022	155
Nettvermögen zum 31.03.2022 im Überblick	155
<b>NN (L) Euro Fixed Income</b>	
Statistische Angaben	156
Finanzabschlüsse	158
Nettvermögensaufstellung zum 31.03.2022	158
Wertpapierbestand zum 31.03.2022	159
Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022	167
Nettvermögen zum 31.03.2022 im Überblick	168
<b>NN (L) Euro High Dividend</b>	
Statistische Angaben	169
Finanzabschlüsse	172
Nettvermögensaufstellung zum 31.03.2022	172
Wertpapierbestand zum 31.03.2022	173
Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022	173
Nettvermögen zum 31.03.2022 im Überblick	173
<b>NN (L) Euro Income</b>	
Statistische Angaben	174
Finanzabschlüsse	175
Nettvermögensaufstellung zum 31.03.2022	175
Wertpapierbestand zum 31.03.2022	176
Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022	176
Nettvermögen zum 31.03.2022 im Überblick	177
<b>NN (L) Euro Liquidity</b>	
Statistische Angaben	178
Finanzabschlüsse	179
Nettvermögensaufstellung zum 31.03.2022	179



## Inhaltsverzeichnis (Fortsetzung)

Seite

Wertpapierbestand zum 31.03.2022	180
Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick	180
<b>NN (L) Euro Long Duration Bond</b>	
Statistische Angaben	181
Finanzabschlüsse	182
Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022	182
Wertpapierbestand zum 31.03.2022	183
Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022	186
Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick	187
<b>NN (L) Euro Short Duration</b>	
Statistische Angaben	188
Finanzabschlüsse	189
Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022	189
Wertpapierbestand zum 31.03.2022	190
Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022	190
Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick	191
<b>NN (L) Euro Sustainable Credit</b>	
Statistische Angaben	192
Finanzabschlüsse	193
Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022	193
Wertpapierbestand zum 31.03.2022	194
Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022	199
Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick	200
<b>NN (L) Euro Sustainable Credit (excluding Financials)</b>	
Statistische Angaben	201
Finanzabschlüsse	203
Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022	203
Wertpapierbestand zum 31.03.2022	204
Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022	207
Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick	207
<b>NN (L) Euromix Bond</b>	
Statistische Angaben	208
Finanzabschlüsse	209
Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022	209
Wertpapierbestand zum 31.03.2022	210
Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022	210

## Inhaltsverzeichnis (Fortsetzung)

Seite

Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick	211
<b>NN (L) European ABS</b>	
Statistische Angaben	212
Finanzabschlüsse	213
Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022	213
Wertpapierbestand zum 31.03.2022	214
Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022	215
Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick	215
<b>NN (L) European Enhanced Index Sustainable Equity</b>	
Statistische Angaben	216
Finanzabschlüsse	217
Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022	217
Wertpapierbestand zum 31.03.2022	218
Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick	220
<b>NN (L) European Equity</b>	
Statistische Angaben	221
Finanzabschlüsse	223
Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022	223
Wertpapierbestand zum 31.03.2022	224
Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022	225
Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick	225
<b>NN (L) European High Dividend</b>	
Statistische Angaben	226
Finanzabschlüsse	228
Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022	228
Wertpapierbestand zum 31.03.2022	229
Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022	229
Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick	230
<b>NN (L) European High Yield</b>	
Statistische Angaben	231
Finanzabschlüsse	233
Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022	233
Wertpapierbestand zum 31.03.2022	234
Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022	236
Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick	237
<b>NN (L) European Participation Equity</b>	

## Inhaltsverzeichnis (Fortsetzung)

Seite

Statistische Angaben	238
Finanzabschlüsse	239
Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022	239
Wertpapierbestand zum 31.03.2022	240
Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick	241
<b>NN (L) European Real Estate</b>	
Statistische Angaben	242
Finanzabschlüsse	244
Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022	244
Wertpapierbestand zum 31.03.2022	245
Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022	245
Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick	246
<b>NN (L) European Sustainable Equity</b>	
Statistische Angaben	247
Finanzabschlüsse	249
Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022	249
Wertpapierbestand zum 31.03.2022	250
Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022	250
Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick	251
<b>NN (L) First Class Multi Asset</b>	
Statistische Angaben	252
Finanzabschlüsse	255
Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022	255
Wertpapierbestand zum 31.03.2022	256
Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022	266
Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick	267
<b>NN (L) First Class Multi Asset Premium</b>	
Statistische Angaben	268
Finanzabschlüsse	269
Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022	269
Wertpapierbestand zum 31.03.2022	270
Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022	274
Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick	275
<b>NN (L) First Class Protection</b>	
Statistische Angaben	276
Finanzabschlüsse	277

## Inhaltsverzeichnis (Fortsetzung)

Seite

Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022	277
Wertpapierbestand zum 31.03.2022	278
Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022	278
Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick	278
<b>NN (L) First Class Stable Yield Opportunities</b>	
Statistische Angaben	279
Finanzabschlüsse	280
Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022	280
Wertpapierbestand zum 31.03.2022	281
Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022	284
Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick	285
<b>NN (L) First Class Yield Opportunities</b>	
Statistische Angaben	286
Finanzabschlüsse	289
Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022	289
Wertpapierbestand zum 31.03.2022	290
Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022	297
Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick	298
<b>NN (L) Food &amp; Beverages</b>	
Statistische Angaben	299
Finanzabschlüsse	302
Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022	302
Wertpapierbestand zum 31.03.2022	303
Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022	304
Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick	304
<b>NN (L) Frontier Markets Debt (Hard Currency)</b>	
Statistische Angaben	305
Finanzabschlüsse	308
Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022	308
Wertpapierbestand zum 31.03.2022	309
Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022	312
Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick	312
<b>NN (L) Global Bond Opportunities</b>	
Statistische Angaben	313
Finanzabschlüsse	316
Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022	316

## Inhaltsverzeichnis (Fortsetzung)

Seite

Wertpapierbestand zum 31.03.2022	317
Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022	318
Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick	320
<b>NN (L) Global Convertible Bond</b>	
Statistische Angaben	321
Finanzabschlüsse	322
Nettvermögensaufstellung zum 31.03.2022	322
Wertpapierbestand zum 31.03.2022	323
Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022	324
Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick	325
<b>NN (L) Global Convertible Opportunities</b>	
Statistische Angaben	326
Finanzabschlüsse	328
Nettvermögensaufstellung zum 31.03.2022	328
Wertpapierbestand zum 31.03.2022	329
Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022	329
Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick	330
<b>NN (L) Global Enhanced Index Sustainable Equity</b>	
Statistische Angaben	331
Finanzabschlüsse	332
Nettvermögensaufstellung zum 31.03.2022	332
Wertpapierbestand zum 31.03.2022	333
Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022	341
Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick	341
<b>NN (L) Global Equity Impact Opportunities</b>	
Statistische Angaben	342
Finanzabschlüsse	344
Nettvermögensaufstellung zum 31.03.2022	344
Wertpapierbestand zum 31.03.2022	345
Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022	345
Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick	346
<b>NN (L) Global High Dividend</b>	
Statistische Angaben	347
Finanzabschlüsse	350
Nettvermögensaufstellung zum 31.03.2022	350
Wertpapierbestand zum 31.03.2022	351

## Inhaltsverzeichnis (Fortsetzung)

Seite

Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022	352
Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick	352
<b>NN (L) Global High Yield</b>	
Statistische Angaben	353
Finanzabschlüsse	358
Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022	358
Wertpapierbestand zum 31.03.2022	359
Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022	364
Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick	365
<b>NN (L) Global Inflation Linked Bond</b>	
Statistische Angaben	366
Finanzabschlüsse	367
Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022	367
Wertpapierbestand zum 31.03.2022	368
Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022	370
Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick	371
<b>NN (L) Global Investment Grade Credit</b>	
Statistische Angaben	372
Finanzabschlüsse	373
Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022	373
Wertpapierbestand zum 31.03.2022	374
Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022	375
Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick	376
<b>NN (L) Global Real Estate</b>	
Statistische Angaben	377
Finanzabschlüsse	379
Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022	379
Wertpapierbestand zum 31.03.2022	380
Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick	381
<b>NN (L) Global Sustainable Equity</b>	
Statistische Angaben	382
Finanzabschlüsse	384
Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022	384
Wertpapierbestand zum 31.03.2022	385
Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022	386
Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick	386

## Inhaltsverzeichnis (Fortsetzung)

Seite

### NN (L) Greater China Equity

Statistische Angaben	387
Finanzabschlüsse	389
Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022	389
Wertpapierbestand zum 31.03.2022	390
Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022	390
Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick	390

### NN (L) Green Bond

Statistische Angaben	391
Finanzabschlüsse	393
Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022	393
Wertpapierbestand zum 31.03.2022	394
Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022	396
Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick	397

### NN (L) Green Bond Short Duration

Statistische Angaben	398
Finanzabschlüsse	399
Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022	399
Wertpapierbestand zum 31.03.2022	400
Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022	402
Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick	403

### NN (L) Health Care

Statistische Angaben	404
Finanzabschlüsse	406
Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022	406
Wertpapierbestand zum 31.03.2022	407
Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022	408
Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick	408

### NN (L) Health & Well-being

Statistische Angaben	409
Finanzabschlüsse	411
Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022	411
Wertpapierbestand zum 31.03.2022	412
Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick	412

### NN (L) Japan Equity

Statistische Angaben	413
----------------------	-----

## Inhaltsverzeichnis (Fortsetzung)

Seite

Finanzabschlüsse	415
Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022	415
Wertpapierbestand zum 31.03.2022	416
Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022	417
Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick	417
<b>NN (L) Multi Asset Factor Opportunities</b>	
Statistische Angaben	418
Finanzabschlüsse	419
Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022	419
Wertpapierbestand zum 31.03.2022	420
Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022	420
Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick	421
<b>NN (L) Multi Asset High Income</b>	
Statistische Angaben	422
Finanzabschlüsse	423
Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022	423
Wertpapierbestand zum 31.03.2022	424
Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022	424
Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick	424
<b>NN (L) North America Enhanced Index Sustainable Equity</b>	
Statistische Angaben	425
Finanzabschlüsse	426
Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022	426
Wertpapierbestand zum 31.03.2022	427
Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022	430
Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick	431
<b>NN (L) Smart Connectivity</b>	
Statistische Angaben	432
Finanzabschlüsse	434
Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022	434
Wertpapierbestand zum 31.03.2022	435
Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022	435
Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick	436
<b>NN (L) Sovereign Green Bond</b>	
Statistische Angaben	437
Finanzabschlüsse	438



## Inhaltsverzeichnis (Fortsetzung)

Seite

Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022	438
Wertpapierbestand zum 31.03.2022	439
Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022	440
Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick	440
<b>NN (L) US Behavioural Equity</b>	
Statistische Angaben	441
Finanzabschlüsse	442
Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022	442
Wertpapierbestand zum 31.03.2022	443
Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick	444
<b>NN (L) US Credit</b>	
Statistische Angaben	445
Finanzabschlüsse	449
Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022	449
Wertpapierbestand zum 31.03.2022	450
Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022	456
Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick	457
<b>NN (L) US Enhanced Core Concentrated Equity</b>	
Statistische Angaben	458
Finanzabschlüsse	460
Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022	460
Wertpapierbestand zum 31.03.2022	461
Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022	462
Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick	462
<b>NN (L) US Factor Credit</b>	
Statistische Angaben	463
Finanzabschlüsse	464
Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022	464
Wertpapierbestand zum 31.03.2022	465
Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022	466
Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick	467
<b>NN (L) US High Dividend</b>	
Statistische Angaben	468
Finanzabschlüsse	472
Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022	472
Wertpapierbestand zum 31.03.2022	473

## Inhaltsverzeichnis (Fortsetzung)

Seite

Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022	473
Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick	474
NN (L) US High Yield	
Statistische Angaben	475
Finanzabschlüsse	476
Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022	476
Wertpapierbestand zum 31.03.2022	477
Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022	479
Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick	480
Erläuterungen zu den Finanzabschlüssen	481
Weitere Informationen für die Anteilsinhaber	524

## Organisation

<b>Sitz der Gesellschaft</b>	80, route d'Esch, L-1470 Luxembourg
<b>Verwaltungsrat</b>	
<b>Vorsitzender</b>	<b>Dirk Buggenhout,</b> Head of Investment Operations, NN Investment Partners B.V. (die „Gruppe“)
<b>Mitglieder des Verwaltungsrats</b>	<b>Benoît De Belder,</b> Independent Director  <b>Patrick Den Besten,</b> Head of Financial Risk, NN Investment Partners B.V. (die „Gruppe“)  <b>Jan Jaap Hazenberg,</b> Head of Product Strategy, NN Investment Partners B.V. (die „Gruppe“)  <b>Sophie Mosnier,</b> Independent Director
<b>Verwaltungsgesellschaft</b>	<b>NN Investment Partners B.V. (seit 28.03.2022),</b> 35, Prinses Beatrixlaan, 2595 AK, The Hague, The Netherlands  <b>NN Investment Partners B.V. (bis 27.03.2022),</b> 65, Schenkkade, 2595 AS, The Hague, The Netherlands
<b>Anlageverwalter</b>	<b>NN Investment Partners B.V. (seit 28.03.2022),</b> 35, Prinses Beatrixlaan, 2595 AK, The Hague, The Netherlands  <b>NN Investment Partners B.V. (bis 27.03.2022),</b> 65, Schenkkade, 2595 AS, The Hague, The Netherlands  (Weiter) delegiert an  <b>American Century Investment Management Inc,</b> 4500, Main Street, Kansas City, Missouri, MO 64141-6786, United States  <b>Irish Life Investment Managers Limited,</b> Beresford Court, Beresford Place Dublin 1, Ireland  <b>NN Investment Partners North America LLC,</b> 230, Park Avenue, Suite 1800, New York, NY 10169, United States

## Organisation (Fortsetzung)

	<p><b>NN Investment Partners Towarzystwo Funduszy Inwestycyjnych S.A.,</b> 12, Topiel, Warsaw 00-342, Poland</p>
	<p><b>NN Investment Partners (Singapore) Ltd,</b> MBFC Tower 2 #31-01, 10 Marina Boulevard, 018983 Singapore</p>
	<p><b>NNIP Advisors B.V. (since 28/03/2022),</b> 35, Prinses Beatrixlaan, 2595 AK, The Hague, The Netherlands</p>
	<p><b>NNIP Advisor B.V. (until 27/03/2022)</b> 65, Schenkkade, 2595 AS, The Hague, The Netherlands</p>
	<p><b>Nomura Asset Management Co., Ltd,</b> 2-2-1, Toyosu, Koto-ku, Tokyo 135-0061, Japan</p>
	<p><b>Nomura Asset Management Taiwan Ltd,</b> 30F, 7 Xin Yi Road, Section 5, Taipei 101, Taiwan, R.O.C.</p>
	<p><b>Voya Investment Management Co. LLC,</b> 230, Park Avenue, 14th Floor, New York, NY 10169, United States</p>
<b>Depotbank</b>	<p><b>Brown Brothers Harriman (Luxembourg) S.C.A.,</b> 80, route d'Esch, L-1470 Luxembourg</p>
<b>Wertpapierleihstelle</b>	<p><b>Goldman Sachs International Bank,</b> Peterborough Court, 133 Fleet Street, London EC4A2BB, United Kingdom</p>
<b>Hedging-Stelle</b>	<p><b>State Street Bank International GmbH,</b> Solmsstrasse 83, 60486 Frankfurt am Main, Germany</p>
<b>Verwaltungsstelle, Register-, Transfer- und Zahlstelle</b>	<p><b>NN Investment Partners B.V. (since 28/03/2022),</b> 35, Prinses Beatrixlaan, 2595 AK, The Hague, The Netherlands</p> <p><b>NN Investment Partners B.V. (until 27/03/2022),</b> 65, Schenkkade, 2595 AS, The Hague, The Netherlands</p> <p>delegiert an</p> <p><b>Brown Brothers Harriman (Luxembourg) S.C.A.,</b> 80, route d'Esch, L-1470 Luxembourg</p>

## Organisation (Fortsetzung)

<b>Cabinet de révision agréé</b>	<b>KPMG Luxembourg, Société anonyme,</b> 39, Avenue John F. Kennedy, L-1855 Luxembourg
<b>Lokale Vertriebsstellen oder Hauptansprechpartner in der Kundenbetreuung</b>	
Alle anderen Länder	<b>NN Investment Partners B.V. (seit 28.03.2022),</b> 35, Prinses Beatrixlaan, 2595 AK, The Hague, The Netherlands
	<b>NN Investment Partners B.V. (bis 27.03.2022),</b> 65, Schenkade, 2595 AS, The Hague, The Netherlands
Asien mit Ausnahme Taiwans	<b>NN Investment Partners Singapore Ltd,</b> 10 Marina Boulevard, #31-01, Marina Bay Financial Centre, 018983 Singapore
Belgien	<b>NN Investment Partners Belgium,</b> Marnixlaan 23, 1000 Brussels, Belgium
Tschechische Republik/Slowakei	<b>NN Investment Partners C.R., a.s.,</b> Bozděchova 344/2, 150 00 Prague 5, Czech Republic
Frankreich	<b>NN Investment Partners B.V. French Branch,</b> 52-56, rue de la Victoire, 75009 Paris, France
Deutschland	<b>NN Investment Partners B.V. Germany Branch,</b> Westhafenplatz 1, 60327 Frankfurt am Main, Germany
Griechenland	<b>3K Investment Partners M.F.M.C. S.A. (Vermittler),</b> 25-27-29 Karneadou Str. GR 106 75, Athens, Greece
Italien/Österreich	<b>NN Investment Partners B.V. Italian Branch,</b> Via Santa Maria Segreta 7/9, 20123 Milan, Italy
Japan	<b>NN Investment Partners (Japan) Co., Ltd,</b> 44F Shibuya Scramble Square, 2-24-12 Shibuya, Shibuya-ku, Tokyo, 150-6144 Japan
Rumänien	<b>NN Investment Partners B.V. Romania Branch,</b> Str. Costache Negri Nr. 1-5 Opera Center I, Bucuresti 050552, Romania
Spanien/Portugal	<b>NN Investment Partners B.V. Spanish Branch,</b> Pº de la Castellana 141, 19th floor, 28046 Madrid, Spain

## Organisation (Fortsetzung)

Schweiz\*

**NN Investment Partners Switzerland Ltd (Schweizerische Repräsentanz),**  
Schneckenmannstrasse 25, 8044 Zurich, Switzerland

**State Street Bank International GmbH,**  
Munich, Zurich branch, Beethovenstrasse 19,  
8002 Zurich, Switzerland

Taiwan

**Nomura Asset Management Taiwan Ltd (Master Agent),**  
30th Floor, No 7, Sec 5 Xinyi Road, Taipei 110 Taiwan,  
Republic of China

Vereinigtes Königreich

**NN Investment Partners UK Branch,**  
25, Old Broad Street, London EC2N 1HQ, United Kingdom

**Gegenparteien bei außerbörslichen  
derivativen Finanzinstrumenten  
Gegenparteien bei Swaps**

**Barclays Bank Ireland PLC,**  
One Molesworth Street, Dublin 2, D02 RF29, Ireland

**Barclays Bank PLC,**  
1 Churchill Place, London E14 5HP, United Kingdom

**BNP Paribas SA,**  
16 Boulevard Des Italiens, 75009, Paris 9, France

**BofA Securities Europe SA,**  
51 Rue la Boétie, Paris 8, 75008, France

**Citigroup Global Markets Europe AG,**  
Reuterweg 16, 60323 Frankfurt am Main, Germany

**Citigroup Global Markets Limited,**  
25 Canada Square, London, E14 5LB, United Kingdom

**Deutsche Bank AG,**  
Taunusanlage 12, 60262 Frankfurt, Germany

**Goldman Sachs Bank Europe SE,**  
Taunusanlage 9-10, 60262 Frankfurt, Germany

**HSBC Continental Europe,**  
38, avenue Kléber, 75116 Paris, France

\*Nicht alle in diesem Bericht erwähnten Teilfonds von NN (L) sind zum Vertrieb an nicht-qualifizierte Anleger in der Schweiz zugelassen. Bitte lesen Sie die Schweizer Version dieses Berichts, um sich über den Registrierungsstatus für die Schweiz zu informieren. Die Schweizer Version des Berichts kann kostenlos von der Schweizer Repräsentanz bezogen werden.

## Organisation (Fortsetzung)

**J.P. Morgan SE,**  
Taunustor 1, 60310 Frankfurt, Germany

**J.P. Morgan Securities PLC,**  
25 Bank Street, London E14 5JP, United Kingdom

**Morgan Stanley Europe SE,**  
Große Gallusstraße 18, 60312 Frankfurt, Germany

**NN Re (Netherlands) NV,**  
Prinses Beatrixlaan 35-37, 2595 AK, The Hague, The Netherlands

**Nomura Financial Products Europe GmbH,**  
Rathenauplatz 1, 60313 Frankfurt am Main, Germany

**Société Générale,**  
29, Boulevard Haussmann, 75009 Paris, France

**UBS AG,**  
100 Liverpool Street, London EC2M 2RH, United Kingdom

### *Gegenparteien bei Devisentermingeschäften*

**Barclays Bank Ireland PLC,**  
One Molesworth Street, Dublin 2, D02 RF29, Ireland

**BNP Paribas SA,**  
16 Boulevard Des Italiens, 75009, Paris 9, France

**BofA Securities Europe SA,**  
51 Rue la Boétie, Paris 8, 75008, France

**Brown Brothers Harriman & Co.,**  
50 Post Office Square, Boston, MA 02110-1548, United States

**Deutsche Bank AG,**  
Taunusanlage 12, 60262 Frankfurt, Germany

**HSBC Continental Europe,**  
38, avenue Kléber, 75116 Paris, France

**J.P. Morgan SE,**  
Taunustor 1, 60310 Frankfurt, Germany

**Morgan Stanley Europe SE,**  
Große Gallusstraße 18, 60312 Frankfurt, Germany

## Organisation (Fortsetzung)

### *Gegenparteien bei Optionen*

**Société Générale,**  
29, Boulevard Haussmann, 75009 Paris, France

**State Street Bank and Trust Co.,**  
One Lincoln Street, Boston MA 02111-2900, United States

**UBS AG,**  
100 Liverpool Street, London EC2M 2RH, United Kingdom

**BNP Paribas SA,**  
16 Boulevard Des Italiens, 75009, Paris 9, France

**BofA Securities Europe SA,**  
51 Rue la Boétie, Paris 8, 75008, France

**J.P. Morgan SE,**  
Taunustor 1, 60310 Frankfurt, Germany



## Konsolidierter Abschluss (ausgedrückt in EUR)

### Konsolidierte Aufstellung des Nettovermögens zum 31.03.2022

	Erläuterungen	
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	2	<b>34.167.517.937,30</b>
Aktien		11.818.456.959,63
Organismen für gemeinsame Anlagen		927.556.556,84
Börsengehandelte Wertpapiere		5.848.297,50
Anleihen und andere Schuldtitel		20.581.126.827,20
Geldmarktinstrumente		834.529.296,13
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	2	<b>189.999.960,16</b>
Rohstoff-Swaps		1.360.101,09
Credit Default Swaps		2.171.955,63
Zinsswaps		271.661,41
Total Return Swaps		32.741.955,37
Devisentermingeschäfte		105.531.862,71
Futures		47.922.423,95
<b>Bankguthaben</b>		<b>1.217.608.698,47</b>
<b>Hinterlegte Sicherheiten</b>		<b>78.835.414,31</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte</b>	4,12	<b>1.315.532.482,84</b>
<b>Vermögenswerte Gesamt</b>		<b>36.969.494.493,08</b>
<b>Bankverbindlichkeiten</b>		<b>(623.220,91)</b>
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>	4,12	<b>(1.240.710.737,31)</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	2	<b>(78.604.181,48)</b>
Credit Default Swaps		(6.776.665,98)
Inflationsswap		(3.698.765,33)
Zinsswaps		(37.938.447,45)
Total Return Swaps		(4.105.591,06)
Index-Futures		(1.365.427,13)
Devisentermingeschäfte		(16.886.233,88)
Optionen		(434.300,25)
Futures		(7.398.750,40)
<b>Verbindlichkeiten Gesamt</b>		<b>(1.319.938.139,70)</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Berichtszeitraums</b>		<b>35.649.556.353,38</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) AAA ABS

(ausgedrückt in EUR)

### Statistische Angaben

<b>Nettovermögen</b>	31.03.2022	EUR	595.214.229,80
	30.09.2021	EUR	601.745.282,94
	30.09.2020	EUR	385.477.440,52
<b>Nettoinventarwert pro Anteil**</b>			
Capitalisation I (EUR)	31.03.2022	EUR	5.074,72
	30.09.2021	EUR	5.098,50
	30.09.2020	EUR	5.071,48
Capitalisation I Hedged (i) (USD)	31.03.2022	USD	-
	30.09.2021	USD	5.025,62
	30.09.2020	USD	-
Capitalisation Z (EUR)	31.03.2022	EUR	5.189,05
	30.09.2021	EUR	5.208,41
	30.09.2020	EUR	5.170,88
Capitalisation Zz (EUR)	31.03.2022	EUR	253.221,13
	30.09.2021	EUR	254.102,41
	30.09.2020	EUR	252.145,27
<b>Anzahl der Anteile</b>			
Capitalisation I (EUR)	31.03.2022		52.697
	30.09.2021		44.459
	30.09.2020		2.775
Capitalisation I Hedged (i) (USD)	31.03.2022		-
	30.09.2021		914
	30.09.2020		-
Capitalisation Z (EUR)	31.03.2022		17.681
	30.09.2021		18.066
	30.09.2020		18.667
Capitalisation Zz (EUR)	31.03.2022		932
	30.09.2021		1.090
	30.09.2020		1.090
<b>Laufende Kosten in %*</b>			
Capitalisation I (EUR)	31.03.2022		0,25%
Capitalisation Z (EUR)	31.03.2022		0,06%
Capitalisation Zz (EUR)	31.03.2022		0,01%
<b>Portfolioumsatz in %*</b>	31.03.2022		80,26%

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

## NN (L) AAA ABS

(ausgedrückt in EUR)

### Finanzabschlüsse

#### Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022

	Erläuterungen	
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	2	<b>585.195.112,89</b>
Organismen für gemeinsame Anlagen		38.141.917,04
Anleihen und andere Schuldtitel		547.053.195,85
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	2	<b>273.199,25</b>
Devisentermingeschäfte		273.199,25
<b>Bankguthaben</b>		<b>690.255,63</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte</b>	4	<b>21.758.881,18</b>
<b>Vermögenswerte Gesamt</b>		<b>607.917.448,95</b>
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>	4, 12	<b>(12.703.219,15)</b>
<b>Verbindlichkeiten Gesamt</b>		<b>(12.703.219,15)</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Berichtszeitraums</b>		<b>595.214.229,80</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) AAA ABS

(ausgedrückt in EUR)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW	Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
<b>Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>									
<b>Anleihen und andere Schuldtitel</b>									
<b>Irland</b>									
10.000.000	ACCUNIA EUROPEAN CLO III DAC - 3X A 20/01/2031 FRN	EUR	9.961.248,00	1,68	7.000.000	E-CARAT 12 PLC 12 A 18/08/2029 FRN	GBP	8.271.510,06	1,39
700.000	ALME LOAN FUNDING IV DAC 4X AR 15/01/2032 FRN	EUR	696.961,72	0,12	2.912.323	EUROSAIL 2006-1 PLC 2006-1X B1C 10/06/2044 FRN	GBP	3.379.557,46	0,57
2.500.000	ALME LOAN FUNDING IV DAC 4X ARE 15/01/2032 FRN	EUR	2.489.149,00	0,42	1.714.644	EUROSAIL 2006-4NP PLC 2006-4X M1C 10/12/2044 FRN	GBP	2.013.938,82	0,34
2.435.353	AURIUM CLO III DAC - 3X AR 16/04/2030 FRN	EUR	2.423.052,68	0,41	3.340.394	FINSBURY SQUARE 2020-2 PLC 2020-2X 16/06/2070 FRN	GBP	3.969.374,83	0,67
1.217.677	AURIUM CLO III DAC - 3X ARE 16/04/2030 FRN	EUR	1.211.526,35	0,20	7.500.000	FORMENTERA ISSUER PLC 2022-1 A 28/07/2047 FRN	GBP	8.841.216,14	1,49
2.500.000	AVOCA CLO XV DAC - 15X AR 15/04/2031 FRN	EUR	2.480.193,25	0,42	670.294	GREAT HALL MORTGAGES NO 1 PLC 2006-1 A2B 18/06/2038 FRN	EUR	660.302,56	0,11
9.986.000	BLACKROCK EUROPEAN CLO 1 DAC 15/03/2031 FRN	EUR	9.906.772,07	1,66	3.739.422	HOPS HILL NO 1 PLC - 1 A 27/05/2054 FRN	GBP	4.431.269,77	0,74
572.878	BLUESTEP MORTGAGE SECURITIES NO 4 DAC - 4 A 10/08/2066 FRN	EUR	572.934,20	0,10	2.917.000	NEWDAY FUNDING MASTER ISSUER PLC - SERIES 2021-1X A1 15/03/2029 FRN	GBP	3.448.100,06	0,58
371.638	CITIZEN IRISH AUTO RECEIVABLES TRUST 2018-1 A 15/12/2027 FRN	EUR	371.738,30	0,06	3.500.000	NEWDAY FUNDING 2019-1X A PLC 15/06/2027 FRN	GBP	4.144.581,10	0,70
1.550.329	CITIZEN IRISH AUTO RECEIVABLES TRUST 2020-1 A 15/12/2029 FRN	EUR	1.552.661,55	0,26	5.000.000	PAVILLION POINT OF SALE 2021-1 LTD 2021-1 A 30/12/2031 FRN	GBP	5.915.978,54	0,99
3.676.665	CONTEGO CLO IV DAC - 4X ARE 23/01/2030 FRN	EUR	3.649.009,49	0,61	3.097.795	RESIDENTIAL MORTGAGE SECURITIES 32 PLC 32X A 20/06/2070 FRN	GBP	3.687.236,39	0,62
6.385.000	CVC CORDATUS LOAN FUND III DAC - 3X A1RR 15/08/2032 FRN	EUR	6.335.108,25	1,06	2.881.057	SHAWBROOK MORTGAGE FUNDING 2019-1 PLC 2019-1 A 16/12/2050 FRN	GBP	3.413.179,22	0,57
3.120.591	DILOSK RBMS NO 3 DAC - 3 A 20/10/2057 FRN	EUR	3.121.062,08	0,52	10.522.080	STRATTON MORTGAGE FUNDING 2021-3 PLC 2021-3 A 12/12/2043 FRN	GBP	12.388.844,28	2,07
8.206.538	DILOSK RBMS NO 5 DAC - 5 A 20/12/2060 FRN	EUR	8.188.739,32	1,38	1.987.930	TOGETHER ASSET BACKED SECURITISATION 2018-1A 12/07/2050 FRN	GBP	2.356.847,71	0,40
2.071.277	EOS EUROPEAN LOAN CONDUIT NO 35 DAC - 35X A 23/04/2029 FRN	EUR	2.074.559,76	0,35	2.539.014	TOGETHER ASSET BACKED SECURITISATION 2019-1 PLC 2019-1 A 15/07/2061 FRN	GBP	3.010.528,31	0,51
1.812.096	FASTNET SECURITIES 13 DAC - 13 A 18/04/2057 FRN	EUR	1.811.713,99	0,30	3.530.165	TOWD POINT MORTGAGE FUNDING PLC - 2019-V2X A 20/02/2054 FRN	GBP	4.184.134,35	0,70
3.290.350	FINANCE IRELAND RBMS NO 1 DAC - 1 A 24/06/2058 FRN	EUR	3.291.085,47	0,55	7.000.000	TOWD POINT MORTGAGE FUNDING 2019 - GRAN 2019-GR 4X BR 20/10/2051 FRN	GBP	8.111.185,67	1,36
6.669.485	FINANCE IRELAND RBMS NO 2 DAC - 2 A 24/09/2060 FRN	EUR	6.675.715,87	1,12	2.764.294	TUDOR ROSE MORTGAGES 2021-1 A 20/06/2048 FRN	GBP	3.255.026,60	0,55
5.810.776	FINGAL SECURITIES RBMS DAC - 1 A 28/07/2055 FRN	EUR	5.825.047,36	0,98	<b>127.115.878,67 21,35</b>				
3.963.832	FORTUNA CONSUMER LOAN ABS 2021 DAC 2021 A 15/10/2030 FRN	EUR	3.967.028,54	0,67	<b>Niederlande</b>				
8.800.000	FORTUNA CONSUMER LOAN ABS 2021 DAC 2021 B 15/10/2030 FRN	EUR	8.717.337,38	1,46	14.491.166	BUMPER NL 2020-1 BV -2020-NL1 A 24/06/2031 FRN	EUR	14.601.384,98	2,44
9.285.827	GLENBEIGH 2 ISSUER DAC - 1X A 24/03/2046 FRN	EUR	9.216.915,28	1,55	3.450.424	CANDIDE FINANCING 2021-1 BV 2021-1 A 20/11/2060 FRN	EUR	3.512.364,82	0,59
5.526.884	GLENBEIGH 2 ISSUER 2021-2 DAC 2021-2X A 24/06/2050 FRN	EUR	5.594.160,69	0,94	3.806.510	DELFT 2020 BV 2020-1 A 17/10/2042 FRN	EUR	3.809.222,37	0,64
2.500.000	GOLDENTREE LOAN MANAGEMENT EUR CLO 1 DAC - 1X A1A 20/10/2030 FRN	EUR	2.482.423,25	0,42	8.785.249	DUTCH PROPERTY FINANCE 2017-1 BV 2017-1 A 28/01/2048 FRN	EUR	8.786.627,98	1,48
4.033.000	HARVEST CLO VIII DAC - 8X ARR 15/01/2031 FRN	EUR	4.008.802,00	0,67	7.298.435	DUTCH PROPERTY FINANCE 2018-1 BV 2018-1 A 28/04/2051 FRN	EUR	7.297.492,68	1,23
2.000.000	HARVEST CLO XVIII DAC-18X A1 15/10/2030 FRN	EUR	1.985.126,20	0,33	2.567.211	DUTCH PROPERTY FINANCE 2019-1 BV 2019-1 A 28/10/2052 FRN	EUR	2.567.305,93	0,43
1.800.000	JUBILEE CLO 2015-XV DAC 12/07/2028 FRN	EUR	1.791.852,66	0,30	3.787.819	DUTCH PROPERTY FINANCE 2020-1 BV 2020-1 A 28/07/2054 FRN	EUR	3.781.816,06	0,64
13.900.000	LT AUTORAHOITUS II DAC - 2 A 18/06/2031 FRN	EUR	13.989.089,97	2,36	5.700.000	DUTCH PROPERTY FINANCE 2022-CMBS1 BV 2022-CMBS A 28/04/2050 FRN	EUR	5.665.788,60	0,95
9.185.446	MULCAIR SECURITIES DAC - 1 A 24/04/2071 FRN	EUR	9.186.544,25	1,54	1.000.000	GLDR 2019-A 20/10/2027 FRN	EUR	994.716,63	0,17
4.800.000	PEMBROKE PROPERTY FINANCE - 2 A 01/06/2040 FRN	EUR	4.792.015,20	0,81	9.230.364	GREEN APPLE 2021-1 BV 2021-1 A 17/01/2060 FRN	EUR	9.383.564,32	1,58
11.920.936	PRIMROSE RESIDENTIAL 2021-1 DAC 2021-1 A 24/03/2061 FRN	EUR	11.859.349,37	2,00	4.600.000	GREEN STORM 2021 BV 2021-GRN A 22/02/2068 FRN	EUR	4.701.289,10	0,79
2.460.022	TAURUS 2019-1 FR DAC 2019-1FR A 02/02/2031 FRN	EUR	2.457.627,78	0,41	6.642.474	JUBILEE CLO 2015-XVI BV 2015-16X A1R 15/12/2029 FRN	EUR	6.607.732,75	1,11
3.433.485	TAURUS 2020-1 NL DAC 2020-NL1X A 20/02/2030 FRN	EUR	3.407.945,93	0,57	11.500.000	SILVER ARROW ATHLON NL 2021-1 BV 2021-1 A 26/04/2031 FRN	EUR	11.535.822,85	1,93
6.000.000	VOYA EURO I DAC 1X A 15/04/2020 FRN	EUR	5.959.989,60	1,00	6.000.000	STORM 2017-II BV 2017-2 A 22/05/2064 FRN	EUR	6.003.673,86	1,01
<b>162.054.486,81</b>				<b>27,23</b>	5.623.775	TULIP MORTGAGE FUNDING 2019-1 BV 2019-1 A 18/10/2056 FRN	EUR	5.634.641,13	0,95
<b>Frankreich</b>									
5.095.070	ATLAS FUNDING 2021-1 PLC 2021-1 A 25/07/2058 FRN	GBP	6.026.708,95	1,01	19.500.000	AUTO ABS FRENCH LEASES 2021 FCT 2021-FR1 A 29/06/2033 FRN	EUR	19.570.296,53	3,29
4.286.000	BARLEY HILL NO 2 PLC - 2 A 27/08/2058 FRN	GBP	5.070.995,03	0,85	6.304.664	BPCCE HOME LOANS FCT 2020 2020-1 A 31/10/2054 FRN	EUR	6.365.974,06	1,07
4.389.901	CASTELL 2019-1 PLC 2019-1 A 15/07/2052 FRN	GBP	5.203.618,82	0,87	5.000.000	CARS ALLIANCE AUTO LOANS FRANCE V 2018-1 21/10/2029 FRN	EUR	4.990.723,55	0,84
2.844.505	CASTELL 2020-1 PLC 2020-1 A 25/03/2053 FRN	GBP	3.374.057,03	0,57	7.400.000	FCT CREDIT AGRICOLE HABITAT 2020 2020-1 A 27/07/2055 FRN	EUR	7.493.163,63	1,26
7.332.497	CASTELL 2021-1 PLC 2021-1 A 25/11/2053 FRN	GBP	8.647.607,52	1,45	5.490.346	HARMONY FRENCH HOME LOANS FCT 2019-1 A 27/11/2062 FRN	EUR	5.532.307,86	0,93
3.000.000	CHESTER B1 ISSUER PLC B1 17/01/2058 FRN	GBP	3.544.068,16	0,60	4.268.450	HARMONY FRENCH HOME LOANS FCT 2020-2 2020-2 A 27/08/2061 FRN	EUR	4.294.861,87	0,72
8.257.293	DOWSON 2021-2 PLC 2021-2 A 20/10/2024 FRN	GBP	9.766.011,29	1,64	9.216.697	HARMONY FRENCH HOME LOANS FCT 2021-1 2021-1 A 27/05/2061 FRN	EUR	9.305.090,10	1,56

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) AAA ABS

(ausgedrückt in EUR)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
1.538.290	SILVER ARROW SA 2020-1FR A 20/11/2030 FRN	EUR	1.539.506,80	0,26
			<b>59.091.924,40</b>	<b>9,93</b>
<b>Luxemburg</b>				
1.200.000	BUMPER DE SA 2019-DE1 A 22/05/2028 FRN	EUR	1.199.825,95	0,20
3.539.882	BUMPER DE SA 2019-DE1 A 22/05/2028 FRN	EUR	3.543.792,02	0,60
3.709.174	CARTESIAN RESIDENTIAL MORTGAGES BLUE SA BLUE A 18/07/2044 FRN	EUR	3.712.619,30	0,62
5.600.495	CARTESIAN RESIDENTIAL MORTGAGES 4 SA -4 A 25/11/2054 FRN	EUR	5.603.914,49	0,94
6.500.000	COMPARTMENT VCL 34 B 21/09/2027 FRN	EUR	6.466.179,59	1,09
4.800.000	COMPARTMENT VCL 35 B 21/01/2028 FRN	EUR	4.800.499,68	0,81
6.163.488	FACT MASTER SA 2021-1 A 20/07/2028 FRN	EUR	6.185.791,26	1,04
5.220.471	MIRAVET SARL - COMPARTMENT 2020-1 2020-1 A 26/05/2065 FRN	EUR	5.219.405,92	0,88
11.288.333	MIRAVET SARL 2019-1 A 26/05/2065 FRN	EUR	11.249.253,62	1,88
5.900.000	PBD GERMANY AUTO LEASE MASTER SA 2021-GE2 A 26/11/2030 FRN	EUR	5.926.525,81	1,00
			<b>53.907.807,64</b>	<b>9,06</b>
<b>Spanien</b>				
3.879.817	DRIVER ESPANA SIX FT -6 A 25/09/2030 FRN	EUR	3.888.082,65	0,65
6.453.627	FONDO DE TITULIZACION RMBS PRADO V 5 A 15/03/2055 FRN	EUR	6.448.379,43	1,08
6.388.160	FT RMBS PRADO VIII 8 A 15/03/2055 FRN	EUR	6.421.027,34	1,08
5.900.000	FT RMBS PRADO X -10 A 16/03/2055 FRN	EUR	5.935.038,33	1,00
			<b>22.692.527,75</b>	<b>3,81</b>
<b>Belgien</b>				
11.000.000	BUMPER BE NV/SA 2021-BE1 A 23/10/2031 FRN	EUR	11.035.499,42	1,85
			<b>11.035.499,42</b>	<b>1,85</b>
<b>Deutschland</b>				
6.714.660	ASSET-BACKED EUROPEAN SECURITISATION TRANS 16 A 21/12/2028 FRN	EUR	6.720.766,35	1,13
			<b>6.720.766,35</b>	<b>1,13</b>
<b>Australien</b>				
1.621.237	LIBERTY FUNDING PTY LTD 2018-1 A1C 10/10/2049 FRN	EUR	1.612.068,30	0,27
3.699.336	PEPPER RESIDENTIAL SECURITIES TRUST NO 22 22X A1GE 20/06/2060 FRN	EUR	3.605.680,41	0,61
982.914	PEPPER RESIDENTIAL SECURITIES TRUST NO 25 25X A1GE 12/03/2061 FRN	EUR	963.389,65	0,16
			<b>6.181.138,36</b>	<b>1,04</b>
<b>Italien</b>				
3.357.047	RED & BLACK AUTO ITALY SRL-1 A 28/12/2031 FRN	EUR	3.369.722,39	0,57
			<b>3.369.722,39</b>	<b>0,57</b>
			<b>547.053.195,85</b>	<b>91,91</b>

### Organismen für gemeinsame Anlagen

#### Offene Fonds

<b>Luxemburg</b>				
38.617	NN (L) LIQUID EUR - Z CAP EUR	EUR	38.141.917,04	6,41
			<b>38.141.917,04</b>	<b>6,41</b>
			<b>38.141.917,04</b>	<b>6,41</b>
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>			<b>585.195.112,89</b>	<b>98,32</b>

### Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022

Zu erhalten	Zu zahlen	Fälligkeits- datum	Engagement in EUR	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR		
<b>Devisentermingeschäfte</b>						
125.402.247,62	EUR	106.149.621,71	GBP	30/06/2022	125.402.247,62	269.485,34
867.033,99	GBP	1.018.451,20	EUR	30/06/2022	1.018.451,20	3.637,78
10.002,31	EUR	11.083,66	USD	30/06/2022	10.002,31	76,13
					<b>126.430.701,13</b>	<b>273.199,25</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>						<b>273.199,25</b>

### Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick

		% NIW
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	<b>585.195.112,89</b>	<b>98,32</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	<b>273.199,25</b>	<b>0,05</b>
<b>Bankguthaben</b>	<b>690.255,63</b>	<b>0,12</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>	<b>9.055.662,03</b>	<b>1,51</b>
<b>Nettovermögen Gesamt</b>	<b>595.214.229,80</b>	<b>100,00</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Alternative Beta

(ausgedrückt in USD)

### Statistische Angaben

<b>Nettovermögen</b>	31.03.2022	USD	458.598.982,24	Distribution I Hedged (i) (GBP)	31.03.2022	GBP	-
	30.09.2021	USD	416.244.317,91		30.09.2021	GBP	12.173,76
	30.09.2020	EUR	366.351.090,65		30.09.2020	GBP	10.582,57
<b>Nettoinventarwert pro Anteil**</b>				Distribution I (HY) Hedged (i) (JPY)	31.03.2022	JPY	10.034,00
					30.09.2021	JPY	-
					30.09.2020	JPY	-
Capitalisation I (USD)	31.03.2022	USD	7.673,70	<b>Anzahl der Anteile</b>	Capitalisation I (USD)	31.03.2022	3.625
	30.09.2021	USD	7.574,04			30.09.2021	2.455
	30.09.2020	USD	6.531,82			30.09.2020	1.185
Capitalisation I Hedged (i) (CHF)	31.03.2022	CHF	6.532,28	Capitalisation I Hedged (i) (CHF)	31.03.2022		10.558
	30.09.2021	CHF	6.491,54		30.09.2021		9.855
	30.09.2020	CHF	5.670,66		30.09.2020		5.661
Capitalisation I Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	EUR	7.053,59	Capitalisation I Hedged (i) (EUR)	31.03.2022		29.874
	30.09.2021	EUR	6.988,15		30.09.2021		29.527
	30.09.2020	EUR	6.095,97		30.09.2020		17.963
Capitalisation I Hedged (i) (GBP)	31.03.2022	GBP	126,97	Capitalisation I Hedged (i) (GBP)	31.03.2022		74.552
	30.09.2021	GBP	125,50		30.09.2021		75.578
	30.09.2020	GBP	108,92		30.09.2020		87.234
Capitalisation I Hedged (i) (PLN)	31.03.2022	PLN	25.240,80	Capitalisation I Hedged (i) (PLN)	31.03.2022		181
	30.09.2021	PLN	24.814,77		30.09.2021		166
	30.09.2020	PLN	21.567,65		30.09.2020		274
Capitalisation N Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	EUR	337,70	Capitalisation N Hedged (i) (EUR)	31.03.2022		972
	30.09.2021	EUR	335,45		30.09.2021		972
	30.09.2020	EUR	292,95		30.09.2020		319
Capitalisation P (EUR)	31.03.2022	EUR	484,33	Capitalisation P (EUR)	31.03.2022		13.812
	30.09.2021	EUR	460,43		30.09.2021		4.107
	30.09.2020	EUR	394,98		30.09.2020		1.435
Capitalisation P (USD)	31.03.2022	USD	351,08	Capitalisation P (USD)	31.03.2022		52.807
	30.09.2021	USD	347,63		30.09.2021		61.163
	30.09.2020	USD	301,72		30.09.2020		46.724
Capitalisation P Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	EUR	324,12	Capitalisation P Hedged (i) (EUR)	31.03.2022		69.940
	30.09.2021	EUR	322,80		30.09.2021		76.369
	30.09.2020	EUR	283,46		30.09.2020		69.182
Capitalisation R Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	EUR	292,02	Capitalisation R Hedged (i) (EUR)	31.03.2022		1.410
	30.09.2021	EUR	290,09		30.09.2021		1.409
	30.09.2020	EUR	253,39		30.09.2020		710
Capitalisation X (EUR)	31.03.2022	EUR	467,99	Capitalisation X (EUR)	31.03.2022		69.922
	30.09.2021	EUR	445,57		30.09.2021		29.409
	30.09.2020	EUR	383,38		30.09.2020		10.386
Capitalisation X (USD)	31.03.2022	USD	356,05	Capitalisation X (USD)	31.03.2022		7.956
	30.09.2021	USD	353,09		30.09.2021		3.256
	30.09.2020	USD	307,39		30.09.2020		1.372
Capitalisation Zz Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	EUR	6.492,90				
	30.09.2021	EUR	6.419,24				
	30.09.2020	EUR	5.558,33				

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

## NN (L) Alternative Beta

(ausgedrückt in USD)

### Statistische Angaben (Fortsetzung)

#### Anzahl der Anteile

Capitalisation Zz Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	921
	30.09.2021	927
	30.09.2020	21.208
Distribution I Hedged (i) (GBP)	31.03.2022	-
	30.09.2021	0.12
	30.09.2020	4
Distribution I (HY) Hedged (i) (JPY)	31.03.2022	119,687
	30.09.2021	-
	30.09.2020	-

#### Laufende Kosten in %\*

Capitalisation I (USD)	31.03.2022	0,71%
Capitalisation I Hedged (i) (CHF)	31.03.2022	0,73%
Capitalisation I Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	0,73%
Capitalisation I Hedged (i) (GBP)	31.03.2022	0,73%
Capitalisation I Hedged (i) (PLN)	31.03.2022	0,73%
Capitalisation N Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	0,87%
Capitalisation P (EUR)	31.03.2022	1,35%
Capitalisation P (USD)	31.03.2022	1,35%
Capitalisation P Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	1,37%
Capitalisation R Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	0,87%
Capitalisation X (EUR)	31.03.2022	1,65%
Capitalisation X (USD)	31.03.2022	1,65%
Capitalisation Zz Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	0,01%
Distribution I (HY) Hedged (i) (JPY)	31.03.2022	0,73%
<b>Portfolioumsatz in %*</b>	31.03.2022	<b>(101,55%)</b>

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

## NN (L) Alternative Beta

(ausgedrückt in USD)

### Finanzabschlüsse

#### Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022

	Erläuterungen	
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	2	<b>302.720.595,60</b>
Anleihen und andere Schuldtitel		80.117,98
Geldmarktinstrumente		302.640.477,62
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	2	<b>10.401.975,24</b>
Rohstoff-Swaps		1.513.316,45
Futures		8.888.658,79
<b>Bankguthaben</b>		<b>161.172.104,13</b>
<b>Hinterlegte Sicherheiten</b>		<b>5.747.477,32</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte</b>	4, 12	<b>56.906.987,16</b>
<b>Vermögenswerte Gesamt</b>		<b>536.949.139,45</b>
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>	4, 12	<b>(75.773.365,79)</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	2	<b>(2.576.791,42)</b>
Index-Futures		(1.519.242,47)
Devisentermingeschäfte		(1.057.548,95)
<b>Verbindlichkeiten Gesamt</b>		<b>(78.350.157,21)</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Berichtszeitraums</b>		<b>458.598.982,24</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.



## NN (L) Alternative Beta

(ausgedrückt in USD)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW
<b>Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>				
<b>Anleihen und andere Schuldtitel</b>				
<b>Vereinigte Staaten</b>				
10.000	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 2.500% 15/02/2045	USD	9.740,63	0,00
10.000	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 3.125% 15/11/2041	USD	10.778,13	0,01
10.000	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 5.250% 15/02/2029	USD	11.768,75	0,01
10.000	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 5.250% 15/11/2028	USD	11.707,81	0,00
10.000	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 6.125% 15/08/2029	USD	12.509,38	0,00
10.000	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 6.625% 15/02/2027	USD	11.870,31	0,00
10.000	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 6.750% 15/08/2026	USD	11.742,97	0,00
			<b>80.117,98</b>	<b>0,02</b>

<b>Geldmarktinstrumente</b>				
<b>Vereinigte Staaten</b>				
13.000.000	UNITED STATES TREASURY BILL ZCP 07/04/2022	USD	12.999.659,92	2,83
15.000.000	UNITED STATES TREASURY BILL ZCP 07/07/2022	USD	14.977.267,35	3,27
26.000.000	UNITED STATES TREASURY BILL ZCP 11/08/2022	USD	25.921.148,50	5,65
10.000.000	UNITED STATES TREASURY BILL ZCP 14/07/2022	USD	9.982.564,50	2,18
20.000.000	UNITED STATES TREASURY BILL ZCP 21/07/2022	USD	19.959.102,40	4,35
			<b>83.839.742,67</b>	<b>18,28</b>
<b>Frankreich</b>				
18.000.000	BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL ZCP 01/04/2022	USD	18.000.000,00	3,92
15.000.000	FS SOCIETE GENERALE ZCP 15/11/2022	USD	14.842.261,65	3,24
17.000.000	METROPOLE DE LYON ZCP 14/04/2022	USD	16.997.923,62	3,71
			<b>49.840.185,27</b>	<b>10,87</b>
<b>Vereinigtes Königreich</b>				
13.000.000	QATAR NATIONAL BANK ZCP 01/07/2022 (1)	USD	12.965.486,56	2,83
7.000.000	QATAR NATIONAL BANK ZCP 28/06/2022 (1)	USD	6.981.439,29	1,52
20.000.000	ROYAL BANK OF CANADA ZCP 07/03/2023 (1)	USD	19.576.018,60	4,26
			<b>39.522.944,45</b>	<b>8,61</b>
<b>Australien</b>				
19.000.000	ANZ BANKING GROUP ZCP 07/06/2022	USD	18.967.197,45	4,14
10.000.000	MIZUHO BANK LTD ZCP 25/04/2022	USD	9.996.794,60	2,18
			<b>28.963.992,05</b>	<b>6,32</b>
<b>Kanada</b>				
3.000.000	TORONTO-DOMINION BANK/THE ZCP 14/11/2022	USD	2.968.654,62	0,65
18.000.000	TORONTO-DOMINION BANK/THE ZCP 28/07/2022	USD	17.931.107,16	3,91
			<b>20.899.761,78</b>	<b>4,56</b>
<b>Niederlande</b>				
20.000.000	ABN AMRO BANK ZCP 29/04/2022	USD	19.992.435,40	4,36
			<b>19.992.435,40</b>	<b>4,36</b>

(1) Kurzfristiges Einlagezertifikat.

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW
<b>Schweden</b>				
20.000.000	SWEDBANK AB ZCP 10/08/2022	USD	19.906.378,20	4,34
			<b>19.906.378,20</b>	<b>4,34</b>
<b>Spanien</b>				
20.000.000	BANCO SANTANDER ZCP 04/10/2022	USD	19.843.648,60	4,33
			<b>19.843.648,60</b>	<b>4,33</b>
<b>Norwegen</b>				
20.000.000	DNB BANK ASA ZCP 19/10/2022	USD	19.831.389,20	4,32
			<b>19.831.389,20</b>	<b>4,32</b>
			<b>302.640.477,62</b>	<b>65,99</b>
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>			<b>302.720.595,60</b>	<b>66,01</b>

### Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022

Stückzahl	Bezeichnung	Fälligkeits- datum	Währung	Nennwert	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in USD
<b>Rohstoff-Swap</b>					
161.627	COMMODITY ENHANCED CURVE INDEX	08/06/2022	USD	17.724.018,54	1.513.316,45
					<b>1.513.316,45</b>

Zu erhalten	Zu zahlen	Fälligkeits- datum	Engagement in USD	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in USD

<b>Devisentermingeschäfte</b>						
5.271.350,03	PLN	1.243.316,24	USD	19/04/2022	1.243.316,24	19.886,79
919.722,79	USD	695.521,95	GBP	19/04/2022	919.722,79	4.061,13
829.150,80	EUR	920.564,68	USD	01/04/2022	920.564,68	1.990,19
75.860,29	USD	67.947,77	EUR	04/04/2022	75.860,29	258,18
8.550,94	GBP	11.265,01	USD	04/04/2022	11.265,01	(6,41)
19.912,43	USD	18.365,23	CHF	04/04/2022	19.912,43	(44,35)
45.908,81	USD	42.759,47	CHF	01/04/2022	45.908,81	(556,25)
170.610,91	EUR	190.478,55	USD	04/04/2022	190.478,55	(648,27)
174.683,02	USD	743.925,32	PLN	19/04/2022	174.683,02	(3.587,96)
3.299.957,82	USD	3.082.952,46	CHF	19/04/2022	3.299.957,82	(51.827,97)
71.798.934,33	CHF	78.116.347,84	USD	19/04/2022	78.116.347,84	(56.549,31)
18.136.544,24	USD	16.353.289,08	EUR	19/04/2022	18.136.544,24	(66.846,46)
1.199.000.000,00	JPY	9.993.113,46	USD	19/04/2022	9.993.113,46	(111.923,19)
10.156.702,44	GBP	13.556.281,79	USD	19/04/2022	13.556.281,79	(184.880,55)

## NN (L) Alternative Beta

(ausgedrückt in USD)

### Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Zu erhalten	Zu zahlen	Fälligkeits- datum	Engagement in USD	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in USD
255.993.198,21 EUR	285.561.428,86 USD	19/04/2022	285.561.428,86	(606.874,52)
			<b>412.265.385,83</b>	<b>(1.057.548,95)</b>

Stückzahl	Bezeich- nung	Währung	Engagement in USD	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in USD
-----------	------------------	---------	----------------------	---

#### INDEX FUTURES

41.201	NDUEEGF INDEX 09/06/2022	USD	23.337.037,54	(1.519.242,47)
			<b>23.337.037,54</b>	<b>(1.519.242,47)</b>

#### Futures auf Aktienindizes

248	EURO STOXX 50 17/06/2022	EUR	10.549.078,96	571.879,84
91	NASDAQ 100 E-MINI 17/06/2022	USD	27.061.125,00	3.323.047,00
(32)	CBOE VIX FUTURE 18/05/2022	USD	799.606,40	22.633,60
(49)	CBOE VIX FUTURE 20/04/2022	USD	1.149.981,00	336.073,40
676	E-MINI RUSSEL 2000 17/06/2022	USD	69.844.320,00	4.366.987,50
66	FTSE 100 INDEX FUTURE 17/06/2022	GBP	6.505.251,42	356.285,48
(52)	NIKKEI 225 (SGX) 09/06/2022	JPY	5.954.026,78	(577.737,65)
50	S&P500 EMINI FUTURE 17/06/2022	USD	11.326.875,00	916.958,53
			<b>133.190.264,56</b>	<b>9.316.127,70</b>

#### Zins-Future

90	US 10YR NOTE (CBT) 21/06/2022	USD	11.058.750,00	(300.638,91)
			<b>11.058.750,00</b>	<b>(300.638,91)</b>

#### Währungs-Futures

142	DOLLAR INDEX 13/06/2022	USD	13.967.120,00	(126.830,00)
			<b>13.967.120,00</b>	<b>(126.830,00)</b>

**Derivative Finanzinstrumente Gesamt 7.825.183,82**

### Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick

		% NIW
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	<b>302.720.595,60</b>	<b>66,01</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	<b>7.825.183,82</b>	<b>1,71</b>
<b>Bankguthaben</b>	<b>161.172.104,13</b>	<b>35,14</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>	<b>(13.118.901,31)</b>	<b>(2,86)</b>
<b>Nettovermögen Gesamt</b>	<b>458.598.982,24</b>	<b>100,00</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Asia Income

(ausgedrückt in USD)

### Statistische Angaben

### Anzahl der Anteile

<b>Nettovermögen</b>	31.03.2022	USD	156.880.621,25	Capitalisation I (EUR)	31.03.2022	1.189	
	30.09.2021	USD	199.523.440,80		30.09.2021	1.352	
	30.09.2020	USD	191.165.705,07		30.09.2020	1.443	
<b>Nettoinventarwert pro Anteil**</b>				Capitalisation I Hedged (i) (PLN)	31.03.2022	-	
					30.09.2021	-	
					30.09.2020	916	
Capitalisation I (EUR)	31.03.2022	EUR	13.123,27	Capitalisation N (EUR)	31.03.2022	541.999	
	30.09.2021	EUR	14.074,79		30.09.2021	492.313	
	30.09.2020	EUR	9.824,95		30.09.2020	495.883	
Capitalisation I Hedged (i) (PLN)	31.03.2022	PLN	-	Capitalisation O (USD)	31.03.2022	1.572	
	30.09.2021	PLN	-		30.09.2021	1.732	
	30.09.2020	PLN	34.394,43		30.09.2020	1.847	
Capitalisation N (EUR)	31.03.2022	EUR	41,72	Capitalisation P (EUR)	31.03.2022	1.281	
	30.09.2021	EUR	44,79		30.09.2021	1.299	
	30.09.2020	EUR	37,81		30.09.2020	1.806	
Capitalisation O (USD)	31.03.2022	USD	1.389,24	Capitalisation P (USD)	31.03.2022	39.240	
	30.09.2021	USD	1.551,88		30.09.2021	48.130	
	30.09.2020	USD	1.322,85		30.09.2020	51.792	
Capitalisation P (EUR)	31.03.2022	EUR	482,62	Capitalisation X (USD)	31.03.2022	7.529	
	30.09.2021	EUR	520,30		30.09.2021	6.537	
	30.09.2020	EUR	442,95		30.09.2020	4.565	
Capitalisation P (USD)	31.03.2022	USD	1.329,81	Distribution P (USD)	31.03.2022	4.412	
	30.09.2021	USD	1.493,30		30.09.2021	5.044	
	30.09.2020	USD	1.286,35		30.09.2020	5.482	
Capitalisation X (USD)	31.03.2022	USD	1.203,91	Distribution R (USD)	31.03.2022	3.644	
	30.09.2021	USD	1.355,26		30.09.2021	3.863	
	30.09.2020	USD	1.173,14		30.09.2020	4.733	
Distribution P (USD)	31.03.2022	USD	565,40	Distribution X (M) (USD)	31.03.2022	140.376	
	30.09.2021	USD	687,96		30.09.2021	168.218	
	30.09.2020	USD	636,81		30.09.2020	133.056	
Distribution R (USD)	31.03.2022	USD	200,23	Distribution X (M) Hedged (ii) (AUD)	31.03.2022	41.606	
	30.09.2021	USD	242,60		30.09.2021	41.772	
	30.09.2020	USD	222,82		30.09.2020	40.185	
Distribution X (M) (USD)	31.03.2022	USD	193,89	Distribution Y (M) (USD)	31.03.2022	69.922	
	30.09.2021	USD	226,79		30.09.2021	79.052	
	30.09.2020	USD	210,55		30.09.2020	123.302	
Distribution X (M) Hedged (ii) (AUD)	31.03.2022	AUD	191,97				
	30.09.2021	AUD	224,51				
	30.09.2020	AUD	212,57				
Distribution Y (M) (USD)	31.03.2022	USD	197,46	<b>Dividende</b>			
	30.09.2021	USD	232,42	Distribution P (USD)	14.12.2021	USD	53,00
	30.09.2020	USD	218,32	Distribution R (USD)	14.12.2021	USD	18,60
				Distribution X (M) (USD)	02.03.2022	USD	1,40
				Distribution X (M) (USD)	07.02.2022	USD	1,40

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

## NN (L) Asia Income

(ausgedrückt in USD)

### Statistische Angaben (Fortsetzung)

				Distribution Y (M) (USD)	31.03.2022	3,40%
Distribution X (M) (USD)	04.01.2022	USD	1,40	<b>Portfolioumsatz in %*</b>	31.03.2022	117,14%
Distribution X (M) (USD)	02.12.2021	USD	1,40			
Distribution X (M) (USD)	02.11.2021	USD	1,40			
Distribution X (M) (USD)	04.10.2021	USD	1,40			
Distribution X (M) Hedged (ii) (AUD)	02.03.2022	AUD	1,47			
Distribution X (M) Hedged (ii) (AUD)	07.02.2022	AUD	1,47			
Distribution X (M) Hedged (ii) (AUD)	04.01.2022	AUD	1,47			
Distribution X (M) Hedged (ii) (AUD)	02.12.2021	AUD	1,47			
Distribution X (M) Hedged (ii) (AUD)	02.11.2021	AUD	1,47			
Distribution X (M) Hedged (ii) (AUD)	04.10.2021	AUD	1,47			
Distribution Y (M) (USD)	02.03.2022	USD	1,48			
Distribution Y (M) (USD)	07.02.2022	USD	1,48			
Distribution Y (M) (USD)	04.01.2022	USD	1,48			
Distribution Y (M) (USD)	02.12.2021	USD	1,48			
Distribution Y (M) (USD)	02.11.2021	USD	1,48			
Distribution Y (M) (USD)	04.10.2021	USD	1,48			
<b>Laufende Kosten in %*</b>						
Capitalisation I (EUR)	31.03.2022		0,86%			
Capitalisation N (EUR)	31.03.2022		1,05%			
Capitalisation O (USD)	31.03.2022		0,85%			
Capitalisation P (EUR)	31.03.2022		1,90%			
Capitalisation P (USD)	31.03.2022		1,90%			
Capitalisation X (USD)	31.03.2022		2,40%			
Distribution P (USD)	31.03.2022		1,90%			
Distribution R (USD)	31.03.2022		1,14%			
Distribution X (M) (USD)	31.03.2022		2,40%			
Distribution X (M) Hedged (ii) (AUD)	31.03.2022		2,42%			

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

## NN (L) Asia Income

(ausgedrückt in USD)

### Finanzabschlüsse

#### Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022

	Erläuterungen	
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	2	<b>149.003.190,06</b>
Aktien		149.003.190,06
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	2	<b>380.863,85</b>
Devisentermingeschäfte		235.629,44
Futures		145.234,41
<b>Bankguthaben</b>		<b>2.154.602,75</b>
<b>Hinterlegte Sicherheiten</b>		<b>1.114.052,91</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte</b>	4, 12	<b>8.812.075,95</b>
<b>Vermögenswerte Gesamt</b>		<b>161.464.785,52</b>
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>	4	<b>(4.226.381,84)</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	2	<b>(357.782,43)</b>
Optionen		(357.782,43)
<b>Verbindlichkeiten Gesamt</b>		<b>(4.584.164,27)</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Berichtszeitraums</b>		<b>156.880.621,25</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Asia Income

(ausgedrückt in USD)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW
<b>Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>				
<b>Aktien</b>				
<b>Taiwan</b>				
116.000	ASUSTEK COMPUTER INC	TWD	1.512.751,03	0,96
785.000	EVERGREEN MARINE CORP TAIWAN LTD	TWD	3.710.608,65	2,37
470.000	HON HAI PRECISION INDUSTRY CO LTD	TWD	1.738.845,20	1,11
335.000	KINSUS INTERCONNECT TECHNOLOGY CORP	TWD	2.274.312,48	1,45
785.000	NAN YA PLASTICS CORP	TWD	2.551.610,62	1,63
2.137.000	QUANTA COMPUTER INC	TWD	6.580.716,06	4,19
514.000	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING CO LTD	TWD	10.664.315,82	6,80
155.000	UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	TWD	1.348.524,29	0,86
			<b>30.381.684,15</b>	<b>19,37</b>
<b>Kaimaninseln</b>				
350.000	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	HKD	4.835.027,70	3,08
265.000	CHINA RESOURCES LAND LTD	HKD	1.229.643,82	0,78
2.805.000	CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	HKD	1.643.881,36	1,05
26.371	JD.COM INC - A	HKD	758.309,65	0,48
41.500	JD.COM INC - ADR	USD	2.401.605,00	1,53
310.000	KUAISHOU TECHNOLOGY - B	HKD	2.868.540,19	1,83
110.000	LI NING CO LTD	HKD	943.511,16	0,60
165.000	MENTUAN - B	HKD	3.217.297,70	2,05
15.000	SILERGY CORP	TWD	1.793.627,13	1,14
131.000	TENCENT HOLDINGS LTD	HKD	6.146.599,15	3,92
60.000	TRIP.COM GROUP LTD - ADR	USD	1.387.200,00	0,88
2.270.000	WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	HKD	2.096.974,89	1,34
535.000	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	HKD	939.059,78	0,60
			<b>30.261.277,53</b>	<b>19,28</b>
<b>China</b>				
3.610.000	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD - H	HKD	2.107.581,00	1,34
6.928.000	CHINA CONSTRUCTION BANK CORP - H	HKD	5.194.029,01	3,31
360.000	CHINA LONGYUAN POWER GROUP CORP LTD - H	HKD	814.296,70	0,52
770.000	CITIC SECURITIES CO LTD - H	HKD	1.771.098,22	1,13
18.800	CONTEMPORARY AMPEREX TECHNOLOGY CO LTD - A	CNH	1.510.345,74	0,96
9.590.000	INDUSTRIAL & COMMERCIAL BANK OF CHINA LTD - H	HKD	5.879.050,59	3,75
213.729	LONGI GREEN ENERGY TECHNOLOGY CO LTD - A	CNH	2.421.028,86	1,54
514.540	NARI TECHNOLOGY CO LTD - A	CNH	2.549.405,68	1,63
278.364	WUXI LEAD INTELLIGENT EQUIPMENT CO LTD - A	CNH	2.561.169,58	1,63
			<b>24.808.005,38</b>	<b>15,81</b>
<b>Südkorea</b>				
88.000	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	KRW	5.053.803,86	3,22
18.000	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD - PREF	KRW	935.159,83	0,60
170.700	SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD	KRW	5.834.840,81	3,72
35.000	SK HYNIX INC	KRW	3.401.719,25	2,17
			<b>15.225.523,75</b>	<b>9,71</b>
<b>Indien</b>				
70.000	HCL TECHNOLOGIES LTD	INR	1.075.144,60	0,69
70.000	HDFC BANK LTD	INR	1.358.426,50	0,87
86.000	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP LTD	INR	2.714.026,37	1,72
80.000	INFOSYS LTD	INR	2.017.221,96	1,29
55.000	PERSISTENT SYSTEMS LTD	INR	3.467.058,47	2,21

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW
52.866	RELIANCE INDUSTRIES LTD	INR	1.839.964,85	1,17
			<b>12.471.842,75</b>	<b>7,95</b>
<b>Singapur</b>				
70.000	DBS GROUP HOLDINGS LTD	SGD	1.850.003,82	1,18
420.000	SINGAPORE AIRLINES LTD	SGD	1.703.647,05	1,09
360.000	UNITED OVERSEAS BANK LTD	SGD	8.509.318,95	5,42
			<b>12.062.969,82</b>	<b>7,69</b>
<b>Indonesien</b>				
13.740.000	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	IDR	6.296.689,98	4,01
7.815.000	BANK RAKYAT INDONESIA PERSERO TBK PT	IDR	2.534.895,51	1,62
960.000	UNITED TRACTORS TBK PT	IDR	1.708.608,95	1,08
			<b>10.540.194,44</b>	<b>6,71</b>
<b>Thailand</b>				
1.690.000	AIRPORTS OF THAILAND PCL	THB	3.364.421,76	2,15
550.000	INDORAMA VENTURES PCL	THB	770.133,14	0,49
650.000	KASIKORN BANK PCL	THB	3.152.730,85	2,01
			<b>7.287.285,75</b>	<b>4,65</b>
<b>Malaysia</b>				
1.895.000	MALAYAN BANKING BHD	MYR	4.028.902,73	2,57
			<b>4.028.902,73</b>	<b>2,57</b>
<b>Hongkong</b>				
185.000	AIA GROUP LTD	HKD	1.935.503,76	1,23
			<b>1.935.503,76</b>	<b>1,23</b>
			<b>149.003.190,06</b>	<b>94,98</b>
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>			<b>149.003.190,06</b>	<b>94,98</b>

### Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022

Zu erhalten	Zu zahlen	Fälligkeits- datum	Engagement in USD	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in USD		
<b>Devisentermingeschäfte</b>						
1.916.042,22	AUD	39.075.171,00	TWD	21/04/2022	1.390.375,98	73.427,37
3.133.228,23	AUD	17.882.729,12	HKD	20/04/2022	2.279.686,15	69.546,39
956.120,31	AUD	837.083.335,00	KRW	21/04/2022	693.808,67	28.444,97
1.723.778,56	AUD	1.266.776,39	USD	20/04/2022	1.266.776,39	27.934,86
966.028,36	AUD	4.456.586,28	CNY	20/04/2022	701.488,28	23.428,85
801.926,89	AUD	44.535.065,73	INR	21/04/2022	581.039,96	16.309,56
730.836,94	AUD	724.298,82	SGD	20/04/2022	532.215,54	13.776,37
396.133,31	AUD	9.452.671,61	THB	20/04/2022	287.454,12	13.228,44
607.672,69	AUD	6.376.582.683,00	IDR	21/04/2022	443.140,62	12.305,35
220.622,69	AUD	675.064,79	MYR	22/04/2022	160.477,60	5.523,65
695.970,52	THB	27.695,18	AUD	20/04/2022	20.702,63	130,78
831,82	AUD	541,50	EUR	20/04/2022	603,61	21,99
421.512.622,00	IDR	39.098,06	AUD	21/04/2022	29.375,75	(8,95)

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Asia Income

(ausgedrückt in USD)

### Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Zu erhalten	Zu zahlen	Fälligkeits- datum	Engagement in USD	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in USD
35.389,57 MYR	11.224,82 AUD	22/04/2022	8.417,07	(33,37)
4.604.397,00 TWD	214.378,73 AUD	21/04/2022	161.154,34	(92,12)
98.271.996,00 KRW	108.315,27 AUD	21/04/2022	80.354,48	(386,48)
7.964.330,54 INR	140.270,76 AUD	21/04/2022	104.316,42	(558,19)
98.362,10 SGD	97.855,51 AUD	20/04/2022	72.257,64	(823,49)
2.258.419,49 CNY	479.534,48 AUD	20/04/2022	356.003,87	(4.354,39)
5.241.977,69 HKD	916.176,30 AUD	20/04/2022	669.856,97	(18.681,79)
902.399,07 USD	1.232.755,81 AUD	20/04/2022	902.399,07	(23.510,36)
			<b>10.741.905,16</b>	<b>235.629,44</b>

Stückzahl	Bezeich- nung	Währung	Engagement in USD	Marktwert in USD
-----------	------------------	---------	----------------------	---------------------

#### Optionen

(11.733)	CALL TAIWAN STOCK WEIGHTED INDEX 09/04/2022 17862.80	TWD	7.245.606,11	0,00
(30.412.856)	CALL KOREA STOCK KOSPI 200 INDEX 09/04/2022 361.71	KRW	9.173.915,50	(70.004,02)
(10.430)	CALL TAIWAN STOCK WEIGHTED INDEX 14/04/2022 17470.84	TWD	6.440.950,46	(119.804,46)
(26.895.080)	CALL KOREA STOCK KOSPI 200 INDEX 14/04/2022 360.55	KRW	8.112.792,54	(167.973,95)
			<b>30.973.264,61</b>	<b>(357.782,43)</b>

Stückzahl	Bezeich- nung	Währung	Engagement in USD	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in USD
-----------	------------------	---------	----------------------	---

#### Futures auf Aktienindizes

40	FTSE TAIWAN INDEX 28/04/2022	USD	2.470.400,00	26.970,00
130	KOSPI2 INDEX FUTURE 09/06/2022	KRW	9.805.907,35	74.279,41
120	SGX NIFTY 50 28/04/2022	USD	4.208.760,00	43.985,00
			<b>16.485.067,35</b>	<b>145.234,41</b>

**Derivative Finanzinstrumente Gesamt** **23.081,42**

### Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick

		% NIW
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	<b>149.003.190,06</b>	<b>94,98</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	<b>23.081,42</b>	<b>0,01</b>
<b>Bankguthaben</b>	<b>2.154.602,75</b>	<b>1,37</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>	<b>5.699.747,02</b>	<b>3,64</b>
<b>Nettovermögen Gesamt</b>	<b>156.880.621,25</b>	<b>100,00</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Asian Debt (Hard Currency)

(ausgedrückt in USD)

### Statistische Angaben

<b>Nettovermögen</b>	31.03.2022	USD	326.307.014,16	Distribution I (Q) Hedged (i) (CHF)	31.03.2022	CHF	4.205,97
	30.09.2021	USD	471.403.739,40		30.09.2021	CHF	4.777,63
	30.09.2020	USD	612.517.638,27		30.09.2020	CHF	-
<b>Nettoinventarwert pro Anteil**</b>				Distribution N Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	EUR	202,61
					30.09.2021	EUR	233,92
					30.09.2020	EUR	248,35
Capitalisation I (USD)	31.03.2022	USD	8.658,47	Distribution O (USD)	31.03.2022	USD	3.685,59
	30.09.2021	USD	9.637,09		30.09.2021	USD	4.233,88
	30.09.2020	USD	9.803,11		30.09.2020	USD	4.453,23
Capitalisation I Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	EUR	5.397,69	Distribution P (EUR)	31.03.2022	EUR	237,71
	30.09.2021	EUR	6.043,96		30.09.2021	EUR	-
	30.09.2020	EUR	6.204,42		30.09.2020	EUR	-
Capitalisation P (USD)	31.03.2022	USD	1.952,32	Distribution P (USD)	31.03.2022	USD	3.684,32
	30.09.2021	USD	2.177,49		30.09.2021	USD	4.216,20
	30.09.2020	USD	2.224,27		30.09.2020	USD	4.434,33
Capitalisation P Hedged (i) (SGD)	31.03.2022	SGD	13,98	Distribution P Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	EUR	202,61
	30.09.2021	SGD	15,58		30.09.2021	EUR	233,27
	30.09.2020	SGD	15,90		30.09.2020	EUR	247,65
Capitalisation R (USD)	31.03.2022	USD	1.984,84	Distribution P (M) (USD)	31.03.2022	USD	209,97
	30.09.2021	USD	2.209,33		30.09.2021	USD	237,25
	30.09.2020	USD	2.247,86		30.09.2020	USD	249,04
Capitalisation R Hedged (i) (CHF)	31.03.2022	CHF	227,11	Distribution P (M) Hedged (i) (AUD)	31.03.2022	AUD	290,41
	30.09.2021	CHF	254,56		30.09.2021	AUD	328,14
	30.09.2020	CHF	261,91		30.09.2020	AUD	343,82
Capitalisation U (USD)	31.03.2022	USD	4.911,33	Distribution R (USD)	31.03.2022	USD	3.739,78
	30.09.2021	USD	5.457,42		30.09.2021	USD	4.224,37
	30.09.2020	USD	5.533,18		30.09.2020	USD	-
Capitalisation U Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	EUR	4.277,29	Distribution U (Q) (USD)	31.03.2022	USD	4.400,06
	30.09.2021	EUR	-		30.09.2021	USD	4.965,83
	30.09.2020	EUR	4.941,47		30.09.2020	USD	5.207,98
Capitalisation U Hedged (i) (SGD)	31.03.2022	SGD	6.753,21	Distribution X (M) (USD)	31.03.2022	USD	68,39
	30.09.2021	SGD	7.499,81		30.09.2021	USD	79,85
	30.09.2020	SGD	7.602,40		30.09.2020	USD	88,38
Capitalisation X (USD)	31.03.2022	USD	1.762,28	Distribution X (M) Hedged (i) (AUD)	31.03.2022	AUD	163,84
	30.09.2021	USD	1.970,43		30.09.2021	AUD	191,75
	30.09.2020	USD	2.022,80		30.09.2020	AUD	213,37
Capitalisation Y (USD)	31.03.2022	USD	280,46	Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR)	31.03.2022	ZAR	2.228,72
	30.09.2021	USD	315,17		30.09.2021	ZAR	2.600,62
	30.09.2020	USD	326,80		30.09.2020	ZAR	2.872,44
Capitalisation Z (USD)	31.03.2022	USD	4.996,25	Distribution Y (M) (USD)	31.03.2022	USD	154,25
	30.09.2021	USD	5.541,02		30.09.2021	USD	181,24
	30.09.2020	USD	5.596,05		30.09.2020	USD	202,96
Distribution I (Q) (USD)	31.03.2022	USD	4.620,19				
	30.09.2021	USD	5.213,81				
	30.09.2020	USD	5.467,95				

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.



## NN (L) Asian Debt (Hard Currency)

(ausgedrückt in USD)

### Statistische Angaben (Fortsetzung)

				<b>Anzahl der Anteile</b>		
Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD)	31.03.2022	AUD	183,74	Distribution I (Q) (USD)	31.03.2022	1.487
	30.09.2021	AUD	216,44		30.09.2021	5.489
	30.09.2020	AUD	243,59		30.09.2020	10.181
Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR)	31.03.2022	ZAR	1.990,05	Distribution I (Q) Hedged (i) (CHF)	31.03.2022	40
	30.09.2021	ZAR	2.354,08		30.09.2021	40
	30.09.2020	ZAR	2.654,90		30.09.2020	-
<b>Anzahl der Anteile</b>				Distribution N Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	28.110
Capitalisation I (USD)	31.03.2022		5.682		30.09.2021	30.510
	30.09.2021		7.716		30.09.2020	42.179
	30.09.2020		9.036	Distribution O (USD)	31.03.2022	693
Capitalisation I Hedged (i) (EUR)	31.03.2022		7.537		30.09.2021	688
	30.09.2021		9.310		30.09.2020	734
	30.09.2020		9.276	Distribution P (EUR)	31.03.2022	21
Capitalisation P (USD)	31.03.2022		6.999		30.09.2021	-
	30.09.2021		15.052		30.09.2020	-
	30.09.2020		21.285	Distribution P (USD)	31.03.2022	4.023
Capitalisation P Hedged (i) (SGD)	31.03.2022		72.031		30.09.2021	4.471
	30.09.2021		113.340		30.09.2020	6.719
	30.09.2020		86.919	Distribution P Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	2.066
Capitalisation R (USD)	31.03.2022		591		30.09.2021	2.110
	30.09.2021		785		30.09.2020	1.598
	30.09.2020		611	Distribution P (M) (USD)	31.03.2022	7.036
Capitalisation R Hedged (i) (CHF)	31.03.2022		1.767		30.09.2021	7.036
	30.09.2021		3.128		30.09.2020	8.828
	30.09.2020		6.827	Distribution P (M) Hedged (i) (AUD)	31.03.2022	442
Capitalisation U (USD)	31.03.2022		6.155		30.09.2021	442
	30.09.2021		8.090		30.09.2020	819
	30.09.2020		6.395	Distribution R (USD)	31.03.2022	5
Capitalisation U Hedged (i) (EUR)	31.03.2022		176		30.09.2021	17
	30.09.2021		-		30.09.2020	-
	30.09.2020		7	Distribution U (Q) (USD)	31.03.2022	1.418
Capitalisation U Hedged (i) (SGD)	31.03.2022		1.103		30.09.2021	2.226
	30.09.2021		744		30.09.2020	1.558
	30.09.2020		797	Distribution X (M) (USD)	31.03.2022	660.497
Capitalisation X (USD)	31.03.2022		16.529		30.09.2021	746.399
	30.09.2021		18.264		30.09.2020	960.456
	30.09.2020		25.082	Distribution X (M) Hedged (i) (AUD)	31.03.2022	90.342
Capitalisation Y (USD)	31.03.2022		15.757		30.09.2021	105.672
	30.09.2021		16.102		30.09.2020	139.082
	30.09.2020		24.859	Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR)	31.03.2022	26.180
Capitalisation Z (USD)	31.03.2022		1.472		30.09.2021	29.234
	30.09.2021		1.472		30.09.2020	41.696
	30.09.2020		1.472			

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

## NN (L) Asian Debt (Hard Currency)

(ausgedrückt in USD)

### Statistische Angaben (Fortsetzung)

#### Anzahl der Anteile

Distribution Y (M) (USD)	31.03.2022	177.320
	30.09.2021	171.376
	30.09.2020	248.731
Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD)	31.03.2022	30.460
	30.09.2021	40.280
	30.09.2020	53.927
Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR)	31.03.2022	54.757
	30.09.2021	55.617
	30.09.2020	79.000

#### Dividende

Distribution I (Q) (USD)	11.02.2022	USD	32,84
Distribution I (Q) (USD)	11.11.2021	USD	34,70
Distribution I (Q) Hedged (i) (CHF)	11.02.2022	CHF	29,74
Distribution I (Q) Hedged (i) (CHF)	11.11.2021	CHF	31,55
Distribution N Hedged (i) (EUR)	14.12.2021	EUR	6,90
Distribution O (USD)	14.12.2021	USD	134,25
Distribution P (USD)	14.12.2021	USD	104,25
Distribution P Hedged (i) (EUR)	14.12.2021	EUR	5,70
Distribution P (M) (USD)	02.03.2022	USD	0,47
Distribution P (M) (USD)	02.02.2022	USD	0,47
Distribution P (M) (USD)	04.01.2022	USD	0,47
Distribution P (M) (USD)	02.12.2021	USD	0,51
Distribution P (M) (USD)	02.11.2021	USD	0,51
Distribution P (M) (USD)	04.10.2021	USD	0,51
Distribution P (M) Hedged (i) (AUD)	02.03.2022	AUD	0,59
Distribution P (M) Hedged (i) (AUD)	02.02.2022	AUD	0,59
Distribution P (M) Hedged (i) (AUD)	04.01.2022	AUD	0,59
Distribution P (M) Hedged (i) (AUD)	02.12.2021	AUD	0,59
Distribution P (M) Hedged (i) (AUD)	02.11.2021	AUD	0,59
Distribution P (M) Hedged (i) (AUD)	04.10.2021	AUD	0,59

Distribution R (USD)	14.12.2021	USD	60,60
Distribution U (Q) (USD)	11.02.2022	USD	35,22
Distribution U (Q) (USD)	11.11.2021	USD	37,15
Distribution X (M) (USD)	02.03.2022	USD	0,54
Distribution X (M) (USD)	02.02.2022	USD	0,54
Distribution X (M) (USD)	04.01.2022	USD	0,54
Distribution X (M) (USD)	02.12.2021	USD	0,54
Distribution X (M) (USD)	02.11.2021	USD	0,54
Distribution X (M) (USD)	04.10.2021	USD	0,54
Distribution X (M) Hedged (i) (AUD)	02.03.2022	AUD	1,33
Distribution X (M) Hedged (i) (AUD)	02.02.2022	AUD	1,33
Distribution X (M) Hedged (i) (AUD)	04.01.2022	AUD	1,33
Distribution X (M) Hedged (i) (AUD)	02.12.2021	AUD	1,33
Distribution X (M) Hedged (i) (AUD)	02.11.2021	AUD	1,33
Distribution X (M) Hedged (i) (AUD)	04.10.2021	AUD	1,33
Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR)	02.03.2022	ZAR	27,50
Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR)	02.02.2022	ZAR	27,50
Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR)	04.01.2022	ZAR	27,50
Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR)	02.12.2021	ZAR	27,50
Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR)	02.11.2021	ZAR	27,50
Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR)	04.10.2021	ZAR	27,50
Distribution Y (M) (USD)	02.03.2022	USD	1,26
Distribution Y (M) (USD)	02.02.2022	USD	1,26
Distribution Y (M) (USD)	04.01.2022	USD	1,26
Distribution Y (M) (USD)	02.12.2021	USD	1,26
Distribution Y (M) (USD)	02.11.2021	USD	1,26
Distribution Y (M) (USD)	04.10.2021	USD	1,26
Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD)	02.03.2022	AUD	1,54

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

## NN (L) Asian Debt (Hard Currency)

(ausgedrückt in USD)

### Statistische Angaben (Fortsetzung)

				Distribution O (USD)	31.03.2022	0,60%
Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD)	02.02.2022	AUD	1,54	Distribution P (EUR)	31.03.2022	1,30%
Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD)	04.01.2022	AUD	1,54	Distribution P (USD)	31.03.2022	1,30%
Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD)	02.12.2021	AUD	1,54	Distribution P Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	1,32%
Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD)	02.11.2021	AUD	1,54	Distribution P (M) (USD)	31.03.2022	1,30%
Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD)	04.10.2021	AUD	1,54	Distribution P (M) Hedged (i) (AUD)	31.03.2022	1,32%
Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR)	02.03.2022	ZAR	27,50	Distribution R (USD)	31.03.2022	0,90%
Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR)	02.02.2022	ZAR	27,50	Distribution U (Q) (USD)	31.03.2022	0,55%
Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR)	04.01.2022	ZAR	27,50	Distribution X (M) (USD)	31.03.2022	1,80%
Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR)	02.12.2021	ZAR	27,50	Distribution X (M) Hedged (i) (AUD)	31.03.2022	1,82%
Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR)	02.11.2021	ZAR	27,50	Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR)	31.03.2022	1,82%
Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR)	04.10.2021	ZAR	27,50	Distribution Y (M) (USD)	31.03.2022	2,80%
				Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD)	31.03.2022	2,82%
				Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR)	31.03.2022	2,82%
<b>Laufende Kosten in %*</b>				<b>Portfolioumsatz in %*</b>	31.03.2022	(5,59%)
Capitalisation I (USD)	31.03.2022		0,88%			
Capitalisation I Hedged (i) (EUR)	31.03.2022		0,90%			
Capitalisation P (USD)	31.03.2022		1,30%			
Capitalisation P Hedged (i) (SGD)	31.03.2022		1,31%			
Capitalisation R (USD)	31.03.2022		0,90%			
Capitalisation R Hedged (i) (CHF)	31.03.2022		0,91%			
Capitalisation U (USD)	31.03.2022		0,55%			
Capitalisation U Hedged (i) (EUR)	31.03.2022		0,57%			
Capitalisation U Hedged (i) (SGD)	31.03.2022		0,57%			
Capitalisation X (USD)	31.03.2022		1,80%			
Capitalisation Y (USD)	31.03.2022		2,80%			
Capitalisation Z (USD)	31.03.2022		0,16%			
Distribution I (Q) (USD)	31.03.2022		0,88%			
Distribution I (Q) Hedged (i) (CHF)	31.03.2022		0,90%			
Distribution N Hedged (i) (EUR)	31.03.2022		0,82%			

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

## NN (L) Asian Debt (Hard Currency)

(ausgedrückt in USD)

### Finanzabschlüsse

#### Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022

	Erläuterungen	
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	2	<b>306.495.556,50</b>
Anleihen und andere Schuldtitel		306.495.556,50
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	2	<b>918.507,42</b>
Credit Default Swaps		19.121,48
Devisentermingeschäfte		899.385,94
<b>Bankguthaben</b>		<b>14.427.763,47</b>
<b>Hinterlegte Sicherheiten</b>		<b>3.184.254,31</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte</b>	4	<b>23.648.079,61</b>
<b>Vermögenswerte Gesamt</b>		<b>348.674.161,31</b>
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>	4, 12	<b>(21.016.604,60)</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	2	<b>(1.350.542,55)</b>
Futures		(1.350.542,55)
<b>Verbindlichkeiten Gesamt</b>		<b>(22.367.147,15)</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Berichtszeitraums</b>		<b>326.307.014,16</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.



## NN (L) Asian Debt (Hard Currency)

(ausgedrückt in USD)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW	Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW
1.200.000	YUZHOU GROUP HOLDINGS CO LTD 8.300% 27/05/2025	USD	157.372,30	0,05					
1.000.000	ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD 6.630% 07/01/2026	USD	110.044,04	0,03					
1.750.000	ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD 7.100% 10/09/2024	USD	194.604,69	0,06					
			<b>33.407.242,18</b>	<b>10,24</b>					
<b>Thailand</b>									
2.500.000	BANGKOK BANK PCL/HONG KONG FRN PERP EMTN	USD	2.442.147,03	0,75					
200.000	BANGKOK BANK PCL/HONG KONG 25/09/2034 FRN EMTN	USD	186.424,01	0,06					
2.450.000	BANGKOK BANK PCL/HONG KONG 9.025% 15/03/2029	USD	3.076.009,57	0,94					
1.150.000	GC TREASURY CENTER CO LTD 4.300% 18/03/2051 EMTN	USD	1.070.495,96	0,33					
250.000	GC TREASURY CENTER CO LTD 4.400% 30/03/2032 EMTN	USD	254.993,11	0,08					
1.250.000	INDORAMA VENTURES GLOBAL SERVICES LTD 4.375% 12/09/2024 EMTN	USD	1.229.354,90	0,38					
1.600.000	KASIKORN BANK PCL/HONG KONG FRN PERP EMTN	USD	1.561.659,97	0,48					
2.300.000	KASIKORN BANK PCL/HONG KONG 02/10/2031 FRN EMTN	USD	2.173.989,83	0,67					
2.900.000	KRUNG THAI BANK PCL/CAYMAN ISLANDS FRN PERP	USD	2.683.112,54	0,82					
850.000	MINOR INTERNATIONAL PCL FRN PERP	USD	844.168,30	0,26					
5.700.000	MINOR INTERNATIONAL PCL FRN PERP	USD	5.350.572,62	1,63					
1.640.000	THAI OIL TREASURY CENTER CO LTD 5.375% 20/11/2048 EMTN	USD	1.618.611,23	0,50					
6.050.000	TMBTHANACHART BANK PCL FRN PERP EMTN	USD	5.775.826,95	1,76					
			<b>28.267.366,02</b>	<b>8,66</b>					
<b>Australien</b>									
2.800.000	AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP LTD/UNITED KINGDOM FRN PERP	USD	3.005.338,62	0,92					
550.000	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA 12/09/2034 FRN EMTN	USD	526.937,56	0,16					
1.540.000	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD 02/08/2034 FRN	USD	1.504.927,10	0,46					
500.000	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD 02/08/2034 FRN EMTN	USD	488.612,70	0,15					
1.200.000	QBE INSURANCE GROUP LTD 02/12/2044 FRN	USD	1.256.065,63	0,38					
5.150.000	QBE INSURANCE GROUP LTD 17/06/2046 FRN EMTN	USD	5.320.341,55	1,64					
3.400.000	SANTOS FINANCE LTD 3.649% 29/04/2031	USD	3.191.069,80	0,98					
600.000	SANTOS FINANCE LTD 5.250% 13/03/2029 EMTN	USD	625.643,10	0,19					
2.000.000	SCENTRE GROUP TRUST 2 24/09/2080 FRN	USD	1.965.572,06	0,60					
3.600.000	WESTPAC BANKING CORP 24/07/2034 FRN	USD	3.552.892,38	1,09					
			<b>21.437.400,50</b>	<b>6,57</b>					
<b>China</b>									
20.000.000	CENTRAL HUIJIN INVESTMENT LTD 2.710% 22/05/2025	CNH	3.116.784,74	0,96					
3.400.000	CHINA DEVELOPMENT BANK FINANCIAL LEASING CO LTD 28/09/2030 FRN	USD	3.287.529,36	1,01					
40.000.000	CHINA DEVELOPMENT BANK 3.180% 05/04/2026	CNY	6.377.568,57	1,95					
5.310.000	CHINA MINMETALS CORP FRN PERP	USD	5.324.540,05	1,63					
2.640.000	SHOUGANG GROUP CO LTD 4.000% 23/05/2024	USD	2.649.161,41	0,81					
			<b>20.755.584,13</b>	<b>6,36</b>					
<b>Indonesien</b>									
1.762.000	ALAM SUTERA REALTY TBK 8.250% 02/11/2025	USD	1.205.957,54	0,37					
1.550.000	BANK NEGARA INDONESIA PERSERO TBK PT 3.750% 30/03/2026 EMTN	USD	1.474.861,18	0,45					
3.950.000	INDONESIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 8.500% 12/10/2035	USD	5.639.704,06	1,73					
1.500.000	JAPFA COMFEED INDONESIA TBK PT 5.375% 23/03/2026	USD	1.468.033,04	0,45					
800.000	PERTAMINA PERSERO PT 6.000% 03/05/2042	USD	890.181,98	0,27					
8.450.000	PERTAMINA PERSERO PT 6.500% 27/05/2041	USD	9.884.757,10	3,03					
			<b>20.563.494,90</b>	<b>6,30</b>					
<b>Südkorea</b>									
4.800.000	HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD FRN PERP	USD	4.851.933,26	1,49					
1.000.000	HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD 04/02/2032 FRN	USD	955.787,73	0,29					
5.000.000	HEUNGKUK LIFE INSURANCE CO LTD FRN PERP	USD	4.975.000,00	1,52					
2.775.000	KYOBO LIFE INSURANCE CO LTD FRN PERP	USD	2.777.520,37	0,85					
3.800.000	TONGYANG LIFE INSURANCE CO FRN PERP	USD	3.815.234,28	1,17					
			<b>17.375.475,64</b>	<b>5,32</b>					
<b>Japan</b>									
2.950.000	ASAHI MUTUAL LIFE INSURANCE CO FRN PERP	USD	2.748.448,65	0,84					
4.700.000	ASAHI MUTUAL LIFE INSURANCE CO FRN PERP	USD	4.830.977,86	1,48					
1.950.000	FUKOKU MUTUAL LIFE INSURANCE CO FRN PERP	USD	1.998.686,06	0,61					
5.000.000	MITSUI SUMITOMO INSURANCE CO LTD FRN PERP	USD	5.299.546,80	1,63					
1.750.000	NIPPON LIFE INSURANCE 21/01/2051 FRN	USD	1.578.020,12	0,48					
			<b>16.455.679,49</b>	<b>5,04</b>					
<b>Indien</b>									
1.600.000	ADANI ELECTRICITY MUMBAI 3.867% 22/07/2031	USD	1.412.987,42	0,43					
1.040.750	ADANI TRANSMISSION LTD 4.250% 21/05/2036	USD	952.095,10	0,29					
931.250	ADANIREN KODSOPAR WARSOM 4.625% 15/10/2039 EMTN	USD	813.848,08	0,25					
800.000	IIFL FINANCE LTD 5.875% 20/04/2023 EMTN	USD	780.567,85	0,24					
2.364.250	JSW HYDRO ENERGY LTD 4.125% 18/05/2031	USD	2.215.973,93	0,69					
1.000.000	JSW STEEL LTD 5.050% 05/04/2032	USD	923.629,19	0,28					
2.200.000	POWER FINANCE CORP LTD 3.750% 06/12/2027 EMTN	USD	2.140.646,64	0,66					
1.400.000	RELIANCE INDUSTRIES LTD 8.250% 15/01/2027	USD	1.676.409,67	0,51					
700.000	RENEW POWER SYNTHETIC 6.670% 12/03/2024	USD	711.156,01	0,22					
700.000	SHRIRAM TRANSPORT FINANCE CO LTD 4.150% 18/07/2025 EMTN	USD	667.008,34	0,20					
			<b>12.294.322,23</b>	<b>3,77</b>					
<b>Singapur</b>									
493.125	CONTINUUM ENERGY LEVANTER PTE LTD 4.500% 09/02/2027	USD	475.765,22	0,15					
2.050.000	DBS GROUP HOLDINGS LTD FRN PERP GMTN	USD	1.990.183,42	0,61					
1.400.000	GLOBAL PRIME CAPITAL PTE LTD 5.950% 23/01/2025	USD	1.352.832,98	0,41					
1.552.691	JGC VENTURES PTE LTD ZCP 03/09/2022	USD	806.856,55	0,25					
1.682	JGC VENTURES PTE LTD ZCP 30/06/2025	USD	886,37	0,00					
1.656.230	LLPL CAPITAL PTE LTD 6.875% 04/02/2039	USD	1.651.269,62	0,51					
1.150.000	LMIRT CAPITAL PTE LTD 7.500% 09/02/2026	USD	1.129.148,80	0,35					
2.069.538	MODERNLAND OVERSEAS PTE LTD 3.000% 30/04/2027	USD	942.362,74	0,28					
			<b>8.349.305,70</b>	<b>2,56</b>					
<b>Bermuda</b>									
1.650.000	CHINA OIL & GAS GROUP LTD 4.700% 30/06/2026	USD	1.570.929,62	0,48					
1.550.000	CHINA OIL & GAS GROUP LTD 5.500% 25/01/2023	USD	1.553.391,35	0,48					
4.410.000	SHENZHEN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD FRN PERP	USD	4.437.841,26	1,36					
			<b>7.562.162,23</b>	<b>2,32</b>					
<b>Philippinen</b>									
400.000	GLOBE TELECOM INC 2.500% 23/07/2030	USD	349.329,66	0,11					
3.950.000	GLOBE TELECOM INC 3.000% 23/07/2035	USD	3.182.647,84	0,98					
2.500.000	SMC GLOBAL POWER HOLDINGS CORP FRN PERP	USD	2.423.556,58	0,74					
			<b>5.955.534,08</b>	<b>1,83</b>					
<b>Niederlande</b>									
5.350.000	MINEJESA CAPITAL BV 5.625% 10/08/2037	USD	4.871.212,50	1,49					
			<b>4.871.212,50</b>	<b>1,49</b>					

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Asian Debt (Hard Currency)

(ausgedrückt in USD)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW
<b>Insel Man</b>				
3.850.000	GOHL CAPITAL LTD 4.250% 24/01/2027	USD	3.625.415,99	1,11
			<b>3.625.415,99</b>	<b>1,11</b>
<b>Mauritius</b>				
392.000	CLEAN RENEWABLE POWER MAURITIUS PTE LTD 4.250% 25/03/2027	USD	376.320,00	0,12
2.200.000	UPL CORP LTD FRN PERP	USD	2.037.220,15	0,63
1.150.000	UPL CORP LTD 4.625% 16/06/2030	USD	1.091.884,76	0,33
			<b>3.505.424,91</b>	<b>1,08</b>
<b>Vereinigte Staaten</b>				
1.900.000	RESORTS WORLD LAS VEGAS LLC / RWLV CAPITAL INC 4.625% 06/04/2031	USD	1.676.169,11	0,51
1.500.000	RESORTS WORLD LAS VEGAS LLC / RWLV CAPITAL INC 4.625% 16/04/2029	USD	1.358.958,80	0,42
			<b>3.035.127,91</b>	<b>0,93</b>
<b>Sri Lanka</b>				
1.000.000	SRI LANKA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.825% 18/07/2026	USD	486.295,79	0,15
1.700.000	SRI LANKA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.550% 28/03/2030	USD	804.796,81	0,25
750.000	SRI LANKA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.850% 14/03/2029	USD	357.263,61	0,11
2.150.000	SRILANKAN AIRLINES LTD 7.000% 25/06/2024	USD	1.001.980,99	0,30
			<b>2.650.337,20</b>	<b>0,81</b>
<b>Kanada</b>				
1.100.000	PTTEP CANADA INTERNATIONAL FINANCE LTD 6.350% 12/06/2042	USD	1.381.654,71	0,42
			<b>1.381.654,71</b>	<b>0,42</b>
<b>Malaysia</b>				
1.350.000	MISC CAPITAL TWO LABUAN LTD 3.625% 06/04/2025 EMTN	USD	1.350.305,10	0,41
			<b>1.350.305,10</b>	<b>0,41</b>
<b>Vereinigtes Königreich</b>				
1.000.000	STATE GRID EUROPE DEVELOPMENT 3.250% 07/04/2027	USD	996.381,49	0,32
			<b>996.381,49</b>	<b>0,32</b>
			<b>306.495.516,50</b>	<b>93,93</b>
<b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>				
<b>Anleihen und andere Schuldtitel</b>				
<b>Bermuda</b>				
400.000	3D-GOLD JEWELLERY HOLDINGS LTD 9.250% 17/10/2014 - DEFAULTED	USD	40,00	0,00
			<b>40,00</b>	<b>0,00</b>
			<b>40,00</b>	<b>0,00</b>
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>			<b>306.495.556,50</b>	<b>93,93</b>

### Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022

Bezeichnung	Verkauf / Kauf	Zinssatz (%)	Fälligkeits- datum	Währung	Nennwert	Swap-Wert in USD
<b>Credit Default Swap</b>						
CDX ITRAXX ASIA EX-JAPAN INVESTMENT GRADE SERIES 36 VERSION 1	Verkauf	1,000	20/12/2026	USD	4.000.000,00	19.121,48
						<b>19.121,48</b>
Zu erhalten		Zu zahlen	Fälligkeits- datum	Engagement in USD		Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in USD
<b>Devisentermingeschäfte</b>						
193.535.026,69	ZAR	12.545.870,61	USD	19/04/2022	12.545.870,61	673.428,94
22.014.053,59	AUD	15.992.534,89	USD	19/04/2022	15.992.534,89	541.781,66
9.233.360,62	SGD	6.797.157,20	USD	19/04/2022	6.797.157,20	24.924,87
36.742,54	USD	533.960,89	ZAR	01/04/2022	36.742,54	201,16
23.023,29	AUD	17.275,53	USD	01/04/2022	17.275,53	13,80
61.606,49	AUD	46.361,96	USD	04/04/2022	46.361,96	(98,58)
353.499,19	ZAR	24.324,73	USD	01/04/2022	24.324,73	(133,17)
211.678,35	ZAR	14.646,49	USD	04/04/2022	14.646,49	(160,38)
47.909,48	USD	44.392,62	CHF	19/04/2022	47.909,48	(354,17)
231.876,52	USD	314.378,19	SGD	01/04/2022	231.876,52	(419,77)
600.632,86	CHF	654.530,14	USD	19/04/2022	654.530,14	(1.522,12)
827.298,74	USD	745.146,35	EUR	01/04/2022	827.298,74	(1.788,55)
673.418,11	USD	916.993,92	SGD	19/04/2022	673.418,11	(4.104,20)
4.879.850,32	USD	4.408.725,55	EUR	19/04/2022	4.879.850,32	(27.648,92)
1.206.443,17	USD	1.652.373,88	AUD	19/04/2022	1.206.443,17	(34.621,89)
6.885.766,93	USD	6.215.000,00	EUR	30/06/2022	6.885.766,93	(53.955,19)
1.881.468,44	USD	28.514.347,25	ZAR	19/04/2022	1.881.468,44	(66.187,79)
50.945.848,28	EUR	56.859.490,15	USD	19/04/2022	56.859.490,15	(149.969,76)
					<b>109.622.965,95</b>	<b>899.385,94</b>
Stückzahl	Bezeichnung	Währung	Engagement in USD			Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in USD
<b>Zins-Futures</b>						
6	US LONG BOND (CBT) 21/06/2022	USD	900.375,00			(25.406,25)
76	US ULTRA BOND (CBT) 21/06/2022	USD	13.461.500,00			(496.375,00)
130	US 10YR NOTE (CBT) 21/06/2022	USD	15.973.750,00			(518.931,25)
(20)	US 10YR ULTRA FUTURE 21/06/2022	USD	2.709.375,00			81.696,69
94	US 2YR NOTE (CBT) 30/06/2022	USD	19.920.656,34			(237.937,41)
56	US 5YR NOTE (CBT) 30/06/2022	USD	6.422.500,00			(153.589,33)
			<b>59.388.156,34</b>			<b>(1.350.542,55)</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Asian Debt (Hard Currency)

(ausgedrückt in USD)

### Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Derivative Finanzinstrumente Gesamt	(432.035,13)
-------------------------------------	--------------

### Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick

		% NIW
Wertpapierbestand Gesamt	306.495.556,50	93,93
Derivative Finanzinstrumente Gesamt	(432.035,13)	(0,13)
Bankguthaben	14.427.763,47	4,42
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	5.815.729,32	1,78
Nettovermögen Gesamt	326.307.014,16	100,00

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.



## NN (L) Asian High Yield

(ausgedrückt in USD)

### Statistische Angaben

<b>Nettovermögen</b>	31.03.2022	USD	163.252.057,37	<b>Anzahl der Anteile</b>			
	30.09.2021	USD	249.371.883,08				
	30.09.2020	USD	235.556.943,34		Capitalisation I Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	4.172
<b>Nettoinventarwert pro Anteil**</b>					30.09.2021	4.476	
					30.09.2020	4.592	
				Capitalisation P (USD)	31.03.2022	112.034	
Capitalisation I (USD)	31.03.2022	USD	5.304,15		30.09.2021	95.252	
	30.09.2021	USD	6.611,71		30.09.2020	47.724	
	30.09.2020	USD	6.759,30	Capitalisation P Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	74	
Capitalisation I Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	EUR	4.212,59		30.09.2021	905	
	30.09.2021	EUR	5.281,96		30.09.2020	1.923	
	30.09.2020	EUR	5.452,60	Capitalisation U (USD)	31.03.2022	13	
Capitalisation P (USD)	31.03.2022	USD	214,95		30.09.2021	41	
	30.09.2021	USD	268,50		30.09.2020	868	
	30.09.2020	USD	275,65	Distribution I (M) (USD)	31.03.2022	794	
Capitalisation P Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	EUR	225,74		30.09.2021	1.755	
	30.09.2021	EUR	283,51		30.09.2020	1.874	
	30.09.2020	EUR	293,79	Distribution P (M) (USD)	31.03.2022	96.138	
Capitalisation U (USD)	31.03.2022	USD	3.926,45		30.09.2021	96.148	
	30.09.2021	USD	4.886,10		30.09.2020	152.686	
	30.09.2020	USD	4.978,54	Distribution P (M) Hedged (i) (AUD)	31.03.2022	27.176	
Distribution I (M) (USD)	31.03.2022	USD	3.300,13		30.09.2021	27.135	
	30.09.2021	USD	4.304,09		30.09.2020	47.073	
	30.09.2020	USD	4.725,70	Distribution P (M) Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	28.826	
Distribution P (M) (USD)	31.03.2022	USD	160,52		30.09.2021	17.764	
	30.09.2021	USD	209,26		30.09.2020	22.317	
	30.09.2020	USD	229,75	Distribution P (M) Hedged (i) (SGD)	31.03.2022	58.115	
Distribution P (M) Hedged (i) (AUD)	31.03.2022	AUD	222,19		30.09.2021	62.704	
	30.09.2021	AUD	290,19		30.09.2020	77.206	
	30.09.2020	AUD	319,79	Distribution U (M) (USD)	31.03.2022	686	
Distribution P (M) Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	EUR	159,38		30.09.2021	712	
	30.09.2021	EUR	208,83		30.09.2020	1.210	
	30.09.2020	EUR	232,09	<b>Dividende</b>			
Distribution P (M) Hedged (i) (SGD)	31.03.2022	SGD	223,98	Distribution I (M) (USD)	02.03.2022	USD	28,08
	30.09.2021	SGD	291,60	Distribution I (M) (USD)	02.02.2022	USD	28,08
	30.09.2020	SGD	320,04	Distribution I (M) (USD)	04.01.2022	USD	28,08
Distribution U (M) (USD)	31.03.2022	USD	3.311,34	Distribution I (M) (USD)	02.12.2021	USD	29,17
	30.09.2021	USD	4.320,64	Distribution I (M) (USD)	02.11.2021	USD	29,17
	30.09.2020	USD	4.743,96	Distribution I (M) (USD)	04.10.2021	USD	29,17
<b>Anzahl der Anteile</b>							
Capitalisation I (USD)	31.03.2022		15.075				
	30.09.2021		21.431				
	30.09.2020		15.300				

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

## NN (L) Asian High Yield

(ausgedrückt in USD)

### Statistische Angaben (Fortsetzung)

Distribution P (M) (USD)	02.03.2022	USD	1,29	Distribution U (M) (USD)	02.11.2021	USD	30,60
Distribution P (M) (USD)	02.02.2022	USD	1,29	Distribution U (M) (USD)	04.10.2021	USD	30,60
Distribution P (M) (USD)	04.01.2022	USD	1,29				
Distribution P (M) (USD)	02.12.2021	USD	1,34	<b>Laufende Kosten in %*</b>			
Distribution P (M) (USD)	02.11.2021	USD	1,34	Capitalisation I (USD)	31.03.2022		0,88%
Distribution P (M) (USD)	04.10.2021	USD	1,34	Capitalisation I Hedged (i) (EUR)	31.03.2022		0,90%
Distribution P (M) Hedged (i) (AUD)	02.03.2022	AUD	1,78	Capitalisation P (USD)	31.03.2022		1,30%
Distribution P (M) Hedged (i) (AUD)	02.02.2022	AUD	1,78	Capitalisation P Hedged (i) (EUR)	31.03.2022		1,32%
Distribution P (M) Hedged (i) (AUD)	04.01.2022	AUD	1,78	Capitalisation U (USD)	31.03.2022		0,55%
Distribution P (M) Hedged (i) (AUD)	02.12.2021	AUD	1,85	Distribution I (M) (USD)	31.03.2022		0,88%
Distribution P (M) Hedged (i) (AUD)	02.11.2021	AUD	1,85	Distribution P (M) (USD)	31.03.2022		1,30%
Distribution P (M) Hedged (i) (AUD)	04.10.2021	AUD	1,85	Distribution P (M) Hedged (i) (AUD)	31.03.2022		1,32%
Distribution P (M) Hedged (i) (EUR)	02.03.2022	EUR	1,28	Distribution P (M) Hedged (i) (EUR)	31.03.2022		1,32%
Distribution P (M) Hedged (i) (EUR)	02.02.2022	EUR	1,28	Distribution P (M) Hedged (i) (SGD)	31.03.2022		1,32%
Distribution P (M) Hedged (i) (EUR)	04.01.2022	EUR	1,28	Distribution U (M) (USD)	31.03.2022		0,55%
Distribution P (M) Hedged (i) (EUR)	02.12.2021	EUR	1,34	<b>Portfolioumsatz in %*</b>	31.03.2022		(2,41%)
Distribution P (M) Hedged (i) (EUR)	02.11.2021	EUR	1,34				
Distribution P (M) Hedged (i) (EUR)	04.10.2021	EUR	1,34				
Distribution P (M) Hedged (i) (SGD)	02.03.2022	SGD	1,79				
Distribution P (M) Hedged (i) (SGD)	02.02.2022	SGD	1,79				
Distribution P (M) Hedged (i) (SGD)	04.01.2022	SGD	1,79				
Distribution P (M) Hedged (i) (SGD)	02.12.2021	SGD	1,86				
Distribution P (M) Hedged (i) (SGD)	02.11.2021	SGD	1,86				
Distribution P (M) Hedged (i) (SGD)	04.10.2021	SGD	1,86				
Distribution U (M) (USD)	02.03.2022	USD	29,49				
Distribution U (M) (USD)	02.02.2022	USD	29,49				
Distribution U (M) (USD)	04.01.2022	USD	29,49				
Distribution U (M) (USD)	02.12.2021	USD	30,60				

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

## NN (L) Asian High Yield

(ausgedrückt in USD)

### Finanzabschlüsse

#### Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022

	Erläuterungen	
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	2	<b>151.682.609,89</b>
Anleihen und andere Schuldtitel		151.682.609,89
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	2	<b>59.959,92</b>
Devisentermingeschäfte		59.959,92
<b>Bankguthaben</b>		<b>9.764.226,15</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte</b>	4	<b>7.813.999,49</b>
<b>Vermögenswerte Gesamt</b>		<b>169.320.795,45</b>
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>	4	<b>(6.068.738,08)</b>
<b>Verbindlichkeiten Gesamt</b>		<b>(6.068.738,08)</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Berichtszeitraums</b>		<b>163.252.057,37</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Asian High Yield

(ausgedrückt in USD)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW	Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW
<b>Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>									
<b>Anleihen und andere Schuldtitel</b>									
<b>Kaimaninseln</b>									
400.000	AGILE GROUP HOLDINGS LTD FRN PERP	USD	78.751,19	0,05	750.000	TIMES CHINA HOLDINGS LTD 5.550% 04/06/2024	USD	337.071,42	0,21
550.000	AGILE GROUP HOLDINGS LTD FRN PERP	USD	110.229,44	0,07	1.250.000	TIMES CHINA HOLDINGS LTD 6.200% 22/03/2026	USD	487.599,98	0,30
4.200.000	AGILE GROUP HOLDINGS LTD FRN PERP	USD	841.071,13	0,51	1.600.000	TIMES CHINA HOLDINGS LTD 6.750% 16/07/2023	USD	802.077,54	0,49
2.150.000	CENTRAL CHINA REAL ESTATE LTD 7.250% 13/08/2024	USD	924.500,00	0,57	4.150.000	WYNN MACAU LTD 5.500% 15/01/2026	USD	3.742.470,04	2,28
2.450.000	CENTRAL CHINA REAL ESTATE LTD 7.750% 24/05/2024	USD	1.096.806,67	0,67	1.800.000	YUZHOU GROUP HOLDINGS CO LTD FRN PERP	USD	127.506,28	0,08
250.000	CHINA AOYUAN GROUP LTD ZCP 21/06/2024	USD	41.870,30	0,03	1.200.000	YUZHOU GROUP HOLDINGS CO LTD 7.375% 13/01/2026	USD	156.548,70	0,10
1.500.000	CHINA AOYUAN GROUP LTD 5.880% 01/03/2027	USD	239.304,80	0,15	3.150.000	YUZHOU GROUP HOLDINGS CO LTD 8.300% 27/05/2025	USD	413.102,28	0,25
1.000.000	CHINA AOYUAN GROUP LTD 5.980% 18/08/2025	USD	172.823,51	0,11	3.300.000	ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD 6.630% 07/01/2026	USD	363.145,33	0,21
1.000.000	CHINA AOYUAN GROUP LTD 6.200% 24/03/2026	USD	172.278,49	0,11	1.000.000	ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD 7.100% 10/09/2024	USD	111.202,68	0,07
1.700.000	CHINA EVERGRANDE GROUP 10.000% 11/04/2023	USD	211.188,60	0,13	<b>35.429.889,26 21,70</b>				
750.000	CHINA EVERGRANDE GROUP 11.500% 22/01/2023	USD	94.299,43	0,06	<b>Jungferninseln</b>				
1.800.000	CHINA EVERGRANDE GROUP 9.500% 29/03/2024	USD	225.769,61	0,14	2.400.000	CAS CAPITAL NO 1 LTD FRN PERP	USD	2.261.552,66	1,39
500.000	CHINA HONGQIAO GROUP LTD 6.250% 08/06/2024	USD	480.530,20	0,29	400.000	EASY TACTIC LTD 8.125% 27/02/2023	USD	83.668,60	0,05
700.000	CHINA HONGQIAO GROUP LTD 7.125% 22/07/2022	USD	697.261,75	0,43	6.000.000	EASY TACTIC LTD 8.625% 27/02/2024	USD	1.210.507,02	0,74
2.200.000	CHINA HONGQIAO GROUP LTD 7.375% 02/05/2023	USD	2.168.986,84	1,33	1.850.000	FORTUNE STAR BVI LTD 3.950% 02/10/2026	EUR	1.769.826,95	1,08
1.000.000	CHINA SCE GROUP HOLDINGS LTD 6.000% 04/02/2026	USD	510.243,40	0,31	2.400.000	FORTUNE STAR BVI LTD 5.000% 18/05/2026	USD	2.025.478,78	1,24
400.000	CHINA SCE GROUP HOLDINGS LTD 7.000% 02/05/2025	USD	209.946,86	0,13	1.050.000	FORTUNE STAR BVI LTD 5.950% 19/10/2025	USD	962.004,83	0,59
1.400.000	CHINA SCE GROUP HOLDINGS LTD 7.375% 09/04/2024	USD	798.020,65	0,49	400.000	FORTUNE STAR BVI LTD 6.750% 02/07/2023	USD	390.326,79	0,24
1.500.000	CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD FRN PERP	USD	1.275.154,59	0,78	2.250.000	HONG SENG LTD 9.875% 27/08/2022	USD	623.677,97	0,38
800.000	CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD 6.000% 16/07/2025	USD	671.975,82	0,41	1.000.000	NEW METRO GLOBAL LTD 4.500% 02/05/2026	USD	638.193,33	0,39
1.400.000	CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD 6.550% 28/03/2024	USD	1.262.419,05	0,77	2.150.000	NEW METRO GLOBAL LTD 4.625% 15/10/2025	USD	1.384.233,81	0,85
200.000	COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD 4.200% 06/02/2026	USD	153.879,22	0,09	1.150.000	NWD FINANCE (BVI) LTD FRN PERP	USD	1.040.750,00	0,64
500.000	COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD 5.625% 14/01/2030	USD	353.826,36	0,22	500.000	RKPF OVERSEAS 2019 A LTD 6.000% 04/09/2025	USD	397.775,51	0,24
1.300.000	EHI CAR SERVICE 7.750% 14/11/2024	USD	1.049.196,93	0,64	2.370.000	RKPF OVERSEAS 2020 A LTD 5.200% 12/01/2026	USD	1.823.446,62	1,12
2.250.000	FANTASIA HOLDINGS GROUP CO LTD 10.875% 09/01/2023	USD	320.233,88	0,20	750.000	SCENERY JOURNEY LTD 12.000% 24/10/2023	USD	69.005,64	0,04
1.800.000	FANTASIA HOLDINGS GROUP CO LTD 9.250% 28/07/2023	USD	267.654,80	0,16	500.000	SCENERY JOURNEY LTD 13.750% 06/11/2023	USD	47.619,18	0,03
600.000	FANTASIA HOLDINGS GROUP 10.875% 02/03/2024	USD	85.525,74	0,05	3.061.255	STAR ENERGY GEOTHERMAL WAYANG WINDU LTD 6.750% 24/04/2033	USD	3.229.434,90	1,98
2.400.000	FANTASIA HOLDINGS GROUP 9.875% 19/10/2023	USD	346.149,84	0,21	250.000	STUDIO CITY CO LTD 7.000% 15/02/2027	USD	237.602,48	0,15
2.899.000	HILONG HOLDING LTD 9.750% 18/11/2024	USD	1.794.745,45	1,10	2.000.000	STUDIO CITY FINANCE LTD 5.000% 15/01/2029	USD	1.524.490,82	0,93
2.550.000	KAISA GROUP HOLDINGS LTD 11.250% 16/04/2025	USD	485.135,74	0,30	3.600.000	STUDIO CITY FINANCE LTD 6.500% 15/01/2028	USD	3.092.453,39	1,89
400.000	KAISA GROUP HOLDINGS LTD 11.650% 01/06/2026	USD	75.821,60	0,05	2.000.000	IIMDB GLOBAL INVESTMENTS LTD 4.400% 09/03/2023	USD	1.954.396,32	1,20
900.000	KWG GROUP HOLDINGS LTD 6.000% 14/08/2026	USD	351.000,00	0,22	<b>24.766.445,60 15,17</b>				
1.000.000	KWG GROUP HOLDINGS LTD 7.400% 05/03/2024 EMTN	USD	413.332,04	0,25	<b>Indien</b>				
450.000	KWG GROUP HOLDINGS LTD 7.875% 01/09/2023	USD	228.031,87	0,14	600.000	ADANI ELECTRICITY MUMBAI 3.867% 22/07/2031	USD	529.870,28	0,32
4.300.000	MELCO RESORTS FINANCE LTD 5.250% 26/04/2026	USD	3.913.604,80	2,39	1.050.000	ADANI GREEN ENERGY LTD 4.375% 08/09/2024	USD	1.027.576,14	0,63
2.550.000	MGM CHINA HOLDINGS LTD 4.750% 01/02/2027	USD	2.225.565,62	1,36	1.100.000	ADANI GREEN ENERGY UP LTD / PRAYATNA DEVELOPERS PVT LTD / PARAMPUJYA SOLAR ENERGY 6.250% 10/12/2024	USD	1.129.765,26	0,69
2.000.000	MGM CHINA HOLDINGS LTD 5.250% 18/06/2025	USD	1.838.302,18	1,13	1.396.875	ADANIREN KODSOPAR WARSONA 4.625% 15/10/2039 EMTN	USD	1.220.772,11	0,75
1.000.000	MGM CHINA HOLDINGS LTD 5.875% 15/05/2026	USD	910.620,68	0,56	1.000.000	DELHI INTERNATIONAL AIRPORT LTD 6.450% 04/06/2029	USD	909.725,47	0,56
700.000	REDSUN PROPERTIES GROUP LTD 7.300% 13/01/2025	USD	106.289,53	0,07	500.000	HDFC BANK LTD FRN PERP	USD	464.154,45	0,28
2.100.000	REDSUN PROPERTIES GROUP LTD 9.500% 20/09/2023	USD	320.396,73	0,20	1.300.000	HPCL-MITTAL ENERGY LTD 5.450% 22/10/2026	USD	1.271.243,94	0,78
2.300.000	RONSHINE CHINA HOLDINGS LTD 7.100% 25/01/2025	USD	342.491,80	0,21	1.200.000	IIFL FINANCE LTD 5.875% 20/04/2023 EMTN	USD	1.170.851,77	0,72
1.600.000	RONSHINE CHINA HOLDINGS LTD 7.350% 15/12/2023	USD	285.463,15	0,17	3.908.250	JSW HYDRO ENERGY LTD 4.125% 18/05/2031	USD	3.663.140,57	2,25
750.000	SANDS CHINA LTD 5.400% 08/08/2028	USD	738.464,72	0,45	3.100.000	JSW STEEL LTD 5.050% 05/04/2032	USD	2.863.250,49	1,75
					2.450.000	JSW STEEL LTD 5.950% 18/04/2024	USD	2.509.206,36	1,54
					1.000.000	MUTHOOT FINANCE LTD 4.400% 02/09/2023 EMTN	USD	1.000.305,19	0,61
					2.500.000	RENEW POWER PVT LTD 5.875% 05/03/2027	USD	2.465.625,00	1,51
					300.000	RENEW POWER SYNTHETIC 6.670% 12/03/2024	USD	304.781,15	0,19
					3.600.000	SHRIRAM TRANSPORT FINANCE CO LTD 4.150% 18/07/2025 EMTN	USD	3.430.328,62	2,10
					<b>23.960.596,80 14,68</b>				
					<b>Mauritius</b>				
					2.000.000	CA MAGNUM HOLDINGS 5.375% 31/10/2026	USD	1.960.699,82	1,20
					2.352.000	CLEAN RENEWABLE POWER MAURITIUS PTE LTD 4.250% 25/03/2027	USD	2.257.920,00	1,38

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Asian High Yield

(ausgedrückt in USD)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW
4.950.000	GREENKO INVESTMENT CO 4.875% 16/08/2023	USD	4.950.661,62	3,03
300.000	GREENKO SOLAR MAURITIUS LTD 5.950% 29/07/2026	USD	304.048,11	0,19
4.162.000	NETWORK I2I LTD FRN PERP	USD	4.143.301,84	2,54
2.750.000	UPL CORP LTD FRN PERP	USD	2.546.525,19	1,56
			<b>16.163.156,58</b>	<b>9,90</b>
<b>Singapur</b>				
1.380.750	CONTINUUM ENERGY LEVANTER PTE LTD 4.500% 09/02/2027	USD	1.332.142,63	0,82
1.500.000	GLOBAL PRIME CAPITAL PTE LTD 5.950% 23/01/2025	USD	1.449.463,91	0,89
477.751	JGC VENTURES PTE LTD ZCP 03/09/2022	USD	248.263,51	0,15
517	JGC VENTURES PTE LTD ZCP 30/06/2025	USD	272,45	0,00
697.360	LLPL CAPITAL PTE LTD 6.875% 04/02/2039	USD	695.271,42	0,43
1.580.000	LMIRT CAPITAL PTE LTD 7.250% 19/06/2024	USD	1.573.580,90	0,96
550.000	LMIRT CAPITAL PTE LTD 7.500% 09/02/2026	USD	540.027,69	0,33
1.700.000	MEDCO OAK TREE PTE LTD 7.375% 15/05/2026	USD	1.718.182,35	1,05
3.400.000	MEDCO PLATINUM ROAD PTE LTD 6.750% 30/01/2025	USD	3.409.336,57	2,08
2.349.205	MODERNLAND OVERSEAS PTE LTD 3.000% 30/04/2027	USD	1.069.708,92	0,66
			<b>12.036.250,35</b>	<b>7,37</b>
<b>Thailand</b>				
2.300.000	BANGKOK BANK PCL/HONG KONG FRN PERP EMTN	USD	2.246.775,26	1,38
4.050.000	KASIKORN BANK PCL/HONG KONG FRN PERP EMTN	USD	3.952.951,79	2,42
1.800.000	KRUNG THAI BANK PCL/CAYMAN ISLANDS FRN PERP	USD	1.665.380,20	1,02
4.000.000	TMBTHANACHART BANK PCL FRN PERP EMTN	USD	3.818.728,56	2,34
			<b>11.683.835,81</b>	<b>7,16</b>
<b>Bermuda</b>				
1.650.000	CHINA OIL & GAS GROUP LTD 4.700% 30/06/2026	USD	1.570.929,62	0,96
4.250.000	CHINA OIL & GAS GROUP LTD 5.500% 25/01/2023	USD	4.259.298,87	2,61
			<b>5.830.228,49</b>	<b>3,57</b>
<b>Hongkong</b>				
2.000.000	CHONG HING BANK LTD FRN PERP EMTN	USD	1.964.669,16	1,20
3.200.000	FAR EAST HORIZON LTD FRN PERP EMTN	USD	3.148.178,69	1,93
			<b>5.112.847,85</b>	<b>3,13</b>
<b>Philippinen</b>				
1.050.000	PETRON CORP FRN PERP	USD	1.010.404,35	0,62
1.700.000	SAN MIGUEL CORP FRN PERP EMTN	USD	1.660.140,64	1,01
400.000	SMC GLOBAL POWER HOLDINGS CORP FRN PERP	USD	387.769,05	0,24
500.000	SMC GLOBAL POWER HOLDINGS CORP FRN PERP	USD	485.311,45	0,30
			<b>3.543.625,49</b>	<b>2,17</b>
<b>Australien</b>				
2.700.000	SCENTRE GROUP TRUST 2 24/09/2080 FRN	USD	2.653.522,28	1,63
			<b>2.653.522,28</b>	<b>1,63</b>
<b>Indonesien</b>				
662.000	ALAM SUTERA REALTY TBK 8.000% 02/05/2024	USD	510.839,71	0,31
1.987.000	ALAM SUTERA REALTY TBK 8.250% 02/11/2025	USD	1.359.953,25	0,84
550.000	JAPFA COMFEED INDONESIA TBK PT 5.375% 23/03/2026	USD	538.278,78	0,33
			<b>2.409.071,74</b>	<b>1,48</b>
<b>Japan</b>				
1.050.000	ASAHI MUTUAL LIFE INSURANCE CO FRN PERP	USD	978.261,39	0,60

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW
1.000.000	SOFTBANK GROUP CORP 4.000% 06/07/2026	USD	918.731,36	0,56
			<b>1.896.992,75</b>	<b>1,16</b>
<b>Vereinigtes Königreich</b>				
1.500.000	VEDANTA RESOURCES FINANCE II PLC 13.875% 21/01/2024	USD	1.568.861,93	0,95
			<b>1.568.861,93</b>	<b>0,95</b>
<b>Südkorea</b>				
560.000	HEUNGKUK LIFE INSURANCE CO LTD FRN PERP	USD	557.200,00	0,34
800.000	TONGYANG LIFE INSURANCE CO FRN PERP	USD	803.207,22	0,49
			<b>1.360.407,22</b>	<b>0,83</b>
<b>Vereinigte Staaten</b>				
900.000	RESORTS WORLD LAS VEGAS LLC / RWLV CAPITAL INC 4.625% 06/04/2031	USD	793.974,84	0,49
600.000	RESORTS WORLD LAS VEGAS LLC / RWLV CAPITAL INC 4.625% 16/04/2029	USD	543.583,52	0,33
			<b>1.337.558,36</b>	<b>0,82</b>
<b>Niederlande</b>				
1.300.000	MINEJESA CAPITAL BV 5.625% 10/08/2037	USD	1.183.659,11	0,73
			<b>1.183.659,11</b>	<b>0,73</b>
<b>Sri Lanka</b>				
1.600.000	SRILANKAN AIRLINES LTD 7.000% 25/06/2024	USD	745.660,27	0,46
			<b>745.660,27</b>	<b>0,46</b>
			<b>151.682.609,89</b>	<b>92,91</b>

**Wertpapierbestand Gesamt 151.682.609,89 92,91**

### Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022

Zu erhalten	Zu zahlen	Fälligkeits- datum	Engagement in USD	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in USD		
<b>Devisentermingeschäfte</b>						
6.855.811,67	AUD	4.989.074,73	USD	19/04/2022	4.989.074,73	160.188,66
15.300.740,97	SGD	11.271.978,43	USD	19/04/2022	11.271.978,43	32.996,53
110.528,55	USD	99.000,00	EUR	04/04/2022	110.528,55	376,17
153.880,65	USD	138.600,00	EUR	01/04/2022	153.880,65	(332,68)
1.763.604,74	USD	2.396.634,79	SGD	19/04/2022	1.763.604,74	(7.152,40)
1.814.784,59	USD	1.638.000,00	EUR	30/06/2022	1.814.784,59	(14.220,21)
635.918,19	USD	871.184,83	AUD	19/04/2022	635.918,19	(18.411,36)
4.094.707,38	USD	3.708.693,58	EUR	19/04/2022	4.094.707,38	(33.562,95)
25.691.006,74	EUR	28.657.437,04	USD	19/04/2022	28.657.437,04	(59.921,84)
					<b>53.491.914,30</b>	<b>59.959,92</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt 59.959,92</b>						

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Asian High Yield

(ausgedrückt in USD)

### Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick

		% NIW
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	151.682.609,89	92,91
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	59.959,92	0,04
<b>Bankguthaben</b>	9.764.226,15	5,98
<b>Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>	1.745.261,41	1,07
<b>Nettovermögen Gesamt</b>	163.252.057,37	100,00

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Banking & Insurance

(ausgedrückt in USD)

### Statistische Angaben

				Anzahl der Anteile					
<b>Nettovermögen</b>	31.03.2022	USD	56.391.895,23	Capitalisation I (EUR)	31.03.2022		-		
	30.09.2021	USD	53.153.855,59		30.09.2021		67		
	30.09.2020	USD	38.135.412,45		30.09.2020		63		
<b>Nettoinventarwert pro Anteil**</b>				Capitalisation I (USD)	31.03.2022		50		
					30.09.2021		91		
					30.09.2020		99		
Capitalisation I (EUR)	31.03.2022	EUR	-	Capitalisation P (EUR)	31.03.2022		2.673		
	30.09.2021	EUR	10.830,93			30.09.2021		777	
	30.09.2020	EUR	7.306,17			30.09.2020		149	
Capitalisation I (USD)	31.03.2022	USD	1.105,89	Capitalisation P (USD)	31.03.2022		13.420		
	30.09.2021	USD	1.089,63			30.09.2021		14.486	
	30.09.2020	USD	743,66			30.09.2020		15.343	
Capitalisation P (EUR)	31.03.2022	EUR	361,96	Capitalisation P Hedged (ii) (EUR)	31.03.2022		43.936		
	30.09.2021	EUR	344,12			30.09.2021		46.522	
	30.09.2020	EUR	234,44			30.09.2020		58.255	
Capitalisation P (USD)	31.03.2022	USD	938,04	Capitalisation R (USD)	31.03.2022		929		
	30.09.2021	USD	928,85			30.09.2021		929	
	30.09.2020	USD	640,28			30.09.2020		1.358	
Capitalisation P Hedged (ii) (EUR)	31.03.2022	EUR	282,69	Capitalisation R Hedged (ii) (EUR)	31.03.2022		2.693		
	30.09.2021	EUR	279,99			30.09.2021		2.943	
	30.09.2020	EUR	195,72			30.09.2020		3.860	
Capitalisation R (USD)	31.03.2022	USD	285,11	Capitalisation X (EUR)	31.03.2022		4.283		
	30.09.2021	USD	281,26			30.09.2021		2.784	
	30.09.2020	USD	192,43			30.09.2020		1.732	
Capitalisation R Hedged (ii) (EUR)	31.03.2022	EUR	275,90	Capitalisation X (USD)	31.03.2022		16.394		
	30.09.2021	EUR	272,14			30.09.2021		11.647	
	30.09.2020	EUR	188,68			30.09.2020		8.229	
Capitalisation X (EUR)	31.03.2022	EUR	1.439,30	Distribution P (USD)	31.03.2022		1.149		
	30.09.2021	EUR	1.371,69			30.09.2021		1.313	
	30.09.2020	EUR	939,19			30.09.2020		1.420	
Capitalisation X (USD)	31.03.2022	USD	845,51	Distribution P Hedged (ii) (EUR)	31.03.2022		2.606		
	30.09.2021	USD	839,28			30.09.2021		2.837	
	30.09.2020	USD	581,37			30.09.2020		3.364	
Distribution P (USD)	31.03.2022	USD	3.538,17	Distribution R (USD)	31.03.2022		238		
	30.09.2021	USD	3.518,12			30.09.2021		238	
	30.09.2020	USD	2.445,16			30.09.2020		1.231	
Distribution P Hedged (ii) (EUR)	31.03.2022	EUR	1.003,75	<b>Dividende</b>	Distribution P (USD)	14.12.2021	USD	14,95	
	30.09.2021	EUR	998,52			Distribution P Hedged (ii) (EUR)	14.12.2021	EUR	4,15
	30.09.2020	EUR	703,75				Distribution R (USD)	14.12.2021	USD
Distribution R (USD)	31.03.2022	USD	267,63						
	30.09.2021	USD	266,90						
	30.09.2020	USD	185,39						

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

## NN (L) Banking & Insurance

(ausgedrückt in USD)

### Statistische Angaben (Fortsetzung)

#### Laufende Kosten in %\*

Capitalisation I (USD)	31.03.2022	0,81%
Capitalisation P (EUR)	31.03.2022	1,80%
Capitalisation P (USD)	31.03.2022	1,80%
Capitalisation P Hedged (ii) (EUR)	31.03.2022	1,82%
Capitalisation R (USD)	31.03.2022	1,05%
Capitalisation R Hedged (ii) (EUR)	31.03.2022	1,07%
Capitalisation X (EUR)	31.03.2022	2,30%
Capitalisation X (USD)	31.03.2022	2,30%
Distribution P (USD)	31.03.2022	1,80%
Distribution P Hedged (ii) (EUR)	31.03.2022	1,82%
Distribution R (USD)	31.03.2022	1,04%
<b>Portfolioumsatz in %*</b>	31.03.2022	<b>39,35%</b>

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwasige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.



## NN (L) Banking & Insurance

(ausgedrückt in USD)

### Finanzabschlüsse

#### Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022

	Erläuterungen	
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	2	<b>55.633.909,64</b>
Aktien		55.633.909,64
<b>Bankguthaben</b>		<b>747.154,82</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte</b>	4, 12	<b>660.108,74</b>
<b>Vermögenswerte Gesamt</b>		<b>57.041.173,20</b>
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>	4	<b>(578.337,39)</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	2	<b>(70.940,58)</b>
Devisentermingeschäfte		(70.940,58)
<b>Verbindlichkeiten Gesamt</b>		<b>(649.277,97)</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Berichtszeitraums</b>		<b>56.391.895,23</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Banking & Insurance

(ausgedrückt in USD)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW	Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW
<b>Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>									
<b>Aktien</b>									
<b>Vereinigte Staaten</b>									
13.500	ALLY FINANCIAL INC	USD	586.980,00	1,04					
1.300	AMERICAN INTERNATIONAL GROUP INC	USD	81.601,00	0,14					
165	AMERICAN NATIONAL GROUP INC	USD	31.199,85	0,06					
1.377	AMERIPRISE FINANCIAL INC	USD	413.595,72	0,73					
700	AMERIS BANCORP	USD	30.716,00	0,05					
82.900	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	USD	583.616,00	1,04					
800	ARTISAN PARTNERS ASSET MANAGEMENT INC - A	USD	31.480,00	0,06					
62.044	BANK OF AMERICA CORP	USD	2.557.453,68	4,55					
6.127	BERKSHIRE HATHAWAY INC - B	USD	2.162.279,57	3,83					
5.011	BLACKSTONE INC	USD	636.096,34	1,13					
1.200	BLACKSTONE MORTGAGE TRUST INC - A	USD	38.148,00	0,07					
300	BOK FINANCIAL CORP	USD	28.185,00	0,05					
6.183	CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	USD	811.766,07	1,44					
3.600	CARLYLE GROUP INC	USD	176.076,00	0,31					
17.000	CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	USD	770.610,00	1,37					
400	COHEN & STEERS INC	USD	34.356,00	0,06					
1.000	FEDERATED INVESTORS INC - B	USD	34.060,00	0,06					
16.625	FIDELITY NATIONAL FINANCIAL INC	USD	811.965,00	1,44					
20.256	JPMORGAN CHASE & CO	USD	2.761.297,92	4,90					
3.300	KKR & CO INC	USD	192.951,00	0,34					
15.104	MARSH & MCLENNAN COS INC	USD	2.574.023,68	4,56					
2.200	MGIC INVESTMENT CORP	USD	29.810,00	0,05					
6.605	MOODY'S CORP	USD	2.228.593,05	3,95					
10.600	MORGAN STANLEY	USD	926.440,00	1,64					
600	ONEMAIN HOLDINGS INC - A	USD	28.446,00	0,05					
9.420	PNC FINANCIAL SERVICES GROUP INC/THE	USD	1.737.519,00	3,08					
225	PRIMERICA INC	USD	30.784,50	0,05					
19.673	PROGRESSIVE CORP/THE	USD	2.242.525,27	3,98					
1.300	RADIANT GROUP INC	USD	28.873,00	0,05					
5.863	RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	USD	644.402,33	1,14					
17.400	REGIONS FINANCIAL CORP	USD	387.324,00	0,69					
6.705	S&P GLOBAL INC	USD	2.750.256,90	4,88					
1.600	STARWOOD PROPERTY TRUST INC	USD	38.672,00	0,07					
19.400	SYNCHRONY FINANCIAL	USD	675.314,00	1,20					
8.400	TRUIST FINANCIAL CORP	USD	476.280,00	0,84					
23.907	US BANCORP	USD	1.270.657,05	2,25					
500	VOYA FINANCIAL INC	USD	33.175,00	0,06					
700	WEBSTER FINANCIAL CORP	USD	39.284,00	0,07					
342	WESTERN ALLIANCE BANCORP	USD	28.324,44	0,05					
			<b>28.945.137,37</b>	<b>51,33</b>					
<b>Kanada</b>									
6.019	BANK OF MONTREAL	CAD	708.902,84	1,26					
3.400	BANK OF NOVA SCOTIA/THE	CAD	243.897,36	0,43					
16.300	GREAT-WEST LIFE CO INC - B	CAD	480.758,98	0,85					
1.900	IGM FINANCIAL INC	CAD	67.189,46	0,12					
19.600	MANULIFE FINANCIAL CORP	CAD	418.346,74	0,74					
7.600	NATIONAL BANK OF CANADA	CAD	583.089,55	1,03					
5.470	ROYAL BANK OF CANADA	CAD	602.770,75	1,07					
39.032	TORONTO-DOMINION BANK/THE	CAD	3.099.622,98	5,50					
			<b>6.204.578,66</b>	<b>11,00</b>					
<b>Vereinigtes Königreich</b>									
81.100	ABRDN PLC	GBP	229.470,89	0,41					
467.000	BARCLAYS PLC	GBP	911.860,41	1,63					
62.200	M&G PLC	GBP	181.153,13	0,32					
29.600	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	GBP	239.293,23	0,42					
78.300	PRUDENTIAL PLC	GBP	1.169.082,46	2,07					
37.700	3I GROUP PLC	GBP	689.219,51	1,22					
			<b>3.420.079,63</b>	<b>6,07</b>					
<b>Australien</b>									
27.000	AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP LTD	AUD	559.607,92	0,99					
896	MACQUARIE GROUP LTD	AUD	136.770,46	0,24					
157.400	MEDIBANK PVT LTD	AUD	364.054,54	0,65					
80.800	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	AUD	1.962.893,11	3,48					
			<b>3.023.326,03</b>	<b>5,36</b>					
<b>Japan</b>									
83.700	DAIWA SECURITIES GROUP INC	JPY	477.684,78	0,84					
37.900	JAPAN POST HOLDINGS CO LTD	JPY	280.530,26	0,50					
26.700	ORIX CORP	JPY	538.399,59	0,95					
4.000	SBI HOLDINGS INC/JAPAN	JPY	102.162,72	0,18					
31.800	SUMITOMO MITSUI FINANCIAL GROUP INC	JPY	1.023.625,95	1,82					
1.300	TOKIO MARINE HOLDINGS INC	JPY	76.345,21	0,14					
			<b>2.498.748,51</b>	<b>4,43</b>					
<b>Schweiz</b>									
119.200	UBS GROUP AG - REG	CHF	2.350.322,20	4,16					
300	VONTOBEL HOLDING AG - REG	CHF	25.476,77	0,05					
			<b>2.375.798,97</b>	<b>4,21</b>					
<b>Deutschland</b>									
6.597	ALLIANZ SE - REG	EUR	1.589.509,90	2,81					
240	MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGSGESELLSCHAFT AG IN MUENCHEN - REG	EUR	64.889,75	0,12					
			<b>1.654.399,65</b>	<b>2,93</b>					
<b>Belgien</b>									
14.200	KBC GROUP NV	EUR	1.032.979,79	1,83					
			<b>1.032.979,79</b>	<b>1,83</b>					
<b>Italien</b>									
42.900	ASSICURAZIONI GENERALI SPA	EUR	991.407,85	1,76					
900	BANCA GENERALI SPA	EUR	33.766,70	0,06					
			<b>1.025.174,55</b>	<b>1,82</b>					
<b>Bermuda</b>									
5.600	ARCH CAPITAL GROUP LTD	USD	271.152,00	0,48					
54	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT REINSURANCE PARTNERS LTD - A	CAD	3.085,53	0,01					
113	ENSTAR GROUP LTD	USD	29.509,95	0,05					
751	EVEREST RE GROUP LTD	USD	226.336,38	0,40					
17.700	INVESCO LTD	USD	408.162,00	0,72					
			<b>938.245,86</b>	<b>1,66</b>					
<b>Frankreich</b>									
14.900	AXA SA	EUR	440.407,45	0,79					
4.200	BNP PARIBAS SA	EUR	242.675,64	0,43					
12.800	CREDIT AGRICOLE SA	EUR	155.037,54	0,27					
492	WENDEL SA	EUR	50.691,44	0,09					
			<b>888.812,07</b>	<b>1,58</b>					

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Banking & Insurance

(ausgedrückt in USD)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW
<b>Singapur</b>				
18.000	DBS GROUP HOLDINGS LTD	SGD	476.550,78	0,85
10.506	UNITED OVERSEAS BANK LTD	SGD	248.569,93	0,44
			<b>725.120,71</b>	<b>1,29</b>
<b>Spanien</b>				
4.000	BANKINTER SA	EUR	23.694,99	0,04
182.200	CAIXABANK SA	EUR	623.784,29	1,10
1.200	GRUPO CATALANA OCCIDENTE SA	EUR	37.118,00	0,07
			<b>684.597,28</b>	<b>1,21</b>
<b>Niederlande</b>				
6.500	EXOR NV	EUR	502.639,63	0,89
11.800	ING GROEP NV	EUR	124.872,48	0,22
			<b>627.512,11</b>	<b>1,11</b>
<b>Hongkong</b>				
52.500	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	HKD	199.102,33	0,36
21.700	HANG SENG BANK LTD	HKD	418.959,57	0,74
			<b>618.061,90</b>	<b>1,10</b>
<b>Schweden</b>				
7.400	INDUSTRIVARDEN AB - A	SEK	213.438,63	0,38
28.500	SVENSKA HANDELSBANKEN AB - A	SEK	265.752,09	0,47
5.700	SWEDBANK AB - A	SEK	86.239,46	0,15
			<b>565.430,18</b>	<b>1,00</b>
<b>Finnland</b>				
5.800	SAMPO OYJ - A	EUR	286.400,56	0,51
			<b>286.400,56</b>	<b>0,51</b>
<b>Dänemark</b>				
700	TOPDANMARK AS	DKK	39.411,55	0,07
			<b>39.411,55</b>	<b>0,07</b>
<b>Puerto Rico</b>				
400	POPULAR INC	USD	32.696,00	0,07
			<b>32.696,00</b>	<b>0,07</b>
<b>Jersey</b>				
700	JANUS HENDERSON GROUP PLC	USD	24.514,00	0,04
			<b>24.514,00</b>	<b>0,04</b>
<b>Norwegen</b>				
1.000	DNB BANK ASA	NOK	22.884,26	0,04
			<b>22.884,26</b>	<b>0,04</b>
			<b>55.633.909,64</b>	<b>98,66</b>
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>			<b>55.633.909,64</b>	<b>98,66</b>

### Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022

Zu erhalten	Zu zahlen	Fälligkeits- datum	Engagement in USD	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in USD		
<b>Devisentermingeschäfte</b>						
805.268,60	EUR	103.657.098,00	JPY	20/04/2022	901.651,73	42.122,63
1.148.245,36	EUR	958.608,47	GBP	20/04/2022	1.285.707,99	16.177,48
445.671,02	CAD	315.126,30	EUR	20/04/2022	348.142,91	5.996,44
317.853,45	AUD	212.140,46	EUR	20/04/2022	231.397,64	2.588,55
115.198,45	SEK	10.682,42	EUR	20/04/2022	11.824,02	473,29
372.082,77	NOK	37.955,05	EUR	20/04/2022	41.456,44	293,90
182.822,67	EUR	1.592.445,73	HKD	20/04/2022	204.192,36	142,31
23.776,21	EUR	176.870,04	DKK	20/04/2022	26.705,44	(1,52)
68.097,11	HKD	7.847,45	EUR	20/04/2022	8.714,25	(38,91)
27.454,09	SGD	18.299,93	EUR	20/04/2022	20.147,52	(86,46)
5.003,76	EUR	18.063,31	ILS	20/04/2022	5.620,23	(91,61)
732.635,85	EUR	750.302,62	CHF	20/04/2022	810.566,57	(211,48)
58.374,46	CHF	57.605,04	EUR	20/04/2022	63.158,82	(657,09)
43.571,89	EUR	430.133,01	NOK	20/04/2022	48.939,94	(678,92)
222.968,61	EUR	337.850,97	SGD	20/04/2022	250.019,85	(1.419,52)
130.356,56	GBP	156.607,61	EUR	20/04/2022	172.630,94	(2.715,56)
5.147.638,00	JPY	40.816,73	EUR	20/04/2022	44.612,72	(3.012,27)
807.176,89	USD	728.522,66	EUR	20/04/2022	807.176,89	(3.790,31)
175.624,49	EUR	1.874.146,71	SEK	20/04/2022	197.057,99	(5.658,64)
9.180.713,93	EUR	10.257.525,88	USD	20/04/2022	10.257.525,88	(37.860,31)
1.023.445,74	EUR	1.570.349,04	AUD	20/04/2022	1.149.005,10	(40.206,23)
2.022.645,33	EUR	2.865.318,81	CAD	20/04/2022	2.271.835,22	(42.306,35)
					<b>19.158.090,45</b>	<b>(70.940,58)</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>						<b>(70.940,58)</b>

### Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick

		% NIW
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	<b>55.633.909,64</b>	<b>98,66</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	<b>(70.940,58)</b>	<b>(0,13)</b>
<b>Bankguthaben</b>	<b>747.154,82</b>	<b>1,32</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>	<b>81.771,35</b>	<b>0,15</b>
<b>Nettovermögen Gesamt</b>	<b>56.391.895,23</b>	<b>100,00</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Belgian Government Bond

(ausgedrückt in EUR)

### Statistische Angaben

<b>Nettovermögen</b>	31.03.2022	EUR	21.679.568,88
	30.09.2021	EUR	26.530.454,62
	30.09.2020	EUR	31.352.167,76
<b>Nettoinventarwert pro Anteil**</b>			
Capitalisation P (EUR)	31.03.2022	EUR	1.460,51
	30.09.2021	EUR	1.575,86
	30.09.2020	EUR	1.647,35
Capitalisation R (EUR)	31.03.2022	EUR	1.475,08
	30.09.2021	EUR	1.589,69
	30.09.2020	EUR	1.657,83
Distribution P (EUR)	31.03.2022	EUR	1.960,08
	30.09.2021	EUR	2.114,88
	30.09.2020	EUR	2.210,81
Distribution R (EUR)	31.03.2022	EUR	1.979,80
	30.09.2021	EUR	2.133,40
	30.09.2020	EUR	2.224,84
<b>Anzahl der Anteile</b>			
Capitalisation P (EUR)	31.03.2022		9.213
	30.09.2021		10.163
	30.09.2020		11.527
Capitalisation R (EUR)	31.03.2022		471
	30.09.2021		482
	30.09.2020		383
Distribution P (EUR)	31.03.2022		3.700
	30.09.2021		4.302
	30.09.2020		4.996
Distribution R (EUR)	31.03.2022		140
	30.09.2021		305
	30.09.2020		307
<b>Laufende Kosten in %*</b>			
Capitalisation P (EUR)	31.03.2022		0,80%
Capitalisation R (EUR)	31.03.2022		0,56%
Distribution P (EUR)	31.03.2022		0,80%
Distribution R (EUR)	31.03.2022		0,55%
<b>Portfolioumsatz in %*</b>	31.03.2022		14,20%

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

## NN (L) Belgian Government Bond

(ausgedrückt in EUR)

### Finanzabschlüsse

#### Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022

	Erläuterungen	
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	2	<b>21.321.801,97</b>
Anleihen und andere Schuldtitel		21.321.801,97
<b>Bankguthaben</b>		<b>463.235,84</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte</b>	4	<b>148.615,51</b>
<b>Vermögenswerte Gesamt</b>		<b>21.933.653,32</b>
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>	4	<b>(254.084,44)</b>
<b>Verbindlichkeiten Gesamt</b>		<b>(254.084,44)</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Berichtszeitraums</b>		<b>21.679.568,88</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Belgian Government Bond

(ausgedrückt in EUR)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
<b>Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>				
<b>Anleihen und andere Schuldtitel</b>				
<b>Belgien</b>				
540.000	BELGIUM GOVERNMENT BOND ZCP 22/10/2027	EUR	522.872,69	2,41
210.000	BELGIUM GOVERNMENT BOND ZCP 22/10/2031	EUR	191.905,76	0,89
990.000	BELGIUM GOVERNMENT BOND 0.100% 22/06/2030	EUR	936.157,65	4,32
600.000	BELGIUM GOVERNMENT BOND 0.200% 22/10/2023	EUR	603.609,81	2,78
90.000	BELGIUM GOVERNMENT BOND 0.400% 22/06/2040	EUR	76.357,18	0,35
210.000	BELGIUM GOVERNMENT BOND 0.650% 22/06/2071	EUR	140.525,67	0,65
1.100.000	BELGIUM GOVERNMENT BOND 0.800% 22/06/2025	EUR	1.117.797,09	5,16
400.000	BELGIUM GOVERNMENT BOND 0.800% 22/06/2027	EUR	405.121,02	1,87
800.000	BELGIUM GOVERNMENT BOND 0.800% 22/06/2028	EUR	809.076,17	3,73
980.000	BELGIUM GOVERNMENT BOND 0.900% 22/06/2029	EUR	992.672,41	4,58
900.000	BELGIUM GOVERNMENT BOND 1.000% 22/06/2026	EUR	920.433,88	4,25
1.183.000	BELGIUM GOVERNMENT BOND 1.000% 22/06/2031	EUR	1.196.030,65	5,52
219.000	BELGIUM GOVERNMENT BOND 1.250% 22/04/2033	EUR	226.033,45	1,04
250.000	BELGIUM GOVERNMENT BOND 1.400% 22/06/2053	EUR	241.522,04	1,11
504.618	BELGIUM GOVERNMENT BOND 1.450% 22/06/2037	EUR	519.642,15	2,40
670.000	BELGIUM GOVERNMENT BOND 1.600% 22/06/2047	EUR	690.701,78	3,19
495.000	BELGIUM GOVERNMENT BOND 1.700% 22/06/2050	EUR	520.269,15	2,40
546.794	BELGIUM GOVERNMENT BOND 1.900% 22/06/2038	EUR	600.794,18	2,77
430.000	BELGIUM GOVERNMENT BOND 2.150% 22/06/2066	EUR	509.160,73	2,35
460.000	BELGIUM GOVERNMENT BOND 2.250% 22/06/2023	EUR	474.694,29	2,19
340.000	BELGIUM GOVERNMENT BOND 2.250% 22/06/2057	EUR	405.910,41	1,87
930.000	BELGIUM GOVERNMENT BOND 2.600% 22/06/2024	EUR	982.455,70	4,53
720.000	BELGIUM GOVERNMENT BOND 3.000% 22/06/2034	EUR	878.418,63	4,05
570.000	BELGIUM GOVERNMENT BOND 3.750% 22/06/2045	EUR	834.892,97	3,85
586.000	BELGIUM GOVERNMENT BOND 4.000% 28/03/2032	EUR	758.400,04	3,50
950.000	BELGIUM GOVERNMENT BOND 4.250% 28/03/2041	EUR	1.408.967,27	6,50
720.000	BELGIUM GOVERNMENT BOND 4.500% 28/03/2026	EUR	837.730,56	3,86
1.280.000	BELGIUM GOVERNMENT BOND 5.000% 28/03/2035	EUR	1.876.255,09	8,65
1.270.000	BELGIUM GOVERNMENT BOND 5.500% 28/03/2028	EUR	1.643.393,55	7,58
			<b>21.321.801,97</b>	<b>98,35</b>
			<b>21.321.801,97</b>	<b>98,35</b>
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>			<b>21.321.801,97</b>	<b>98,35</b>

### Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick

		% NIW
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	<b>21.321.801,97</b>	<b>98,35</b>
<b>Bankguthaben</b>	<b>463.235,84</b>	<b>2,14</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>	<b>(105.468,93)</b>	<b>(0,49)</b>
<b>Nettovermögen Gesamt</b>	<b>21.679.568,88</b>	<b>100,00</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Climate & Environment

(ausgedrückt in EUR)

### Statistische Angaben

<b>Nettovermögen</b>	31.03.2022	EUR	259.746.368,47	Distribution N (EUR)	31.03.2022	EUR	61,15
	30.09.2021	EUR	218.692.695,21		30.09.2021	EUR	64,36
	30.09.2020	EUR	76.484.270,81		30.09.2020	EUR	-
<b>Nettoinventarwert pro Anteil</b>				Distribution P (EUR)	31.03.2022	EUR	353,47
					30.09.2021	EUR	373,58
					30.09.2020	EUR	291,27
Capitalisation I (EUR)	31.03.2022	EUR	9.095,77	Distribution P (USD)	31.03.2022	USD	5.756,91
	30.09.2021	EUR	9.565,91		30.09.2021	USD	6.337,56
	30.09.2020	EUR	7.385,05		30.09.2020	USD	4.999,73
Capitalisation I (USD)	31.03.2022	USD	1.776,74	Distribution P Hedged (ii) (EUR)	31.03.2022	EUR	1.891,10
	30.09.2021	USD	1.946,28		30.09.2021	EUR	2.062,52
	30.09.2020	USD	1.520,19		30.09.2020	EUR	1.650,17
Capitalisation P (EUR)	31.03.2022	EUR	351,90	Distribution R (EUR)	31.03.2022	EUR	359,65
	30.09.2021	EUR	371,92		30.09.2021	EUR	378,70
	30.09.2020	EUR	289,98		30.09.2020	EUR	293,06
Capitalisation P (USD)	31.03.2022	USD	1.506,25	Distribution R (USD)	31.03.2022	USD	300,20
	30.09.2021	USD	1.658,17		30.09.2021	USD	329,24
	30.09.2020	USD	1.308,16		30.09.2020	USD	257,80
Capitalisation P Hedged (ii) (EUR)	31.03.2022	EUR	607,54	<b>Anzahl der Anteile</b>			
	30.09.2021	EUR	662,97				
	30.09.2020	EUR	530,18				
Capitalisation R (EUR)	31.03.2022	EUR	359,68	Capitalisation I (EUR)	31.03.2022		1.208
	30.09.2021	EUR	378,72	30.09.2021			647
	30.09.2020	EUR	293,08	30.09.2020			201
Capitalisation R (USD)	31.03.2022	USD	313,12	Capitalisation I (USD)	31.03.2022		101
	30.09.2021	USD	343,43	30.09.2021			224
	30.09.2020	USD	268,92	30.09.2020			357
Capitalisation R Hedged (ii) (EUR)	31.03.2022	EUR	314,06	Capitalisation P (EUR)	31.03.2022		61.023
	30.09.2021	EUR	341,00	30.09.2021			66.233
	30.09.2020	EUR	270,72	30.09.2020			76.997
Capitalisation X (EUR)	31.03.2022	EUR	2.002,51	Capitalisation P (USD)	31.03.2022		9.863
	30.09.2021	EUR	2.121,64	30.09.2021			13.051
	30.09.2020	EUR	1.662,41	30.09.2020			10.973
Capitalisation X (HUF)	31.03.2022	HUF	97.780,59	Capitalisation P Hedged (ii) (EUR)	31.03.2022		6.358
	30.09.2021	HUF	101.340,90	30.09.2021			6.674
	30.09.2020	HUF	80.295,43	30.09.2020			8.012
Capitalisation X (USD)	31.03.2022	USD	1.356,34	Capitalisation R (EUR)	31.03.2022		1.526
	30.09.2021	USD	1.496,80	30.09.2021			1.675
	30.09.2020	USD	1.186,59	30.09.2020			1.330
Capitalisation X Hedged (i) (CZK)	31.03.2022	CZK	9.315,59	Capitalisation R (USD)	31.03.2022		3.845
	30.09.2021	CZK	9.713,63	30.09.2021			3.093
	30.09.2020	CZK	7.585,91	30.09.2020			1.252
Capitalisation Y (USD)	31.03.2022	USD	330,52	Capitalisation R Hedged (ii) (EUR)	31.03.2022		4.566
	30.09.2021	USD	366,60	30.09.2021			3.237
	30.09.2020	USD	293,60	30.09.2020			522

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

## NN (L) Climate & Environment

(ausgedrückt in EUR)

### Statistische Angaben (Fortsetzung)

<b>Anzahl der Anteile</b>				Capitalisation P (EUR)	31.03.2022	1,80%
				Capitalisation P (USD)	31.03.2022	1,80%
Capitalisation X (EUR)	31.03.2022	6.229	Capitalisation P Hedged (ii) (EUR)	31.03.2022	1,82%	
	30.09.2021	5.534	Capitalisation R (EUR)	31.03.2022	1,05%	
	30.09.2020	2.589	Capitalisation R (USD)	31.03.2022	1,05%	
Capitalisation X (HUF)	31.03.2022	4.188	Capitalisation R Hedged (ii) (EUR)	31.03.2022	1,07%	
	30.09.2021	2.280	Capitalisation X (EUR)	31.03.2022	2,30%	
	30.09.2020	281	Capitalisation X (HUF)	31.03.2022	2,30%	
Capitalisation X (USD)	31.03.2022	36.272	Capitalisation X (USD)	31.03.2022	2,30%	
	30.09.2021	25.411	Capitalisation X Hedged (i) (CZK)	31.03.2022	2,32%	
	30.09.2020	13.606	Capitalisation Y (USD)	31.03.2022	3,30%	
Capitalisation X Hedged (i) (CZK)	31.03.2022	86.662	Distribution N (EUR)	31.03.2022	0,83%	
	30.09.2021	56.300	Distribution P (EUR)	31.03.2022	1,80%	
	30.09.2020	11.073	Distribution P (USD)	31.03.2022	1,80%	
Capitalisation Y (USD)	31.03.2022	208.477	Distribution P Hedged (ii) (EUR)	31.03.2022	1,82%	
	30.09.2021	110.689	Distribution R (EUR)	31.03.2022	1,05%	
	30.09.2020	10.610	Distribution R (USD)	31.03.2022	1,05%	
Distribution N (EUR)	31.03.2022	729.956	<b>Portfolioumsatz in %*</b>	31.03.2022	(110,96%)	
	30.09.2021	753.495				
	30.09.2020	-				
Distribution P (EUR)	31.03.2022	17.868				
	30.09.2021	20.387				
	30.09.2020	26.399				
Distribution P (USD)	31.03.2022	381				
	30.09.2021	460				
	30.09.2020	487				
Distribution P Hedged (ii) (EUR)	31.03.2022	380				
	30.09.2021	397				
	30.09.2020	465				
Distribution R (EUR)	31.03.2022	503				
	30.09.2021	744				
	30.09.2020	788				
Distribution R (USD)	31.03.2022	877				
	30.09.2021	772				
	30.09.2020	1.126				
<b>Dividende</b>						
Distribution N (EUR)	14.12.2021	EUR	0,05			
<b>Laufende Kosten in %*</b>						
Capitalisation I (EUR)	31.03.2022		0,81%			
Capitalisation I (USD)	31.03.2022		0,81%			

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.



## NN (L) Climate & Environment

(ausgedrückt in EUR)

### Finanzabschlüsse

#### Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022

	Erläuterungen	
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	2	<b>254.876.926,34</b>
Aktien		254.876.926,34
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	2	<b>1.129.240,36</b>
Devisentermingeschäfte		1.129.240,36
<b>Bankguthaben</b>		<b>6.926.174,05</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte</b>	4	<b>2.551.703,60</b>
<b>Vermögenswerte Gesamt</b>		<b>265.484.044,35</b>
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>	4, 12	<b>(5.737.675,88)</b>
<b>Verbindlichkeiten Gesamt</b>		<b>(5.737.675,88)</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Berichtszeitraums</b>		<b>259.746.368,47</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Climate & Environment

(ausgedrückt in EUR)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
<b>Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>				
<b>Aktien</b>				
<b>Vereinigte Staaten</b>				
82.500	AMERICAN WATER WORKS CO INC	USD	12.273.603,56	4,73
32.500	ANSYS INC	USD	9.278.411,90	3,57
105.000	BADGER METER INC	USD	9.409.562,76	3,62
50.000	DANAHER CORP	USD	13.181.593,49	5,07
60.000	ECOLAB INC	USD	9.521.053,34	3,67
48.500	IDEX CORP	USD	8.357.439,45	3,22
51.000	KADANT INC	USD	8.900.993,12	3,43
23.500	MICROSOFT CORP	USD	6.511.737,74	2,51
400.000	SHOALS TECHNOLOGIES GROUP INC - A	USD	6.125.915,61	2,35
42.500	SOLAREDDGE TECHNOLOGIES INC	USD	12.313.598,17	4,74
20.000	VERISK ANALYTICS INC - A	USD	3.857.996,67	1,49
40.000	WATTS WATER TECHNOLOGIES INC - A	USD	5.018.289,67	1,93
36.000	XYLEM INC/NY	USD	2.758.603,33	1,06
			<b>107.508.798,81</b>	<b>41,39</b>
<b>Irland</b>				
18.000	ACCENTURE PLC - A	USD	5.455.570,04	2,10
90.000	KINGSPAN GROUP PLC	EUR	8.013.600,00	3,08
67.500	TRANE TECHNOLOGIES PLC	USD	9.263.694,78	3,57
			<b>22.732.864,82</b>	<b>8,75</b>
<b>Frankreich</b>				
92.500	LEGRAND SA	EUR	7.990.150,00	3,07
72.500	SCHNEIDER ELECTRIC SE	EUR	11.031.600,00	4,25
			<b>19.021.750,00</b>	<b>7,32</b>
<b>Norwegen</b>				
600.000	ADEVINTA ASA - B	NOK	4.986.734,53	1,92
210.000	TOMRA SYSTEMS ASA	NOK	9.741.276,94	3,75
			<b>14.728.011,47</b>	<b>5,67</b>
<b>Schweiz</b>				
235.000	SIG COMBIBLOC GROUP AG	CHF	5.370.556,77	2,07
28.500	SIKA AG - REG	CHF	8.556.266,74	3,29
			<b>13.926.823,51</b>	<b>5,36</b>
<b>Vereinigtes Königreich</b>				
400.000	HALMA PLC	GBP	11.880.793,77	4,58
			<b>11.880.793,77</b>	<b>4,58</b>
<b>Dänemark</b>				
42.500	CHR HANSEN HOLDING AS	DKK	2.837.921,38	1,09
325.000	VESTAS WIND SYSTEMS AS	DKK	8.727.450,99	3,36
			<b>11.565.372,37</b>	<b>4,45</b>
<b>Kanada</b>				
175.000	DESCARTES SYSTEMS GROUP INC	CAD	11.525.588,45	4,44
			<b>11.525.588,45</b>	<b>4,44</b>
<b>Niederlande</b>				
100.000	ALFEN BEHEER BV	EUR	9.230.000,00	3,55
			<b>9.230.000,00</b>	<b>3,55</b>

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
<b>Japan</b>				
52.530	DAIKIN INDUSTRIES LTD	JPY	8.716.887,38	3,36
			<b>8.716.887,38</b>	<b>3,36</b>
<b>Färöer-Inseln</b>				
125.000	BAKKAFROST P/F	NOK	7.618.964,82	2,93
			<b>7.618.964,82</b>	<b>2,93</b>
<b>Schweden</b>				
150.000	ATLAS COPCO AB - A	SEK	7.112.870,94	2,74
			<b>7.112.870,94</b>	<b>2,74</b>
<b>Luxemburg</b>				
73.000	BEFESA SA	EUR	5.212.200,00	2,01
			<b>5.212.200,00</b>	<b>2,01</b>
<b>Deutschland</b>				
100.000	HELLOFRESH SE	EUR	4.096.000,00	1,58
			<b>4.096.000,00</b>	<b>1,58</b>
			<b>254.876.926,34</b>	<b>98,13</b>

### Wertpapierbestand Gesamt

**254.876.926,34 98,13**

### Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022

Zu erhalten	Zu zahlen	Fälligkeits- datum	Engagement in EUR	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR
<b>Devisentermingeschäfte</b>				
813.703.324,41	32.054.922,35	EUR 19/04/2022	32.054.922,35	1.185.946,34
235.514,27	30.277.752,00	JPY 20/04/2022	235.514,27	11.352,03
293.715,43	245.153,04	GBP 20/04/2022	293.715,43	3.781,51
253.095,57	23.869,16	EUR 20/04/2022	23.869,16	534,68
331.248,60	33.763,40	EUR 20/04/2022	33.763,40	261,32
524.474,92	70.508,60	EUR 20/04/2022	70.508,60	(0,62)
28.897,63	20.799,20	EUR 20/04/2022	20.799,20	(16,88)
509,41	782,52	AUD 20/04/2022	509,41	(18,58)
336.092,30	2.500.310,40	DKK 20/04/2022	336.092,30	(37,83)
9.513,25	9.467,56	EUR 20/04/2022	9.467,56	(175,90)
10.177,24	12.264,40	EUR 20/04/2022	12.264,40	(228,14)
333.318,00	342.122,27	CHF 20/04/2022	333.318,00	(835,38)
2.616.964,00	20.641,46	EUR 20/04/2022	20.641,46	(1.266,69)
114.004,90	104.655,60	EUR 20/04/2022	104.655,60	(2.240,69)
182.819,01	1.949.185,47	SEK 20/04/2022	182.819,01	(5.124,23)
290.918,21	411.980,24	CAD 20/04/2022	290.918,21	(5.365,58)
544.877,56	5.380.290,41	NOK 20/04/2022	544.877,56	(7.767,51)
2.953.021,91	3.300.059,79	USD 20/04/2022	2.953.021,91	(11.546,56)

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Climate & Environment

(ausgedrückt in EUR)

### Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Zu erhalten	Zu zahlen	Fälligkeits- datum	Engagement in EUR	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR
934.321,00 EUR	23.801.716,22 CZK	19/04/2022	934.321,00	(38.010,93)
			<b>38.455.998,83</b>	<b>1.129.240,36</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>				<b>1.129.240,36</b>

### Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick

		% NIW
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	<b>254.876.926,34</b>	<b>98,13</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	<b>1.129.240,36</b>	<b>0,43</b>
<b>Bankguthaben</b>	<b>6.926.174,05</b>	<b>2,67</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>	<b>(3.185.972,28)</b>	<b>(1,23)</b>
<b>Nettovermögen Gesamt</b>	<b>259.746.368,47</b>	<b>100,00</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Commodity Enhanced

(ausgedrückt in USD)

### Statistische Angaben

<b>Nettovermögen</b>	31.03.2022	USD	383.216.253,83	<b>Anzahl der Anteile</b>		
	30.09.2021	USD	196.340.104,45			
	30.09.2020	USD	179.481.656,31			
<b>Nettoinventarwert pro Anteil**</b>				Capitalisation I Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	3.878
					30.09.2021	2.767
					30.09.2020	774
Capitalisation I (USD)	31.03.2022	USD	5.603,27	Capitalisation I Hedged (i) (GBP)	31.03.2022	95.949
	30.09.2021	USD	4.585,51		30.09.2021	100.784
	30.09.2020	USD	3.267,90		30.09.2020	-
Capitalisation I Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	EUR	3.843,89	Capitalisation I Hedged (i) (PLN)	31.03.2022	34.492
	30.09.2021	EUR	3.151,21		30.09.2021	18.577
	30.09.2020	EUR	2.273,25		30.09.2020	133
Capitalisation I Hedged (i) (GBP)	31.03.2022	GBP	134,04	Capitalisation N Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	20.611
	30.09.2021	GBP	109,81		30.09.2021	11.597
	30.09.2020	GBP	-		30.09.2020	9.889
Capitalisation I Hedged (i) (PLN)	31.03.2022	PLN	33.541,42	Capitalisation O Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	3.144
	30.09.2021	PLN	26.965,05		30.09.2021	16.787
	30.09.2020	PLN	19.322,13		30.09.2020	19.567
Capitalisation N Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	EUR	206,46	Capitalisation P Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	13.244
	30.09.2021	EUR	169,21		30.09.2021	11.084
	30.09.2020	EUR	122,29		30.09.2020	14.096
Capitalisation O Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	EUR	208,24	Capitalisation X (USD)	31.03.2022	92.147
	30.09.2021	EUR	170,89		30.09.2021	43.681
	30.09.2020	EUR	123,08		30.09.2020	1.479
Capitalisation P Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	EUR	197,16	Capitalisation X Hedged (i) (CZK)	31.03.2022	1.289.119
	30.09.2021	EUR	162,44		30.09.2021	1.321.691
	30.09.2020	EUR	117,94		30.09.2020	1.194.304
Capitalisation X (USD)	31.03.2022	USD	208,70	Capitalisation Z Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	1.006
	30.09.2021	USD	171,61		30.09.2021	809
	30.09.2020	USD	123,55		30.09.2020	944
Capitalisation X Hedged (i) (CZK)	31.03.2022	CZK	330,79	Capitalisation Zz Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	740
	30.09.2021	CZK	268,30		30.09.2021	979
	30.09.2020	CZK	194,32		30.09.2020	2.897
Capitalisation Z Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	EUR	6.899,31			
	30.09.2021	EUR	5.644,11			
	30.09.2020	EUR	4.044,12			
Capitalisation Zz Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	EUR	7.711,98			
	30.09.2021	EUR	6.306,32			
	30.09.2020	EUR	4.521,01			
<b>Anzahl der Anteile</b>						
	31.03.2022		1.959			
	30.09.2021		288			
Capitalisation I (USD)	30.09.2020		42.992			

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

## NN (L) Commodity Enhanced

(ausgedrückt in USD)

### Statistische Angaben (Fortsetzung)

Laufende Kosten in %*		
Capitalisation I (USD)	31.03.2022	0,70%
Capitalisation I Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	0,73%
Capitalisation I Hedged (i) (GBP)	31.03.2022	0,73%
Capitalisation I Hedged (i) (PLN)	31.03.2022	0,73%
Capitalisation N Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	0,87%
Capitalisation O Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	0,66%
Capitalisation P Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	1,37%
Capitalisation X (USD)	31.03.2022	1,65%
Capitalisation X Hedged (i) (CZK)	31.03.2022	1,67%
Capitalisation Z Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	0,23%
Capitalisation Zz Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	0,01%
Portfolioumsatz in %*		
	31.03.2022	(200,79%)

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

## NN (L) Commodity Enhanced

(ausgedrückt in USD)

### Finanzabschlüsse

#### Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022

	Erläuterungen	
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	2	<b>326.150.960,46</b>
Geldmarktinstrumente		326.150.960,46
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	2	<b>37.819.787,62</b>
Total Return Swaps		29.969.517,40
Devisentermingeschäfte		7.850.270,22
<b>Bankguthaben</b>		<b>60.733.937,63</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte</b>	4	<b>61.954.637,06</b>
<b>Vermögenswerte Gesamt</b>		<b>486.659.322,77</b>
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>	4, 12	<b>(103.443.068,94)</b>
<b>Verbindlichkeiten Gesamt</b>		<b>(103.443.068,94)</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Berichtszeitraums</b>		<b>383.216.253,83</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Commodity Enhanced

(ausgedrückt in USD)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW
<b>Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>				
<b>Geldmarktinstrumente</b>				
<b>Vereinigte Staaten</b>				
10.000.000	UNITED STATES TREASURY BILL ZCP 03/11/2022	USD	9.940.338,00	2,59
40.000.000	UNITED STATES TREASURY BILL ZCP 04/08/2022	USD	39.890.402,00	10,41
18.000.000	UNITED STATES TREASURY BILL ZCP 06/10/2022	USD	17.903.973,96	4,67
10.000.000	UNITED STATES TREASURY BILL ZCP 07/04/2022	USD	9.999.738,40	2,61
15.000.000	UNITED STATES TREASURY BILL ZCP 07/07/2022	USD	14.977.267,35	3,91
35.000.000	UNITED STATES TREASURY BILL ZCP 08/09/2022	USD	34.860.043,75	9,10
25.000.000	UNITED STATES TREASURY BILL ZCP 09/06/2022	USD	24.982.522,75	6,52
65.000.000	UNITED STATES TREASURY BILL ZCP 11/08/2022	USD	64.802.871,25	16,91
14.000.000	UNITED STATES TREASURY BILL ZCP 14/07/2022	USD	13.975.590,30	3,65
20.000.000	UNITED STATES TREASURY BILL ZCP 16/06/2022	USD	19.982.226,20	5,21
50.000.000	UNITED STATES TREASURY BILL ZCP 21/07/2022	USD	49.897.756,00	13,02
25.000.000	UNITED STATES TREASURY BILL ZCP 28/04/2022	USD	24.938.230,50	6,51
			<b>326.150.960,46</b>	<b>85,11</b>
			<b>326.150.960,46</b>	<b>85,11</b>
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>			<b>326.150.960,46</b>	<b>85,11</b>

### Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022

Stückzahl	Bezeichnung	Fälligkeits- datum	Währung	Nennwert	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in USD
<b>Total Return Swaps</b>					
2.229.678	TRS COMMODITY ENHANCED CURVE INDEX	31/01/2023	USD	244.506.480,94	20.876.053,19
958.569	TRS COMMODITY ENHANCED CURVE INDEX	31/01/2023	USD	106.586.963,31	9.093.464,21
					<b>29.969.517,40</b>

Zu erhalten	Zu zahlen	Fälligkeits- datum	Engagement in USD	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in USD
<b>Devisentermingeschäfte</b>				
1.363.963.278,96	318.246.259,29	19/04/2022	318.246.259,29	8.607.874,04
483.785.356,18	21.201.338,57	19/04/2022	21.201.338,57	797.828,55
40.122.119,36	44.644.123,27	19/04/2022	44.644.123,27	17.143,99
247.252,25	221.462,90	04/04/2022	247.252,25	841,49
59.732,19	1.306.516,12	04/04/2022	59.732,19	216,59
25.151,64	33.039,19	01/04/2022	33.039,19	76,73
18.308,76	24.119,96	04/04/2022	24.119,96	(13,72)

Zu erhalten	Zu zahlen	Fälligkeits- datum	Engagement in USD	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in USD
21.932,95	19.754,96	01/04/2022	21.932,95	(47,41)
78.840,30	88.021,25	04/04/2022	88.021,25	(299,57)
76.892,63	1.696.451,39	01/04/2022	76.892,63	(385,65)
4.078.776,60	3.098.805,58	19/04/2022	4.078.776,60	(832,21)
2.940.648,96	12.362.929,31	01/04/2022	2.940.648,96	(26.038,74)
1.953.098,22	44.219.087,24	19/04/2022	1.953.098,22	(57.675,93)
5.771.279,47	5.238.648,58	19/04/2022	5.771.279,47	(60.034,72)
15.792.220,14	21.062.706,67	19/04/2022	21.062.706,67	(272.089,52)
37.535.845,36	161.462.412,39	19/04/2022	37.535.845,36	(1.156.293,70)
			<b>457.985.066,83</b>	<b>7.850.270,22</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>				<b>37.819.787,62</b>

### Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick

		% NIW
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	<b>326.150.960,46</b>	<b>85,11</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	<b>37.819.787,62</b>	<b>9,87</b>
<b>Bankguthaben</b>	<b>60.733.937,63</b>	<b>15,85</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten (41.488.431,88)</b>	<b>(10,83)</b>	
<b>Nettovermögen Gesamt</b>	<b>383.216.253,83</b>	<b>100,00</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Corporate Green Bond

(ausgedrückt in EUR)

### Statistische Angaben

<b>Nettovermögen</b>	31.03.2022	EUR	670.435.883,22	<b>Anzahl der Anteile</b>		
	30.09.2021	EUR	518.646.666,95			
	30.09.2020	EUR	417.602.509,58		Capitalisation X (EUR)	31.03.2022
					30.09.2021	131
					30.09.2020	-
<b>Nettoinventarwert pro Anteil</b>						
Capitalisation I (EUR)	31.03.2022	EUR	4.731,84	Distribution I (EUR)	31.03.2022	4.871
	30.09.2021	EUR	5.062,89		30.09.2021	5.093
	30.09.2020	EUR	4.996,66		30.09.2020	3.060
Capitalisation I Hedged (i) (GBP)	31.03.2022	GBP	94,81			
	30.09.2021	GBP	-			
	30.09.2020	GBP	-			
Capitalisation P Hedged (i) (SEK)	31.03.2022	SEK	2.380,48	<b>Laufende Kosten in %*</b>		
	30.09.2021	SEK	-	Capitalisation I (EUR)	31.03.2022	0,33%
	30.09.2020	SEK	-			
Capitalisation Q (EUR)	31.03.2022	EUR	4.986,59	Capitalisation I Hedged (i) (GBP)	31.03.2022	0,35%
	30.09.2021	EUR	-			
	30.09.2020	EUR	-	Capitalisation P Hedged (i) (SEK)	31.03.2022	0,59%
Capitalisation R (EUR)	31.03.2022	EUR	236,34	Capitalisation Q (EUR)	31.03.2022	0,20%
	30.09.2021	EUR	252,96			
	30.09.2020	EUR	249,82	Capitalisation R (EUR)	31.03.2022	0,39%
Capitalisation X (EUR)	31.03.2022	EUR	232,52	Capitalisation X (EUR)	31.03.2022	0,95%
	30.09.2021	EUR	249,57			
	30.09.2020	EUR	-	Distribution I (EUR)	31.03.2022	0,33%
Distribution I (EUR)	31.03.2022	EUR	4.799,36	<b>Portfolioumsatz in %*</b>	31.03.2022	29,52%
	30.09.2021	EUR	5.135,12			
	30.09.2020	EUR	5.069,24			
<b>Anzahl der Anteile</b>						
Capitalisation I (EUR)	31.03.2022		104.277			
	30.09.2021		94.761			
	30.09.2020		76.571			
Capitalisation I Hedged (i) (GBP)	31.03.2022		202			
	30.09.2021		-			
	30.09.2020		-			
Capitalisation P Hedged (i) (SEK)	31.03.2022		8			
	30.09.2021		-			
	30.09.2020		-			
Capitalisation Q (EUR)	31.03.2022		28.468			
	30.09.2021		-			
	30.09.2020		-			
Capitalisation R (EUR)	31.03.2022		49.027			
	30.09.2021		50.188			
	30.09.2020		78.020			

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.



## NN (L) Corporate Green Bond

(ausgedrückt in EUR)

### Finanzabschlüsse

#### Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022

	Erläuterungen	
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	2	<b>676.440.178,46</b>
Anleihen und andere Schuldtitel		676.440.178,46
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	2	<b>1.145.648,81</b>
Devisentermingeschäfte		108.839,11
Futures		1.036.809,70
<b>Bankguthaben</b>		<b>17.362.529,67</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte</b>	4	<b>10.136.017,80</b>
<b>Vermögenswerte Gesamt</b>		<b>705.084.374,74</b>
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>	4	<b>(34.648.491,52)</b>
<b>Verbindlichkeiten Gesamt</b>		<b>(34.648.491,52)</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Berichtszeitraums</b>		<b>670.435.883,22</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Corporate Green Bond

(ausgedrückt in EUR)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022

Stückzahl/ Nominal	Bezeich- nung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW	Stückzahl/ Nominal	Bezeich- nung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
<b>Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>									
<b>Anleihen und andere Schuldtitel</b>									
<b>Niederlande</b>									
4.500.000	ABN AMRO BANK NV 0.500% 15/04/2026 EMTN	EUR	4.420.925,24	0,66	6.500.000	BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL SA 0.100% 08/10/2027 EMTN	EUR	6.029.030,02	0,90
2.000.000	ABN AMRO BANK NV 13/12/2029 FRN	USD	1.644.499,73	0,25	3.000.000	BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL SA 0.250% 29/06/2028 EMTN	EUR	2.773.931,79	0,41
2.900.000	COOPERATIEVE RABOBANK UA 0.250% 30/10/2026	EUR	2.784.448,80	0,42	7.000.000	BNP PARIBAS SA 04/06/2026 FRN	EUR	6.807.073,70	1,02
5.471.000	CTP NV 0.750% 18/02/2027 EMTN	EUR	4.925.610,89	0,73	2.400.000	BNP PARIBAS SA 1.125% 28/08/2024 EMTN	EUR	2.411.964,50	0,36
3.319.000	CTP NV 0.875% 20/01/2026 EMTN	EUR	3.127.539,77	0,47	6.300.000	BNP PARIBAS SA 14/10/2027 FRN EMTN	EUR	5.944.007,16	0,89
3.250.000	CTP NV 1.250% 21/06/2029 EMTN	EUR	2.848.362,11	0,42	10.800.000	BNP PARIBAS SA 30/05/2028 FRN EMTN	EUR	10.146.332,48	1,51
5.114.000	CTP NV 1.500% 27/09/2031 EMTN	EUR	4.311.897,53	0,64	5.700.000	CNP ASSURANCES 27/07/2050 FRN	EUR	5.357.536,93	0,80
4.800.000	DE VOLKSBANK NV 0.010% 16/09/2024 EMTN	EUR	4.731.030,48	0,71	1.900.000	COVIVIO 1.125% 17/09/2031	EUR	1.707.404,87	0,25
2.000.000	DE VOLKSBANK NV 0.375% 03/03/2028 EMTN	EUR	1.819.653,18	0,27	700.000	COVIVIO 1.875% 20/05/2026	EUR	712.515,79	0,11
6.500.000	DE VOLKSBANK NV 22/10/2030 FRN EMTN	EUR	6.405.474,40	0,96	15.700.000	CREDIT AGRICOLE SA 0.375% 21/10/2025 EMTN	EUR	15.263.046,86	2,27
2.700.000	DIGITAL DUTCH FINCO BV 0.625% 15/07/2025	EUR	2.612.618,74	0,39	400.000	ENGIE SA FRN PERP	EUR	409.819,79	0,06
2.910.000	DIGITAL DUTCH FINCO BV 1.000% 15/01/2032	EUR	2.463.539,01	0,37	1.100.000	ENGIE SA FRN PERP	EUR	1.094.771,22	0,16
7.639.000	DIGITAL DUTCH FINCO BV 1.500% 15/03/2030	EUR	7.029.671,19	1,05	2.000.000	ENGIE SA FRN PERP	EUR	1.785.000,00	0,27
3.000.000	DIGITAL INTREPID HOLDING BV 0.625% 15/07/2031	EUR	2.490.682,38	0,37	2.000.000	ENGIE SA FRN PERP	EUR	1.743.350,40	0,26
2.833.000	EDP FINANCE BV 0.375% 16/09/2026 EMTN	EUR	2.715.629,01	0,41	1.400.000	ENGIE SA 0.375% 21/06/2027 EMTN	EUR	1.320.565,97	0,20
2.945.000	EDP FINANCE BV 1.875% 13/10/2025 EMTN	EUR	3.020.713,30	0,45	3.000.000	ENGIE SA 0.375% 26/10/2029 EMTN	EUR	2.713.872,36	0,40
7.400.000	EDP FINANCE BV 1.875% 21/09/2029 EMTN	EUR	7.434.269,55	1,11	1.900.000	ENGIE SA 1.375% 21/06/2039 EMTN	EUR	1.633.167,27	0,24
8.836.000	ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV 1.000% 16/09/2024 EMTN	EUR	8.870.405,62	1,31	4.200.000	ENGIE SA 1.375% 28/02/2029 EMTN	EUR	4.119.677,27	0,61
7.233.000	ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV 1.125% 16/09/2026 EMTN	EUR	7.187.284,26	1,07	3.400.000	ENGIE SA 1.750% 27/03/2028 EMTN	EUR	3.419.767,70	0,51
3.591.000	ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV 1.500% 21/07/2025 EMTN	EUR	3.642.085,71	0,54	1.135.000	FAURECIA SE 2.375% 15/06/2029	EUR	980.662,27	0,15
6.388.000	E.ON INTERNATIONAL FINANCE BV 1.250% 19/10/2027 EMTN	EUR	6.354.830,50	0,95	5.000.000	GECINA SA 0.875% 30/06/2036 EMTN	EUR	4.226.480,65	0,63
3.200.000	IBERDROLA INTERNATIONAL BV FRN PERP	EUR	3.303.331,94	0,49	3.300.000	LA BANQUE POSTALE SA 1.375% 24/04/2029 EMTN	EUR	3.188.710,73	0,48
4.500.000	IBERDROLA INTERNATIONAL BV FRN PERP	EUR	4.089.280,73	0,61	1.400.000	LA POSTE SA 1.450% 30/11/2028 EMTN	EUR	1.415.604,86	0,21
4.500.000	IBERDROLA INTERNATIONAL BV FRN PERP	EUR	4.253.873,04	0,63	1.100.000	SOCIETE GENERALE SA 22/09/2028 FRN	EUR	1.044.055,91	0,16
6.400.000	IBERDROLA INTERNATIONAL BV FRN PERP	EUR	6.450.683,71	0,96	1.084.000	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD SE 1.000% 14/03/2025 EMTN	EUR	1.075.256,05	0,16
2.700.000	IBERDROLA INTERNATIONAL BV FRN PERP EMTN	EUR	2.747.191,76	0,41					
900.000	IBERDROLA INTERNATIONAL BV 0.375% 15/09/2025 EMTN	EUR	883.084,69	0,13	<b>Spanien</b>				
3.000.000	IBERDROLA INTERNATIONAL BV 1.125% 21/04/2026 EMTN	EUR	3.017.547,90	0,45	4.700.000	ACCIONA ENERGIA FINANCIACION FILIALES SA 1.375% 26/01/2032 EMTN	EUR	4.389.077,85	0,65
5.200.000	ING GROEP NV 01/07/2026 FRN	USD	4.335.267,97	0,65	2.700.000	ACS SERVICIOS COMUNICACIONES Y ENERGIA SA 1.875% 20/04/2026	EUR	2.692.958,29	0,40
1.100.000	ING GROEP NV 09/06/2032 FRN EMTN	EUR	1.024.022,36	0,15	300.000	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA 1.000% 21/06/2026	EUR	295.480,08	0,04
7.200.000	ING GROEP NV 2.500% 15/11/2030 EMTN	EUR	7.587.034,92	1,13	1.900.000	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA 1.375% 14/05/2025 GMTN	EUR	1.919.015,50	0,29
3.000.000	LEASEPLAN CORP NV 1.375% 07/03/2024 EMTN	EUR	3.023.604,81	0,45	9.200.000	BANCO DE SABADELL SA 11/03/2027 FRN	EUR	8.947.716,59	1,34
2.500.000	LEASEPLAN CORP NV 3.500% 09/04/2025 EMTN	EUR	2.650.250,70	0,40	1.200.000	BANCO DE SABADELL SA 16/06/2028 FRN EMTN	EUR	1.080.632,94	0,16
5.900.000	NATURGY FINANCE BV 0.875% 15/05/2025 EMTN	EUR	5.890.110,77	0,88	2.100.000	BANCO DE SABADELL SA 24/03/2026 FRN EMTN	EUR	2.102.252,50	0,31
8.000.000	REN FINANCE BV 0.500% 16/04/2029 EMTN	EUR	7.279.262,88	1,09	4.300.000	BANCO SANTANDER SA 0.300% 04/10/2026 EMTN	EUR	4.109.948,13	0,61
1.533.000	SWISSCOM FINANCE BV 0.375% 14/11/2028	EUR	1.450.973,68	0,22	8.700.000	BANCO SANTANDER SA 1.125% 23/06/2027 EMTN	EUR	8.474.022,98	1,26
500.000	TELEFONICA EUROPE BV FRN PERP	EUR	469.421,29	0,07	8.100.000	BANCO SANTANDER SA 24/06/2029 FRN EMTN	EUR	7.515.954,60	1,12
1.098.000	TENNET HOLDING BV FRN PERP	EUR	1.122.535,04	0,17	4.600.000	CAIXABANK SA 09/02/2029 FRN EMTN	EUR	4.202.128,20	0,63
3.800.000	TENNET HOLDING BV FRN PERP	EUR	3.808.094,38	0,57	3.500.000	CAIXABANK SA 18/06/2031 FRN EMTN	EUR	3.302.740,28	0,49
1.313.000	TENNET HOLDING BV 0.875% 16/06/2035 EMTN	EUR	1.159.600,06	0,17	9.200.000	CAIXABANK SA 18/11/2026 FRN EMTN	EUR	8.822.411,67	1,33
1.000.000	TENNET HOLDING BV 2.000% 05/06/2034 EMTN	EUR	1.015.384,40	0,15	3.000.000	IBERDROLA FINANZAS SA FRN PERP	EUR	2.768.774,61	0,41
6.572.000	VESTEDA FINANCE BV 0.750% 18/10/2031 EMTN	EUR	5.857.129,39	0,87	800.000	IBERDROLA FINANZAS SA 0.875% 16/06/2025 EMTN	EUR	800.439,55	0,12
3.672.000	VESTEDA FINANCE BV 1.500% 24/05/2027 EMTN	EUR	3.665.134,46	0,55	1.300.000	IBERDROLA FINANZAS SA 1.250% 13/09/2027 EMTN	EUR	1.311.030,42	0,20
3.500.000	VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV 0.875% 22/09/2028 EMTN	EUR	3.281.273,91	0,49	1.700.000	IBERDROLA FINANZAS SA 1.375% 11/03/2032 EMTN	EUR	1.693.147,47	0,25
6.300.000	VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV 1.250% 23/09/2032 EMTN	EUR	5.931.567,81	0,88					
<b>175.136.834,00</b>				<b>26,12</b>					
<b>Frankreich</b>									
3.188.000	AXA SA 07/10/2041 FRN EMTN	EUR	2.854.664,54	0,43					
					<b>Deutschland</b>				
					1.000.000	BERLIN HYP AG 0.500% 26/09/2023 EMTN	EUR	999.992,85	0,15
					900.000	BERLIN HYP AG 1.125% 25/10/2027 EMTN	EUR	879.000,25	0,13
					1.100.000	COMMERZBANK AG 24/03/2026 FRN EMTN	EUR	1.076.428,51	0,16
					2.600.000	ENBW ENERGIE BADEN-WUERTEMBERG AG 05/08/2079 FRN	EUR	2.323.648,65	0,35
					2.500.000	ENBW ENERGIE BADEN-WUERTEMBERG AG 05/11/2079 FRN	EUR	2.385.517,45	0,36
					3.300.000	ENBW ENERGIE BADEN-WUERTEMBERG AG 31/08/2081 FRN	EUR	2.845.679,30	0,42

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.



## NN (L) Corporate Green Bond

(ausgedrückt in EUR)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
<b>Dänemark</b>				
2.750.000	AP MOLLER - MAERSK A/S 0.750% 25/11/2031 EMTN	EUR	2.486.302,89	0,36
379.000	ORSTED AS 1.500% 26/11/2029	EUR	375.356,96	0,06
445.000	ORSTED AS 24/11/3017 FRN	EUR	447.336,79	0,07
			<b>3.308.996,64</b>	<b>0,49</b>
<b>Indien</b>				
2.963.000	POWER FINANCE CORP LTD 1.841% 21/09/2028 GMTN	EUR	2.731.388,60	0,41
			<b>2.731.388,60</b>	<b>0,41</b>
<b>Schweden</b>				
850.000	TELIA CO AB 11/05/2081 FRN	EUR	819.453,42	0,12
1.660.000	TELIA CO AB 30/06/2083 FRN	EUR	1.668.992,47	0,25
			<b>2.488.445,89</b>	<b>0,37</b>
<b>Hongkong</b>				
2.050.000	MTR CORP LTD 1.625% 19/08/2030 EMTN	USD	1.640.245,47	0,24
			<b>1.640.245,47</b>	<b>0,24</b>
<b>Mexiko</b>				
1.215.000	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV 1.850% 01/09/2032	USD	946.874,26	0,14
			<b>946.874,26</b>	<b>0,14</b>
<b>Türkei</b>				
388.000	ARCELIC AS 3.000% 27/05/2026	EUR	361.697,63	0,05
			<b>361.697,63</b>	<b>0,05</b>
			<b>676.440.178,46</b>	<b>100,90</b>

**Wertpapierbestand Gesamt 676.440.178,46 100,90**

### Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022

Zu erhalten	Zu zahlen	Fälligkeits- datum	Engagement in EUR	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR	
<b>Devisentermingeschäfte</b>					
15.046.456,52	EUR	16.679.305,50 USD	30/06/2022	15.046.456,52	108.993,63
19.997,79	SEK	1.871,71 EUR	19/04/2022	1.871,71	56,53
176,63	GBP	208,43 EUR	04/04/2022	208,43	0,57
262,39	EUR	222,01 GBP	19/04/2022	262,39	(0,18)
1.198,72	EUR	1.013,16 GBP	01/04/2022	1.198,72	(0,20)
83,12	EUR	886,11 SEK	19/04/2022	83,12	(2,32)
19.367,35	GBP	23.114,85 EUR	19/04/2022	23.114,85	(208,92)
				<b>15.073.195,74</b>	<b>108.839,11</b>

Stückzahl	Bezeichnung	Währung	Engagement in EUR	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR
<b>Zins-Futures</b>				
178	EURO-BOBL FUTURE 08/06/2022	EUR	22.937.080,00	(411.270,00)
(347)	EURO-BUND FUTURE 08/06/2022	EUR	55.055.020,00	1.062.112,72
(5)	EURO-BUXL 30Y BOND 08/06/2022	EUR	931.000,00	80.000,49
(4)	US ULTRA BOND (CBT) 21/06/2022	USD	636.768,08	23.479,98
(18)	US 10YR NOTE (CBT) 21/06/2022	USD	1.987.821,87	52.829,96
(33)	US 10YR ULTRA FUTURE 21/06/2022	USD	4.017.857,14	121.184,51
1	US 2YR NOTE (CBT) 30/06/2022	USD	190.465,89	(2.274,97)
(45)	US 5YR NOTE (CBT) 30/06/2022	USD	4.638.419,54	110.747,01
			<b>90.394.432,52</b>	<b>1.036.809,70</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>				<b>1.145.648,81</b>

### Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick

		% NIW
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	<b>676.440.178,46</b>	<b>100,90</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	<b>1.145.648,81</b>	<b>0,17</b>
<b>Bankguthaben</b>	<b>17.362.529,67</b>	<b>2,59</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten (24.512.473,72)</b>		<b>(3,66)</b>
<b>Nettovermögen Gesamt</b>	<b>670.435.883,22</b>	<b>100,00</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Emerging Europe Equity

(ausgedrückt in EUR)

### Statistische Angaben

<b>Nettovermögen</b>	28.02.2022	EUR	19.254.210,73	<b>Anzahl der Anteile</b>				
	30.09.2021	EUR	41.676.380,95					
	30.09.2020	EUR	33.366.723,82		Distribution P (EUR)	28.02.2022	152	
<b>Nettoinventarwert pro Anteil**</b>					30.09.2021	164		
					30.09.2020	261		
Capitalisation I (EUR)	28.02.2022	EUR	49,41	Distribution R (EUR)	28.02.2022	50		
	30.09.2021	EUR	95,06		30.09.2021	101		
	30.09.2020	EUR	65,73		30.09.2020	320		
Capitalisation P (EUR)	28.02.2022	EUR	43,00	<b>Dividende</b>				
	30.09.2021	EUR	83,07		Distribution P (EUR)	14.12.2021	EUR	94,15
	30.09.2020	EUR	58,01		Distribution R (EUR)	14.12.2021	EUR	7,50
Capitalisation R (EUR)	28.02.2022	EUR	166,63	<b>Laufende Kosten in %*</b>				
	30.09.2021	EUR	320,90		Capitalisation I (EUR)	28.02.2022	0,91%	
	30.09.2020	EUR	222,43		Capitalisation P (EUR)	28.02.2022	1,90%	
Capitalisation X (EUR)	28.02.2022	EUR	38,83	Capitalisation R (EUR)	28.02.2022	1,15%		
	30.09.2021	EUR	75,18	Capitalisation X (EUR)	28.02.2022	2,40%		
	30.09.2020	EUR	52,76	Capitalisation X (USD)	28.02.2022	2,39%		
Capitalisation X (USD)	28.02.2022	USD	53,25	Distribution P (EUR)	28.02.2022	1,90%		
	30.09.2021	USD	106,37	Distribution R (EUR)	28.02.2022	1,14%		
	30.09.2020	USD	75,53	<b>Portfolioumsatz in %*</b>	28.02.2022	19,56%		
Distribution P (EUR)	28.02.2022	EUR	2.478,92					
	30.09.2021	EUR	4.890,11					
	30.09.2020	EUR	3.465,22					
Distribution R (EUR)	28.02.2022	EUR	147,66					
	30.09.2021	EUR	292,38					
	30.09.2020	EUR	207,21					
<b>Anzahl der Anteile</b>								
Capitalisation I (EUR)	28.02.2022		91.805					
	30.09.2021		110.306					
	30.09.2020		127.250					
Capitalisation P (EUR)	28.02.2022		117.243					
	30.09.2021		127.865					
	30.09.2020		135.255					
Capitalisation R (EUR)	28.02.2022		2.134					
	30.09.2021		2.444					
	30.09.2020		2.840					
Capitalisation X (EUR)	28.02.2022		219.321					
	30.09.2021		245.956					
	30.09.2020		284.811					
Capitalisation X (USD)	28.02.2022		8.891					
	30.09.2021		5.041					
	30.09.2020		8.191					

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

## NN (L) Emerging Europe Equity

(ausgedrückt in EUR)

### Finanzabschlüsse

#### Nettovermögensaufstellung zum 28.02.2022

	Erläuterungen	
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	2	<b>19.111.014,70</b>
Aktien		19.111.014,70
<b>Bankguthaben</b>		<b>103.231,27</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte</b>	4	<b>370.915,75</b>
<b>Vermögenswerte Gesamt</b>		<b>19.585.161,72</b>
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>	4	<b>(330.950,99)</b>
<b>Verbindlichkeiten Gesamt</b>		<b>(330.950,99)</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Berichtszeitraums</b>		<b>19.254.210,73</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Emerging Europe Equity

(ausgedrückt in EUR)

### Wertpapierbestand zum 28.02.2022

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
<b>Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>				
<b>Aktien</b>				
<b>Griechenland</b>				
1.020.000	ALPHA SERVICES AND HOLDINGS SA	EUR	1.236.240,00	6,43
100.000	ATHENS WATER SUPPLY & SEWAGE CO SA	EUR	722.000,00	3,75
540.000	EUROBANK ERGASIAS SERVICES AND HOLDINGS SA	EUR	527.148,00	2,74
91.500	MYTILINEOS SA	EUR	1.312.110,00	6,81
61.600	TERNA ENERGY SA	EUR	795.872,00	4,13
			<b>4.593.370,00</b>	<b>23,86</b>
<b>Luxemburg</b>				
75.500	ALLEGRO.EU SA	PLN	503.959,17	2,62
34.500	BEFESA SA	EUR	2.149.350,00	11,16
58.000	INPOST SA	EUR	320.044,00	1,66
			<b>2.973.353,17</b>	<b>15,44</b>
<b>Türkei</b>				
530.000	AYDEM YENILENEBILIR ENERJI AS	TRY	268.963,62	1,40
300.000	ENERJISA ENERJI AS	TRY	255.152,50	1,33
1	ENKA INSAAT VE SANAYI AS	TRY	0,79	0,00
1	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIKALARI TAS	TRY	2,00	0,00
1.225.000	GALATA WIND ENERJI AS	TRY	583.102,47	3,02
555.000	HACI OMER SABANCI HOLDING AS	TRY	554.031,66	2,88
120.000	LOGO YAZILIM SANAYI VE TICARET AS	TRY	317.591,63	1,65
420.000	TURK TELEKOMUNIKASYON AS	TRY	233.645,69	1,21
			<b>2.212.490,36</b>	<b>11,49</b>
<b>Polen</b>				
10.000	BANK POLSKA KASA OPIEKI SA	PLN	246.014,64	1,28
16.000	MO-BRUK SA	PLN	1.225.816,87	6,36
			<b>1.471.831,51</b>	<b>7,64</b>
<b>Kasachstan</b>				
17.100	HALYK SAVINGS BANK-GDR REG	USD	155.288,46	0,81
95.500	HALYK SAVINGS BANK-GDR REG	USD	867.254,27	4,50
7.000	KASPI.KZ JSC - GDR REG	USD	373.931,62	1,94
			<b>1.396.474,35</b>	<b>7,25</b>
<b>Niederlande</b>				
20.900	RHI MAGNESITA NV	EUR	698.060,00	3,63
2.100	X5 RETAIL GROUP NV - GDR REG	RUB	18.144,89	0,09
45.000	X5 RETAIL GROUP NV - GDR REG	USD	106.250,00	0,56
27.000	YANDEX NV - A	USD	455.288,46	2,36
			<b>1.277.743,35</b>	<b>6,64</b>
<b>Finnland</b>				
24.000	NESTE OYJ	EUR	844.320,00	4,39
			<b>844.320,00</b>	<b>4,39</b>
<b>Österreich</b>				
18.000	OMV AG	EUR	762.840,00	3,96
			<b>762.840,00</b>	<b>3,96</b>
<b>Vereinigte Staaten</b>				
800	EPAM SYSTEMS INC	USD	147.970,09	0,77

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
24.000	GRID DYNAMICS HOLDINGS INC	USD	259.615,38	1,35
			<b>407.585,47</b>	<b>2,12</b>
<b>Ungarn</b>				
20.000	RICHTER GEDEON NYRT	HUF	376.013,85	1,95
			<b>376.013,85</b>	<b>1,95</b>
<b>Jersey</b>				
47.000	POLYMETAL INTERNATIONAL PLC	GBP	197.181,81	1,02
			<b>197.181,81</b>	<b>1,02</b>
			<b>16.513.203,87</b>	<b>85,76</b>

### Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente

<b>Aktien</b>				
<b>Russland</b>				
750.000	AEROFLOT PJSC	RUB	142.524,18	0,74
790.532	GAZPROM PJSC	RUB	853.172,58	4,43
21.050	LUKOIL PJSC	RUB	322.509,46	1,68
8.000	MAGNIT PJSC	RUB	52.161,84	0,27
200	NOVATEK PJSC - GDR REG	USD	6.830,48	0,04
8.700	NOVATEK PJSC - GDR REG	USD	297.126,07	1,54
400.000	SBERBANK OF RUSSIA PJSC	RUB	80.389,27	0,42
603.000	SBERBANK OF RUSSIA PJSC	RUB	129.603,61	0,67
183.000	TATNEFT PJSC	RUB	341.340,74	1,77
183.000	TATNEFT PJSC - PREF 3	RUB	316.116,97	1,64
550.000.000	VTB BANK PJSC	RUB	56.035,63	0,30
			<b>2.597.810,83</b>	<b>13,50</b>
			<b>2.597.810,83</b>	<b>13,50</b>

**Wertpapierbestand Gesamt** 19.111.014,70 99,26

### Nettovermögen zum 28.02.2022 im Überblick

		% NIW
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	<b>19.111.014,70</b>	<b>99,26</b>
<b>Bankguthaben</b>	<b>103.231,27</b>	<b>0,54</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>	<b>39.964,76</b>	<b>0,20</b>
<b>Nettovermögen Gesamt</b>	<b>19.254.210,73</b>	<b>100,00</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Emerging Markets Corporate Debt

(ausgedrückt in USD)

### Statistische Angaben

<b>Nettovermögen</b>	31.03.2022	USD	140.584.712,06	<b>Anzahl der Anteile</b>			
	30.09.2021	USD	148.987.493,77				
	30.09.2020	USD	116.544.763,89		Capitalisation X Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	1.524
<b>Nettoinventarwert pro Anteil**</b>					30.09.2021	2.583	
					30.09.2020	2.505	
				Capitalisation Z (USD)	31.03.2022	16.316	
Capitalisation I (USD)	31.03.2022	USD	7.485,34		30.09.2021	16.940	
	30.09.2021	USD	8.395,73		30.09.2020	13.916	
	30.09.2020	USD	7.967,30				
Capitalisation I Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	EUR	6.786,98	<b>Laufende Kosten in %*</b>			
	30.09.2021	EUR	7.660,27		Capitalisation I (USD)	31.03.2022	0,88%
	30.09.2020	EUR	7.335,34		Capitalisation I Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	0,90%
Capitalisation N Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	EUR	333,35		Capitalisation N Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	0,92%
	30.09.2021	EUR	376,16		Capitalisation P (USD)	31.03.2022	1,50%
	30.09.2020	EUR	360,26		Capitalisation X (USD)	31.03.2022	1,80%
Capitalisation P (USD)	31.03.2022	USD	355,18		Capitalisation X Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	1,82%
	30.09.2021	USD	399,61		Capitalisation Z (USD)	31.03.2022	0,16%
	30.09.2020	USD	381,57		<b>Portfolioumsatz in %*</b>	31.03.2022	126,28%
Capitalisation X (USD)	31.03.2022	USD	340,73				
	30.09.2021	USD	383,92				
	30.09.2020	USD	367,72				
Capitalisation X Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	EUR	297,16				
	30.09.2021	EUR	336,96				
	30.09.2020	EUR	325,54				
Capitalisation Z (USD)	31.03.2022	USD	6.554,16				
	30.09.2021	USD	7.324,83				
	30.09.2020	USD	6.901,30				
<b>Anzahl der Anteile</b>							
Capitalisation I (USD)	31.03.2022		413				
	30.09.2021		208				
	30.09.2020		125				
Capitalisation I Hedged (i) (EUR)	31.03.2022		3.865				
	30.09.2021		2.381				
	30.09.2020		2.031				
Capitalisation N Hedged (i) (EUR)	31.03.2022		1.813				
	30.09.2021		1.612				
	30.09.2020		1.887				
Capitalisation P (USD)	31.03.2022		111				
	30.09.2021		357				
	30.09.2020		467				
Capitalisation X (USD)	31.03.2022		442				
	30.09.2021		430				
	30.09.2020		285				

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.



## NN (L) Emerging Markets Corporate Debt

(ausgedrückt in USD)

### Finanzabschlüsse

#### Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022

	Erläuterungen	
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	2	<b>127.812.896,45</b>
Anleihen und andere Schuldtitel		127.812.896,45
<b>Bankguthaben</b>		<b>10.088.020,37</b>
<b>Hinterlegte Sicherheiten</b>		<b>1.377.775,99</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte</b>	4	<b>10.981.190,65</b>
<b>Vermögenswerte Gesamt</b>		<b>150.259.883,46</b>
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>	4	<b>(9.044.960,05)</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	2	<b>(630.211,35)</b>
Devisentermingeschäfte		(94.181,67)
Futures		(536.029,68)
<b>Verbindlichkeiten Gesamt</b>		<b>(9.675.171,40)</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Berichtszeitraums</b>		<b>140.584.712,06</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Emerging Markets Corporate Debt

(ausgedrückt in USD)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW	Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW
<b>Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>					1.600.000	TMBTHANACHART BANK PCL FRN PERP EMTN	USD	1.527.491,42	1,09
								<b>8.700.452,05</b>	<b>6,19</b>
<b>Anleihen und andere Schuldtitel</b>					<b>Jungferninseln</b>				
<b>Kaimaninseln</b>					200.000	BLUESTAR FINANCE HOLDINGS FRN PERP	USD	196.054,01	0,14
450.000	AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC 2.625% 02/06/2026	USD	404.280,17	0,29	800.000	CAS CAPITAL NO 1 LTD FRN PERP	USD	753.850,89	0,54
550.000	ABQ FINANCE 3.125% 24/09/2024 EMTN	USD	547.196,11	0,39	400.000	CHINA HUANENG GROUP HONG KONG TREASURY MANAGEMENT HOLDING LTD FRN PERP	USD	391.773,32	0,28
1.400.000	AGILE GROUP HOLDINGS LTD FRN PERP	USD	280.357,04	0,20	850.000	CNRC CAPITALE LTD FRN PERP	USD	850.775,18	0,62
550.000	ALDAR SUKUK NO 2 LTD 3.875% 22/10/2029	USD	552.582,77	0,39	525.000	DIANJIAN INTERNATIONAL FINANCE LTD FRN PERP	USD	530.571,58	0,38
350.000	CENTRAL CHINA REAL ESTATE LTD 7.750% 24/05/2024	USD	156.686,67	0,11	800.000	EASY TACTIC LTD 8.625% 27/02/2024	USD	161.400,94	0,11
200.000	CHINA AOYUAN GROUP LTD ZCP 21/06/2024	USD	33.496,24	0,02	400.000	ELECT GLOBAL INVESTMENTS LTD FRN PERP	USD	382.610,05	0,27
200.000	CHINA AOYUAN GROUP LTD 5.880% 01/03/2027	USD	31.907,31	0,02	550.000	FORTUNE STAR BVI LTD 5.950% 19/10/2025	USD	503.907,29	0,36
200.000	CHINA HONGQIAO GROUP LTD 7.125% 22/07/2022	USD	199.217,64	0,14	400.000	HUARONG UNIVERSE INVESTMENT HOLDING LTD 1.625% 05/12/2022	EUR	414.811,30	0,30
200.000	CHINA HONGQIAO GROUP LTD 7.375% 02/05/2023	USD	197.180,62	0,14	450.000	LEADER GOAL INTERNATIONAL LTD FRN PERP EMTN	USD	453.041,77	0,32
500.000	CHINA SCE GROUP HOLDINGS LTD 7.000% 02/05/2025	USD	262.433,57	0,19	500.000	MIDEA INVESTMENT DEVELOPMENT CO LTD 2.880% 24/02/2027	USD	480.752,33	0,34
1.300.000	DP WORLD SALAAM FRN PERP	USD	1.343.905,67	0,96	600.000	NEW METRO GLOBAL LTD 4.625% 15/10/2025	USD	386.297,81	0,27
824.000	EMAAR SUKUK LTD 3.875% 17/09/2029 EMTN	USD	822.125,66	0,58	550.000	NWD FINANCE (BVI) LTD FRN PERP	USD	497.750,00	0,35
200.000	FANTASIA HOLDINGS GROUP CO LTD 11.875% 01/06/2023	USD	28.708,61	0,02	500.000	POWERCHINA ROADBRIDGE GROUP BRITISH VIRGIN ISLANDS LTD FRN PERP	USD	484.961,92	0,34
1.300.000	GRAN TIERRA ENERGY INTERNATIONAL HOLDINGS LTD 6.250% 15/02/2025	USD	1.204.511,75	0,86	419.350	STAR ENERGY GEOTHERMAL WAYANG WINDU LTD 6.750% 24/04/2033	USD	442.388,34	0,31
258.000	HILONG HOLDING LTD 9.750% 18/11/2024	USD	159.725,53	0,11	200.000	STUDIO CITY CO LTD 7.000% 15/02/2027	USD	190.081,98	0,14
500.000	INDUSTRIAL SENIOR TRUST 5.500% 01/11/2022	USD	502.312,47	0,36				<b>7.121.028,71</b>	<b>5,07</b>
1.000.000	LINK FINANCE CAYMAN 2009 2.750% 19/01/2032 EMTN	USD	936.856,23	0,67	<b>Mexiko</b>				
440.285	ODEBRECHT OIL & GAS FINANCE LTD ZCP PERP	USD	2.069,72	0,00	770.000	BANCO MERCANTIL DEL NORTE SA/GRAND CAYMAN FRN PERP	USD	753.781,46	0,54
200.000	REDSUN PROPERTIES GROUP LTD 7.300% 13/01/2025	USD	30.368,44	0,02	1.200.000	BBVA BANCOMER SA/TEXAS 18/01/2033 FRN	USD	1.131.620,22	0,80
200.000	REDSUN PROPERTIES GROUP LTD 9.500% 20/09/2023	USD	30.513,97	0,02	1.335.000	CIBANCO SA INSTITUCION DE BANCA MULTIPLE TRUST CIB/3332 4.375% 22/07/2031	USD	1.111.969,76	0,79
700.000	SANDS CHINA LTD 4.375% 18/06/2030	USD	636.610,09	0,45	572.005	FERMACA ENTERPRISES S DE RL DE CV 6.375% 30/03/2038	USD	543.753,73	0,39
750.000	SANDS CHINA LTD 5.400% 08/08/2028	USD	738.464,72	0,53	1.700.000	GRUPO KUO SAB DE CV 5.750% 07/07/2027	USD	1.678.442,32	1,19
600.000	TENCENT HOLDINGS LTD 3.925% 19/01/2038 EMTN	USD	557.334,45	0,40	600.000	PETROLEOS MEXICANOS 5.950% 28/01/2031	USD	554.148,61	0,39
721.000	WEIBO CORP 1.250% 15/11/2022	USD	699.301,59	0,50	1.235.000	TRUST FIBRA UNO 6.390% 15/01/2050	USD	1.244.696,10	0,89
1.450.000	WELL HOPE DEVELOPMENT LTD FRN PERP	USD	1.453.609,40	1,04				<b>7.018.412,20</b>	<b>4,99</b>
400.000	YUZHOU GROUP HOLDINGS CO LTD FRN PERP	USD	28.334,73	0,02	<b>Luxemburg</b>				
450.000	YUZHOU GROUP HOLDINGS CO LTD 8.300% 27/05/2025	USD	59.014,61	0,04	1.090.000	ACU PETROLEO LUXEMBOURG SARL 7.500% 13/01/2032	USD	1.007.522,78	0,72
300.000	ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD 6.630% 07/01/2026	USD	33.013,21	0,02	765.000	AEGEA FINANCE SARL 5.750% 10/10/2024	USD	770.784,21	0,55
250.000	ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD 7.100% 10/09/2024	USD	27.800,67	0,02	2.000.000	FS LUXEMBOURG SARL 10.000% 15/12/2025	USD	2.100.252,74	1,48
			<b>11.959.919,66</b>	<b>8,51</b>	2.000.000	MEXICO REMITTANCES FUNDING FIDUCIARY ESTATE MANAGEMENT SARL 4.875% 15/01/2028	USD	1.577.742,08	1,12
<b>Thailand</b>					600.000	MILICOM INTERNATIONAL CELLULAR SA 4.500% 27/04/2031	USD	558.818,10	0,40
500.000	BANGKOK BANK PCL/HONG KONG FRN PERP EMTN	USD	488.429,41	0,35	838.000	MILICOM INTERNATIONAL CELLULAR SA 4.500% 27/04/2031	USD	780.482,61	0,56
1.000.000	BANGKOK BANK PCL/HONG KONG FRN PERP EMTN	USD	976.858,81	0,69				<b>6.795.602,52</b>	<b>4,83</b>
900.000	BANGKOK BANK PCL/HONG KONG 25/09/2034 FRN EMTN	USD	838.908,04	0,60	<b>Südkorea</b>				
200.000	GC TREASURY CENTER CO LTD 4.400% 30/03/2032 EMTN	USD	203.994,49	0,15	1.650.000	HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD FRN PERP	USD	1.667.852,06	1,18
700.000	INDORAMA VENTURES GLOBAL SERVICES LTD 4.375% 12/09/2024 EMTN	USD	688.438,74	0,49	1.450.000	HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD 04/02/2032 FRN	USD	1.385.892,21	0,99
350.000	KASIKORN BANK PCL/HONG KONG FRN PERP EMTN	USD	341.613,12	0,24	1.300.000	HEUNGKUK LIFE INSURANCE CO LTD FRN PERP	USD	1.293.500,00	0,92
300.000	KASIKORN BANK PCL/HONG KONG 02/10/2031 FRN EMTN	USD	283.563,89	0,20	1.050.000	KYOBO LIFE INSURANCE CO LTD FRN PERP	USD	1.050.953,65	0,75
1.250.000	KRUNG THAI BANK PCL/CAYMAN ISLANDS FRN PERP	USD	1.156.514,03	0,82	900.000	TONGYANG LIFE INSURANCE CO FRN PERP	USD	903.608,12	0,64
300.000	MINOR INTERNATIONAL PCL FRN PERP	USD	297.941,75	0,21				<b>6.301.806,04</b>	<b>4,48</b>
1.600.000	MINOR INTERNATIONAL PCL FRN PERP	USD	1.501.915,12	1,07	<b>Vereinigtes Königreich</b>				
400.000	THAI OIL TREASURY CENTER CO LTD 5.375% 20/11/2048 EMTN	USD	394.783,23	0,28	1.789.000	ENDEAVOUR MINING PLC 5.000% 14/10/2026	USD	1.640.287,66	1,17
					2.009.276	PETRA DIAMONDS US TREASURY PLC 10.500% 08/03/2026	USD	2.096.893,72	1,50
					400.000	STATE GRID EUROPE DEVELOPMENT 3.250% 07/04/2027	USD	398.552,60	0,28

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Emerging Markets Corporate Debt

(ausgedrückt in USD)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW	Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW
810.000	TULLOW OIL PLC 10.250% 15/05/2026	USD	821.444,49	0,58	800.000	CMB WING LUNG BANK LTD 22/11/2027 FRN EMTN	USD	800.573,10	0,57
1.050.000	TULLOW OIL PLC 7.000% 01/03/2025	USD	875.043,06	0,62	1.000.000	FAR EAST HORIZON LTD FRN PERP EMTN	USD	983.805,84	0,70
1.207.000	UKRAINE RAILWAYS VIA RAIL CAPITAL MARKETS PLC 7.875% 15/07/2026	USD	340.400,41	0,24	700.000	NANYANG COMMERCIAL BANK LTD 20/11/2029 FRN	USD	691.553,00	0,49
			<b>6.172.621,94</b>	<b>4,39</b>	750.000	SHANGHAI COMMERCIAL BANK LTD 17/01/2029 FRN	USD	759.933,94	0,54
	<b>Vereinigte Staaten</b>							<b>3.816.129,61</b>	<b>2,71</b>
2.426.000	KOSMOS ENERGY LTD 7.125% 04/04/2026	USD	2.383.062,40	1,70		<b>Vereinigte Arabische Emirate</b>			
1.400.000	MERCURY CHILE HOLDCO LLC 6.500% 24/01/2027	USD	1.340.299,58	0,95	1.050.000	EMIRATES NBD BANK PJSC FRN PERP	USD	1.059.571,88	0,75
500.000	NBM US HOLDINGS INC 6.625% 06/08/2029	USD	525.601,65	0,37	1.500.000	EMIRATES NBD BANK PJSC FRN PERP	USD	1.527.786,75	1,09
500.000	RESORTS WORLD LAS VEGAS LLC / RWLV CAPITAL INC 4.625% 16/04/2029	USD	452.986,27	0,32	1.065.000	NBK TIER 1 LTD FRN PERP	USD	995.290,79	0,71
1.500.000	STILLWATER MINING CO 4.000% 16/11/2026	USD	1.441.935,24	1,03				<b>3.582.649,42</b>	<b>2,55</b>
			<b>6.143.885,14</b>	<b>4,37</b>		<b>Türkei</b>			
	<b>Niederlande</b>				600.000	AKBANK TAS 5.000% 24/10/2022	USD	602.864,50	0,43
2.800.000	IHS NETHERLANDS HOLDCO BV 8.000% 18/09/2027	USD	2.814.104,19	2,00	600.000	AKBANK TAS 5.125% 31/03/2025 EMTN	USD	569.633,41	0,41
565.000	METINVEST BV 7.650% 01/10/2027	USD	250.758,65	0,18	1.115.000	AYDEM YENILENBILIR ENERJI AS 7.750% 02/02/2027	USD	892.154,53	0,63
1.300.000	METINVEST BV 7.750% 17/10/2029	USD	576.958,56	0,41	1.220.000	PEGASUS HAVA TASIMACILIGI AS 9.250% 30/04/2026	USD	1.197.851,63	0,85
1.400.000	MINEJESA CAPITAL BV 5.625% 10/08/2037	USD	1.274.709,81	0,91				<b>3.262.504,07</b>	<b>2,32</b>
1.094.000	VIVO ENERGY INVESTMENTS BV 5.125% 24/09/2027	USD	1.084.609,94	0,77		<b>Israel</b>			
			<b>6.001.141,15</b>	<b>4,27</b>	1.750.000	BANK HAPOALIM BM 21/01/2032 FRN	USD	1.615.719,74	1,15
	<b>Kolumbien</b>				1.350.000	ENERGEAN ISRAEL FINANCE LTD 4.500% 30/03/2024	USD	1.339.935,32	0,95
1.350.000	BANCO DE BOGOTA SA 6.250% 12/05/2026	USD	1.378.169,33	0,98				<b>2.955.655,06</b>	<b>2,10</b>
2.000.000	BANCOLOMBIA SA 18/10/2027 FRN	USD	1.985.199,58	1,41		<b>Dominikanische Republik</b>			
1.000.000	BANCOLOMBIA SA 3.000% 29/01/2025	USD	971.500,68	0,69	2.275.000	AEROPUERTOS DOMINICANOS SIGLO XXI SA 6.750% 30/03/2029	USD	2.198.743,27	1,57
1.350.000	GRUPOSURA FINANCE SA 5.500% 29/04/2026	USD	1.363.396,89	0,97	475.000	EMPRESA GENERADORA DE ELECTRICIDAD HAINA SA 5.625% 08/11/2028	USD	440.696,88	0,31
			<b>5.698.266,48</b>	<b>4,05</b>				<b>2.639.440,15</b>	<b>1,88</b>
	<b>Indien</b>					<b>Mauritius</b>			
1.700.000	ADANI ELECTRICITY MUMBAI LTD 3.949% 12/02/2030	USD	1.545.330,63	1,09	450.000	GREENKO INVESTMENT CO 4.875% 16/08/2023	USD	450.060,15	0,32
550.000	ADANI GREEN ENERGY LTD 4.375% 08/09/2024	USD	538.254,17	0,38	500.000	GREENKO SOLAR MAURITIUS LTD 5.950% 29/07/2026	USD	506.746,85	0,36
1.400.000	BHARTI AIRTEL LTD 3.250% 03/06/2031	USD	1.291.984,86	0,92	995.000	HTA GROUP LTD 7.000% 18/12/2025	USD	987.100,88	0,70
900.000	INDIAN RAILWAY FINANCE CORP LTD 3.570% 21/01/2032 EMTN	USD	853.578,40	0,61	500.000	UPL CORP LTD FRN PERP	USD	463.004,58	0,33
482.500	JSW HYDRO ENERGY LTD 4.125% 18/05/2031	USD	452.239,58	0,32	200.000	UPL CORP LTD 4.625% 16/06/2030	USD	189.893,00	0,14
500.000	JSW STEEL LTD 5.050% 05/04/2032	USD	461.814,60	0,33				<b>2.596.805,46</b>	<b>1,85</b>
200.000	SHRIRAM TRANSPORT FINANCE CO LTD 4.150% 18/07/2025 EMTN	USD	190.573,81	0,14		<b>Argentinien</b>			
			<b>5.333.776,05</b>	<b>3,79</b>	700.000	TELECOM ARGENTINA SA 8.000% 18/07/2026	USD	663.421,99	0,47
	<b>Kanada</b>				650.000	TRANSPORTADORA DE GAS DEL SUR SA 6.750% 02/05/2025	USD	591.500,00	0,42
1.520.000	CANACOL ENERGY LTD 5.750% 24/11/2028	USD	1.416.125,59	1,01	900.000	YPF SA 8.500% 28/07/2025	USD	769.376,52	0,55
2.600.000	FIRST QUANTUM MINERALS LTD 7.500% 01/04/2025	USD	2.642.613,97	1,88				<b>2.024.298,51</b>	<b>1,44</b>
1.300.000	FRONTERA ENERGY CORP 7.875% 21/06/2028	USD	1.215.750,33	0,86		<b>Jersey</b>			
			<b>5.274.489,89</b>	<b>3,75</b>	958.978	GALAXY PIPELINE ASSETS BIDCO LTD 2.160% 31/03/2034	USD	883.622,03	0,63
	<b>Supranational-Multinational</b>				1.200.000	GALAXY PIPELINE ASSETS BIDCO LTD 2.625% 31/03/2036	USD	1.076.523,60	0,76
1.250.000	AFRICAN EXPORT-IMPORT BANK/THE 4.125% 20/06/2024 EMTN	USD	1.246.915,39	0,89				<b>1.960.145,63</b>	<b>1,39</b>
1.450.000	ATP TOWER HOLDINGS LLC / ANDEAN TOWER PARTNERS COLOMBIA SAS / ANDEAN TELECOM PAR 4.050% 27/04/2026	USD	1.383.396,50	0,97		<b>Insel Man</b>			
865.000	BANQUE OUEST AFRICAINE DE DEVELOPPEMENT 4.700% 22/10/2031	USD	853.938,11	0,61	700.000	ANGLOGOLD ASHANTI HOLDINGS PLC 6.500% 15/04/2040	USD	769.489,87	0,55
900.000	BLACK SEA TRADE & DEVELOPMENT BANK 3.500% 25/06/2024	USD	810.786,17	0,58	800.000	GOHL CAPITAL LTD 4.250% 24/01/2027	USD	753.333,19	0,53
			<b>4.295.036,17</b>	<b>3,05</b>				<b>1.522.823,06</b>	<b>1,08</b>
	<b>Hongkong</b>					<b>Singapur</b>			
300.000	BANK OF COMMUNICATION HK 08/07/2031 FRN	USD	280.888,63	0,20	400.000	GLOBAL PRIME CAPITAL PTE LTD 5.950% 23/01/2025	USD	386.523,71	0,27
300.000	CHONG HING BANK LTD 26/07/2027 FRN	USD	299.375,10	0,21					

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Emerging Markets Corporate Debt

(ausgedrückt in USD)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW
485.000	LMIRT CAPITAL PTE LTD 7.250% 19/06/2024	USD	483.029,58	0,34
300.000	LMIRT CAPITAL PTE LTD 7.500% 09/02/2026	USD	294.560,56	0,21
671.201	MODERNLAND OVERSEAS PTE LTD 3.000% 30/04/2027	USD	305.630,93	0,23
			<b>1.469.744,78</b>	<b>1,05</b>
<b>Spanien</b>				
1.444.000	AI CANDELARIA SPAIN SA 7.500% 15/12/2028	USD	1.418.274,39	1,01
			<b>1.418.274,39</b>	<b>1,01</b>
<b>Peru</b>				
1.416.176	FENIX POWER PERU SA 4.317% 20/09/2027	USD	1.382.562,99	0,98
			<b>1.382.562,99</b>	<b>0,98</b>
<b>Chile</b>				
1.250.000	TELEFONICA MOVILES CHILE SA 3.537% 18/11/2031	USD	1.165.949,85	0,83
			<b>1.165.949,85</b>	<b>0,83</b>
<b>China</b>				
1.150.000	CHINA MINMETALS CORP FRN PERP	USD	1.153.148,98	0,82
			<b>1.153.148,98</b>	<b>0,82</b>
<b>Brasilien</b>				
1.100.000	OI MOVEL SA 8.750% 30/07/2026	USD	1.120.831,45	0,80
			<b>1.120.831,45</b>	<b>0,80</b>
<b>Nigeria</b>				
1.100.000	SEPLAT ENERGY PLC 7.750% 01/04/2026	USD	1.053.636,10	0,75
			<b>1.053.636,10</b>	<b>0,75</b>
<b>Bahamas</b>				
1.110.000	INTERCORP PERU LTD 3.875% 15/08/2029	USD	1.007.858,83	0,72
			<b>1.007.858,83</b>	<b>0,72</b>
<b>Paraguay</b>				
1.035.000	BANCO CONTINENTAL SAECA 2.750% 10/12/2025	USD	947.828,11	0,67
			<b>947.828,11</b>	<b>0,67</b>
<b>Philippinen</b>				
500.000	GLOBE TELECOM INC 3.000% 23/07/2035	USD	402.866,82	0,29
550.000	SMC GLOBAL POWER HOLDINGS CORP FRN PERP	USD	533.182,45	0,38
			<b>936.049,27</b>	<b>0,67</b>
<b>Panama</b>				
920.000	BANCO GENERAL SA 4.125% 07/08/2027	USD	935.273,32	0,67
			<b>935.273,32</b>	<b>0,67</b>
<b>Georgien</b>				
900.000	TBC BANK JSC 5.750% 19/06/2024 EMTN	USD	928.428,73	0,66
			<b>928.428,73</b>	<b>0,66</b>
<b>Kuwait</b>				
850.000	AL AHLI BANK OF KUWAIT KSCP FRN PERP	USD	865.167,86	0,62
			<b>865.167,86</b>	<b>0,62</b>
<b>Trinidad und Tobago</b>				
750.000	TELECOMMUNICATIONS SERVICES OF TRINIDAD & TOBAGO LTD 8.875% 18/10/2029	USD	754.271,35	0,54
			<b>754.271,35</b>	<b>0,54</b>

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW
<b>Indonesien</b>				
500.000	ALAM SUTERA REALTY TBK 8.250% 02/11/2025	USD	342.212,70	0,24
350.000	BANK NEGARA INDONESIA PERSERO TBK PT 3.750% 30/03/2026 EMTN	USD	333.033,17	0,24
			<b>675.245,87</b>	<b>0,48</b>
<b>Malaysia</b>				
600.000	MISC CAPITAL TWO LABUAN LTD 3.625% 06/04/2025 EMTN	USD	600.135,60	0,43
			<b>600.135,60</b>	<b>0,43</b>
<b>Irland</b>				
1.060.000	CREDIT BANK OF MOSCOW 3.875% 21/09/2026	USD	116.600,00	0,08
2.100.000	SOVCOMBANK VIA SOVCOM CAPITAL DAC 07/04/2030 FRN	USD	105.000,00	0,08
			<b>221.600,00</b>	<b>0,16</b>
			<b>127.812.896,45</b>	<b>90,92</b>

### Wertpapierbestand Gesamt

**127.812.896,45 90,92**

### Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022

Zu erhalten	Zu zahlen	Fälligkeits- datum	Engagement in USD	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in USD
<b>Devisentermingeschäfte</b>				
332,21	EUR	370,90 USD	04/04/2022	370,90 (1,27)
2.047,87	USD	1.844,51 EUR	01/04/2022	2.047,87 (4,42)
518.509,88	USD	468.000,00 EUR	30/06/2022	518.509,88 (4.062,92)
1.512.770,24	USD	1.362.757,66 EUR	19/04/2022	1.512.770,24 (4.160,69)
28.477.713,19	EUR	31.785.443,32 USD	19/04/2022	31.785.443,32 (85.952,37)
			<b>33.819.142,21</b>	<b>(94.181,67)</b>
<b>Zins-Futures</b>				
15	US LONG BOND (CBT)	21/06/2022	USD	2.250.937,50 (63.515,62)
21	US ULTRA BOND (CBT)	21/06/2022	USD	3.719.625,00 (137.156,25)
70	US 10YR NOTE (CBT)	21/06/2022	USD	8.601.250,00 (233.756,25)
30	US 10YR ULTRA FUTURE	21/06/2022	USD	4.064.062,50 (125.156,25)
(12)	US 5YR NOTE (CBT)	30/06/2022	USD	1.376.250,00 23.554,69
			<b>20.012.125,00</b>	<b>(536.029,68)</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>				<b>(630.211,35)</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Emerging Markets Corporate Debt

(ausgedrückt in USD)

### Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick

		% NIW
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	127.812.896,45	90,92
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	(630.211,35)	(0,45)
<b>Bankguthaben</b>	10.088.020,37	7,18
<b>Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>	3.314.006,59	2,35
<b>Nettovermögen Gesamt</b>	140.584.712,06	100,00

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Emerging Markets Debt (Hard Currency)

(ausgedrückt in USD)

### Statistische Angaben

<b>Nettovermögen</b>	31.03.2022	USD	5.674.739.097,00	Capitalisation X Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	EUR	4.464,26
	30.09.2021	USD	7.033.973.351,64		30.09.2021	EUR	5.068,74
	30.09.2020	USD	6.335.652.684,61		30.09.2020	EUR	4.909,09
<b>Nettoinventarwert pro Anteil**</b>				Capitalisation Y (USD)	31.03.2022	USD	298,64
	31.03.2022	USD	8.018,19		30.09.2021	USD	338,06
	30.09.2021	USD	8.990,21		30.09.2020	USD	327,41
Capitalisation I (USD)	31.03.2022	USD	8.018,19	Capitalisation Y Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	EUR	258,15
	30.09.2021	USD	8.990,21		30.09.2021	EUR	294,65
	30.09.2020	USD	8.541,66		30.09.2020	EUR	288,27
Capitalisation I Hedged (i) (CHF)	31.03.2022	CHF	5.421,23	Capitalisation Z Hedged (EUR)	31.03.2022	EUR	-
	30.09.2021	CHF	6.125,26		30.09.2021	EUR	-
	30.09.2020	CHF	5.894,85		30.09.2020	EUR	6.115,64
Capitalisation I Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	EUR	5.279,40	Capitalisation Zz Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	EUR	5.081,36
	30.09.2021	EUR	5.966,83		30.09.2021	EUR	5.718,57
	30.09.2020	EUR	5.730,68		30.09.2020	EUR	5.443,74
Capitalisation N (USD)	31.03.2022	USD	380,15	Distribution I Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	EUR	2.498,61
	30.09.2021	USD	426,27		30.09.2021	EUR	2.936,51
	30.09.2020	USD	405,07		30.09.2020	EUR	2.940,42
Capitalisation N Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	EUR	4.984,46	Distribution I (M) (USD)	31.03.2022	USD	4.413,69
	30.09.2021	EUR	5.633,97		30.09.2021	USD	5.060,65
	30.09.2020	EUR	5.408,33		30.09.2020	USD	5.008,41
Capitalisation O Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	EUR	4.886,59	Distribution I (M) Hedged (i) (PLN)	31.03.2022	PLN	16.653,90
	30.09.2021	EUR	5.519,91		30.09.2021	PLN	19.032,60
	30.09.2020	EUR	5.286,83		30.09.2020	PLN	18.944,62
Capitalisation P (USD)	31.03.2022	USD	361,48	Distribution I (Q) Hedged (i) (GBP)	31.03.2022	GBP	82,34
	30.09.2021	USD	406,54		30.09.2021	GBP	94,32
	30.09.2020	USD	388,63		30.09.2020	GBP	93,69
Capitalisation P Hedged (i) (CHF)	31.03.2022	CHF	248,24	Distribution N Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	EUR	806,52
	30.09.2021	CHF	281,35		30.09.2021	EUR	947,79
	30.09.2020	CHF	272,23		30.09.2020	EUR	949,24
Capitalisation P Hedged (i) (CZK)	31.03.2022	CZK	5.990,97	Distribution N (Q) (USD)	31.03.2022	USD	2.235,11
	30.09.2021	CZK	6.691,03		30.09.2021	USD	2.552,03
	30.09.2020	CZK	6.433,82		30.09.2020	USD	2.524,76
Capitalisation P Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	EUR	4.724,64	Distribution O Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	EUR	805,59
	30.09.2021	EUR	5.356,46		30.09.2021	EUR	947,90
	30.09.2020	EUR	5.172,92		30.09.2020	EUR	949,29
Capitalisation R (USD)	31.03.2022	USD	368,68	Distribution O (Q) (USD)	31.03.2022	USD	2.247,98
	30.09.2021	USD	413,64		30.09.2021	USD	2.566,82
	30.09.2020	USD	393,55		30.09.2020	USD	2.539,50
Capitalisation X (HUF)	31.03.2022	HUF	107.273,39	Distribution P Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	EUR	805,30
	30.09.2021	HUF	113.464,72		30.09.2021	EUR	943,24
	30.09.2020	HUF	108.711,38		30.09.2020	EUR	944,65
Capitalisation X (USD)	31.03.2022	USD	342,57				
	30.09.2021	USD	385,85				
	30.09.2020	USD	369,97				

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

## NN (L) Emerging Markets Debt (Hard Currency)

(ausgedrückt in USD)

### Statistische Angaben (Fortsetzung)

Distribution P (Q) (USD)	31.03.2022	USD	2.215,71	<b>Anzahl der Anteile</b>	Capitalisation N (USD)	31.03.2022	4.642
	30.09.2021	USD	2.529,69			30.09.2021	5.186
	30.09.2020	USD	2.502,76			30.09.2020	5.965
Distribution R (Q) (USD)	31.03.2022	USD	2.239,19	Capitalisation N Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	1.313	
	30.09.2021	USD	2.556,87		30.09.2021	1.407	
	30.09.2020	USD	2.530,28		30.09.2020	1.428	
Distribution X (USD)	31.03.2022	USD	941,13	Capitalisation O Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	89	
	30.09.2021	USD	1.091,30		30.09.2021	96	
	30.09.2020	USD	1.081,90		30.09.2020	162	
Distribution X (M) (USD)	31.03.2022	USD	64,98	Capitalisation P (USD)	31.03.2022	27.155	
	30.09.2021	USD	77,43		30.09.2021	32.132	
	30.09.2020	USD	82,13		30.09.2020	59.466	
Distribution X (M) Hedged (i) (AUD)	31.03.2022	AUD	143,79	Capitalisation P Hedged (i) (CHF)	31.03.2022	981	
	30.09.2021	AUD	171,95		30.09.2021	981	
	30.09.2020	AUD	183,16		30.09.2020	1.281	
Distribution X (M) Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	EUR	188,49	Capitalisation P Hedged (i) (CZK)	31.03.2022	8.871	
	30.09.2021	EUR	217,33		30.09.2021	8.762	
	30.09.2020	EUR	217,57		30.09.2020	5.200	
Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR)	31.03.2022	ZAR	1.620,87	Capitalisation P Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	7.449	
	30.09.2021	ZAR	1.982,83		30.09.2021	9.017	
	30.09.2020	ZAR	2.197,23		30.09.2020	10.543	
Distribution Y (M) (USD)	31.03.2022	USD	139,03	Capitalisation R (USD)	31.03.2022	1.512	
	30.09.2021	USD	166,52		30.09.2021	1.998	
	30.09.2020	USD	178,41		30.09.2020	1.074	
Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD)	31.03.2022	AUD	125,39	Capitalisation X (HUF)	31.03.2022	1.740	
	30.09.2021	AUD	150,86		30.09.2021	2.239	
	30.09.2020	AUD	162,57		30.09.2020	2.549	
Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR)	31.03.2022	ZAR	1.495,50	Capitalisation X (USD)	31.03.2022	82.266	
	30.09.2021	ZAR	1.840,08		30.09.2021	93.901	
	30.09.2020	ZAR	2.060,77		30.09.2020	185.281	
Distribution Z (Q) Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	EUR	4.167,92	Capitalisation X Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	4.230	
	30.09.2021	EUR	4.777,63		30.09.2021	5.295	
	30.09.2020	EUR	4.738,89		30.09.2020	6.365	
<b>Anzahl der Anteile</b>							
Capitalisation I (USD)	31.03.2022		14.183	Capitalisation Y (USD)	31.03.2022	100.364	
	30.09.2021		14.679		30.09.2021	126.346	
	30.09.2020		21.346		30.09.2020	201.778	
Capitalisation I Hedged (i) (CHF)	31.03.2022		75	Capitalisation Y Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	11.948	
	30.09.2021		64		30.09.2021	16.077	
	30.09.2020		38		30.09.2020	29.552	
Capitalisation I Hedged (i) (EUR)	31.03.2022		56.175	Capitalisation Z Hedged (EUR)	31.03.2022	-	
	30.09.2021		54.870		30.09.2021	-	
	30.09.2020		57.650		30.09.2020	1.267	

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

## NN (L) Emerging Markets Debt (Hard Currency)

(ausgedrückt in USD)

### Statistische Angaben (Fortsetzung)

#### Anzahl der Anteile

Capitalisation Zz Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	30.551
	30.09.2021	27.289
	30.09.2020	15.538
Distribution I Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	50.802
	30.09.2021	52.639
	30.09.2020	55.177
Distribution I (M) (USD)	31.03.2022	755
	30.09.2021	824
	30.09.2020	928
Distribution I (M) Hedged (i) (PLN)	31.03.2022	6.367
	30.09.2021	12.299
	30.09.2020	7.185
Distribution I (Q) Hedged (i) (GBP)	31.03.2022	6.034
	30.09.2021	1.208
	30.09.2020	362
Distribution N Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	35.802
	30.09.2021	33.194
	30.09.2020	25.311
Distribution N (Q) (USD)	31.03.2022	472
	30.09.2021	715
	30.09.2020	742
Distribution O Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	2.617
	30.09.2021	2.932
	30.09.2020	3.847
Distribution O (Q) (USD)	31.03.2022	102
	30.09.2021	139
	30.09.2020	139
Distribution P Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	21.631
	30.09.2021	25.787
	30.09.2020	34.175
Distribution P (Q) (USD)	31.03.2022	2.543
	30.09.2021	3.127
	30.09.2020	5.820
Distribution R (Q) (USD)	31.03.2022	32
	30.09.2021	32
	30.09.2020	208
Distribution X (USD)	31.03.2022	5.729
	30.09.2021	6.593
	30.09.2020	7.597
Distribution X (M) (USD)	31.03.2022	14.880.636
	30.09.2021	16.225.500
	30.09.2020	13.060.242

#### Anzahl der Anteile

Distribution X (M) Hedged (i) (AUD)	31.03.2022	1.455.583
	30.09.2021	1.622.193
	30.09.2020	1.730.004
Distribution X (M) Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	15.401
	30.09.2021	19.287
	30.09.2020	30.263
Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR)	31.03.2022	9.627.991
	30.09.2021	9.130.257
	30.09.2020	4.680.625
Distribution Y (M) (USD)	31.03.2022	3.517.536
	30.09.2021	4.353.499
	30.09.2020	5.279.109
Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD)	31.03.2022	672.813
	30.09.2021	845.784
	30.09.2020	1.155.673
Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR)	31.03.2022	3.424.611
	30.09.2021	3.552.254
	30.09.2020	3.437.216
Distribution Z (Q) Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	340.250
	30.09.2021	342.210
	30.09.2020	291.921

#### Dividende

Distribution I Hedged (i) (EUR)	14.12.2021	EUR	109,05
Distribution I (M) (USD)	02.03.2022	USD	18,04
Distribution I (M) (USD)	02.02.2022	USD	18,04
Distribution I (M) (USD)	04.01.2022	USD	18,04
Distribution I (M) (USD)	02.12.2021	USD	17,89
Distribution I (M) (USD)	02.11.2021	USD	17,89
Distribution I (M) (USD)	04.10.2021	USD	17,89
Distribution I (M) Hedged (i) (PLN)	02.03.2022	PLN	59,23
Distribution I (M) Hedged (i) (PLN)	02.02.2022	PLN	59,23
Distribution I (M) Hedged (i) (PLN)	04.01.2022	PLN	59,23
Distribution I (M) Hedged (i) (PLN)	02.12.2021	PLN	62,75
Distribution I (M) Hedged (i) (PLN)	02.11.2021	PLN	62,75

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.



## NN (L) Emerging Markets Debt (Hard Currency)

(ausgedrückt in USD)

### Statistische Angaben (Fortsetzung)

Distribution I (M) Hedged (i) (PLN)	04.10.2021	PLN	62,75	Distribution X (M) Hedged (i) (EUR)	02.02.2022	EUR	0,51
Distribution I (Q) Hedged (i) (GBP)	11.02.2022	GBP	0,79	Distribution X (M) Hedged (i) (EUR)	04.01.2022	EUR	0,51
Distribution I (Q) Hedged (i) (GBP)	11.11.2021	GBP	0,85	Distribution X (M) Hedged (i) (EUR)	02.12.2021	EUR	0,55
Distribution N Hedged (i) (EUR)	14.12.2021	EUR	35,05	Distribution X (M) Hedged (i) (EUR)	02.11.2021	EUR	0,55
Distribution N (Q) (USD)	11.02.2022	USD	21,49	Distribution X (M) Hedged (i) (EUR)	04.10.2021	EUR	0,55
Distribution N (Q) (USD)	11.11.2021	USD	22,90	Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR)	02.03.2022	ZAR	31,70
Distribution O Hedged (i) (EUR)	14.12.2021	EUR	37,30	Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR)	02.02.2022	ZAR	31,70
Distribution O (Q) (USD)	11.02.2022	USD	23,13	Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR)	04.01.2022	ZAR	31,70
Distribution O (Q) (USD)	11.11.2021	USD	24,60	Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR)	02.12.2021	ZAR	31,70
Distribution P Hedged (i) (EUR)	14.12.2021	EUR	29,20	Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR)	02.11.2021	ZAR	31,70
Distribution P (Q) (USD)	11.02.2022	USD	17,63	Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR)	04.10.2021	ZAR	31,70
Distribution P (Q) (USD)	11.11.2021	USD	18,95	Distribution Y (M) (USD)	02.03.2022	USD	1,46
Distribution R (Q) (USD)	11.02.2022	USD	20,88	Distribution Y (M) (USD)	02.02.2022	USD	1,46
Distribution R (Q) (USD)	11.11.2021	USD	22,25	Distribution Y (M) (USD)	04.01.2022	USD	1,46
Distribution X (USD)	14.12.2021	USD	30,75	Distribution Y (M) (USD)	02.12.2021	USD	1,46
Distribution X (M) (USD)	02.03.2022	USD	0,68	Distribution Y (M) (USD)	02.11.2021	USD	1,46
Distribution X (M) (USD)	02.02.2022	USD	0,68	Distribution Y (M) (USD)	04.10.2021	USD	1,46
Distribution X (M) (USD)	04.01.2022	USD	0,68	Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD)	02.03.2022	AUD	1,33
Distribution X (M) (USD)	02.12.2021	USD	0,68	Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD)	02.02.2022	AUD	1,33
Distribution X (M) (USD)	02.11.2021	USD	0,68	Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD)	04.01.2022	AUD	1,33
Distribution X (M) (USD)	04.10.2021	USD	0,68	Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD)	02.12.2021	AUD	1,33
Distribution X (M) Hedged (i) (AUD)	02.03.2022	AUD	1,50	Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD)	02.11.2021	AUD	1,33
Distribution X (M) Hedged (i) (AUD)	02.02.2022	AUD	1,50	Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD)	04.10.2021	AUD	1,33
Distribution X (M) Hedged (i) (AUD)	04.01.2022	AUD	1,50	Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR)	02.03.2022	ZAR	29,60
Distribution X (M) Hedged (i) (AUD)	02.12.2021	AUD	1,50	Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR)	02.02.2022	ZAR	29,60
Distribution X (M) Hedged (i) (AUD)	02.11.2021	AUD	1,50	Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR)	04.01.2022	ZAR	29,60
Distribution X (M) Hedged (i) (AUD)	04.10.2021	AUD	1,50	Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR)	02.12.2021	ZAR	29,60
Distribution X (M) Hedged (i) (EUR)	02.03.2022	EUR	0,51	Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR)	02.11.2021	ZAR	29,60

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

## NN (L) Emerging Markets Debt (Hard Currency)

(ausgedrückt in USD)

### Statistische Angaben (Fortsetzung)

Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR)	04.10.2021	ZAR	29,60
Distribution Z (Q) Hedged (i) (EUR)	11.02.2022	EUR	40,16
Distribution Z (Q) Hedged (i) (EUR)	11.11.2021	EUR	42,85

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwilige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

## NN (L) Emerging Markets Debt (Hard Currency)

(ausgedrückt in USD)

### Statistische Angaben (Fortsetzung)

Laufende Kosten in %*			Distribution X (M) (USD)		
Capitalisation I (USD)	31.03.2022	0,89%	Distribution X (M) Hedged (i) (AUD)	31.03.2022	1,83%
Capitalisation I Hedged (i) (CHF)	31.03.2022	0,91%	Distribution X (M) Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	1,83%
Capitalisation I Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	0,91%	Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR)	31.03.2022	1,83%
Capitalisation N (USD)	31.03.2022	0,91%	Distribution Y (M) (USD)	31.03.2022	2,81%
Capitalisation N Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	0,93%	Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD)	31.03.2022	2,83%
Capitalisation O Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	0,69%	Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR)	31.03.2022	2,83%
Capitalisation P (USD)	31.03.2022	1,51%	Distribution Z (Q) Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	0,12%
Capitalisation P Hedged (i) (CHF)	31.03.2022	1,53%	<b>Portfolioumsatz in %*</b>	31.03.2022	(43,15%)
Capitalisation P Hedged (i) (CZK)	31.03.2022	1,53%			
Capitalisation P Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	1,53%			
Capitalisation R (USD)	31.03.2022	1,03%			
Capitalisation X (HUF)	31.03.2022	1,81%			
Capitalisation X (USD)	31.03.2022	1,81%			
Capitalisation X Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	1,83%			
Capitalisation Y (USD)	31.03.2022	2,81%			
Capitalisation Y Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	2,83%			
Capitalisation Zz Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	0,02%			
Distribution I Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	0,91%			
Distribution I (M) (USD)	31.03.2022	0,89%			
Distribution I (M) Hedged (i) (PLN)	31.03.2022	0,91%			
Distribution I (Q) Hedged (i) (GBP)	31.03.2022	0,91%			
Distribution N Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	0,93%			
Distribution N (Q) (USD)	31.03.2022	0,91%			
Distribution O Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	0,69%			
Distribution O (Q) (USD)	31.03.2022	0,67%			
Distribution P Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	1,53%			
Distribution P (Q) (USD)	31.03.2022	1,51%			
Distribution R (Q) (USD)	31.03.2022	1,01%			
Distribution X (USD)	31.03.2022	1,81%			

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

## NN (L) Emerging Markets Debt (Hard Currency)

(ausgedrückt in USD)

### Finanzabschlüsse

#### Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022

	Erläuterungen	
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	2	<b>5.191.067.734,55</b>
Organismen für gemeinsame Anlagen		391.609.636,79
Anleihen und andere Schuldtitel		4.799.458.097,76
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	2	<b>75.589.701,61</b>
Credit Default Swaps		1.449.797,41
Devisentermingeschäfte		71.095.727,96
Futures		3.044.176,24
<b>Bankguthaben</b>		<b>402.582.593,94</b>
<b>Hinterlegte Sicherheiten</b>		<b>12.232.189,47</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte</b>	4, 12	<b>430.876.272,77</b>
<b>Vermögenswerte Gesamt</b>		<b>6.112.348.492,34</b>
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>	4, 12	<b>(437.609.395,34)</b>
<b>Verbindlichkeiten Gesamt</b>		<b>(437.609.395,34)</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Berichtszeitraums</b>		<b>5.674.739.097,00</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

**NN (L) Emerging Markets Debt (Hard Currency)**

*(ausgedrückt in USD)*

**Wertpapierbestand zum 31.03.2022**

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW	Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW
<b>Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>									
<b>Anleihen und andere Schuldtitel</b>									
<b>Mexiko</b>									
8.900.000	CIBANCO SA INSTITUCION DE BANCA MULTIPLE TRUST CIB/3332 4.375% 22/07/2031	USD	7.413.131,74	0,13					
5.300.000	COMISION FEDERAL DE ELECTRICIDAD 4.677% 09/02/2051	USD	4.342.544,24	0,08					
8.500.000	COMISION FEDERAL DE ELECTRICIDAD 4.688% 15/05/2029	USD	8.390.371,59	0,15					
5.000.000	COMISION FEDERAL DE ELECTRICIDAD 6.264% 15/02/2052	USD	4.890.367,95	0,09					
6.000.000	MEXICO CITY AIRPORT TRUST 5.500% 31/07/2047	USD	5.292.291,24	0,09					
1.500.000	MEXICO CITY AIRPORT TRUST 5.500% 31/10/2046	USD	1.326.677,66	0,02					
6.200.000	MEXICO GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.500% 12/02/2034	USD	5.771.038,68	0,10					
21.160.000	MEXICO GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.750% 19/04/2071	USD	16.897.819,07	0,30					
18.900.000	MEXICO GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.771% 24/05/2061	USD	15.311.976,18	0,27					
2.000.000	MEXICO GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.350% 15/01/2047	USD	1.853.656,56	0,03					
6.962.000	MEXICO GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.400% 12/02/2052	USD	6.412.266,21	0,11					
1.300.000	MEXICO GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.500% 31/01/2050	USD	1.228.368,36	0,02					
18.000.000	MEXICO GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.600% 10/02/2048	USD	17.182.340,28	0,30					
3.260.000	MEXICO GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.000% 27/04/2051	USD	3.304.634,55	0,06					
12.800.000	MEXICO GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.750% 12/10/2110 GMTN	USD	13.022.338,82	0,23					
4.500.000	PETROLEOS MEXICANOS 5.500% 27/06/2044	USD	3.389.204,21	0,06					
5.100.000	PETROLEOS MEXICANOS 5.625% 23/01/2046	USD	3.853.836,01	0,07					
14.300.000	PETROLEOS MEXICANOS 5.950% 28/01/2031	USD	13.207.208,44	0,23					
13.750.000	PETROLEOS MEXICANOS 6.350% 12/02/2048	USD	10.832.211,09	0,19					
12.400.000	PETROLEOS MEXICANOS 6.375% 23/01/2045	USD	9.911.881,84	0,17					
6.600.000	PETROLEOS MEXICANOS 6.500% 02/06/2041	USD	5.452.576,40	0,10					
4.238.000	PETROLEOS MEXICANOS 6.625% PERP	USD	3.229.862,36	0,06					
1.000.000	PETROLEOS MEXICANOS 6.700% 16/02/2032	USD	951.453,89	0,02					
43.178.000	PETROLEOS MEXICANOS 6.750% 21/09/2047	USD	35.111.935,09	0,62					
19.210.000	PETROLEOS MEXICANOS 6.875% 16/10/2025	USD	20.128.114,29	0,35					
20.000.000	PETROLEOS MEXICANOS 6.950% 28/01/2060	USD	16.285.577,60	0,29					
40.000.000	PETROLEOS MEXICANOS 7.690% 23/01/2050	USD	34.967.740,80	0,62					
			<b>269.961.425,15</b>	<b>4,76</b>					
<b>Indonesien</b>									
3.200.000	HUTAMA KARYA PERSERO PT 3.750% 11/05/2030	USD	3.207.571,52	0,06					
4.050.000	EMTN INDONESIA ASAHAN ALUMINIUM PERSERO PT 4.750% 15/05/2025	USD	4.139.561,82	0,07					
15.150.000	INDONESIA ASAHAN ALUMINIUM PERSERO PT 5.450% 15/05/2030	USD	15.829.550,67	0,28					
6.650.000	INDONESIA ASAHAN ALUMINIUM PERSERO PT 5.800% 15/05/2050	USD	6.700.724,60	0,12					
8.000.000	INDONESIA ASAHAN ALUMINIUM PERSERO PT 6.530% 15/11/2028	USD	8.869.586,64	0,16					
8.980.000	INDONESIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 1.400% 30/10/2031	EUR	9.113.959,63	0,16					
2.000.000	INDONESIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 2.150% 28/07/2031	USD	1.853.411,16	0,03					
2.950.000	INDONESIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.550% 31/03/2032	USD	3.031.995,31	0,05					
2.650.000	INDONESIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.700% 30/10/2049	USD	2.558.373,81	0,05					
500.000	INDONESIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.850% 15/10/2030	USD	525.995,94	0,01					
3.105.000	INDONESIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.200% 15/10/2050	USD	3.228.241,46	0,06					
4.200.000	INDONESIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.300% 31/03/2052	USD	4.414.677,20	0,08					
5.450.000	INDONESIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.350% 11/01/2048	USD	5.619.163,64	0,10					
15.667.000	INDONESIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.250% 17/01/2042 EMTN	USD	17.526.240,18	0,31					
3.525.000	INDONESIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.375% 24/04/2032	USD	3.635.104,89	0,06					
13.017.000	INDONESIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.625% 17/02/2037	USD	16.391.289,26	0,29					
24.800.000	PERTAMINA PERSERO PT 2.300% 09/02/2031	USD	21.946.010,30	0,39					
5.950.000	PERTAMINA PERSERO PT 4.700% 30/07/2049	USD	5.895.039,49	0,10					
1.000.000	EMTN PERTAMINA PERSERO PT 5.625% 20/05/2043	USD	1.064.482,91	0,02					
1.200.000	PERUSAHAAN PENERBIT SBSN INDONESIA III 2.800% 23/06/2030	USD	1.176.335,06	0,02					
2.000.000	PERUSAHAAN PENERBIT SBSN INDONESIA III 3.550% 09/06/2051	USD	1.895.361,18	0,03					
5.150.000	PERUSAHAAN PENERBIT SBSN INDONESIA III 3.800% 23/06/2050	USD	5.021.560,55	0,09					
16.100.000	PERUSAHAAN PERSEROAN PERSERO PT PERUSAHAAN LISTRIK NEGARA 4.000% 30/06/2050 EMTN	USD	14.346.049,74	0,25					
5.850.000	PERUSAHAAN PERSEROAN PERSERO PT PERUSAHAAN LISTRIK NEGARA 4.375% 05/02/2050 EMTN	USD	5.389.499,41	0,09					
28.950.000	PERUSAHAAN PERSEROAN PERSERO PT PERUSAHAAN LISTRIK NEGARA 6.150% 21/05/2048 EMTN	USD	32.293.349,23	0,57					
			<b>195.673.135,60</b>	<b>3,45</b>					
<b>Ägypten</b>									
2.651.000	EGYPT GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.875% 16/02/2026 EMTN	USD	2.373.406,63	0,04					
300.000	EGYPT GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.625% 16/04/2030 EMTN	EUR	280.594,76	0,00					
10.975.000	EGYPT GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.800% 30/09/2027 EMTN	USD	10.041.348,63	0,18					
14.890.000	EGYPT GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.375% 11/04/2031 EMTN	EUR	14.178.809,37	0,25					
7.100.000	EGYPT GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.052% 15/01/2032 EMTN	USD	6.243.734,75	0,11					
45.507.000	EGYPT GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.500% 16/02/2061 EMTN	USD	36.057.850,98	0,64					
19.735.000	EGYPT GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.625% 29/05/2032	USD	17.857.355,46	0,31					
4.300.000	EGYPT GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.903% 21/02/2048	USD	3.483.888,12	0,06					
7.270.000	EGYPT GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 8.150% 20/11/2059 EMTN	USD	5.981.630,59	0,11					
13.855.000	EGYPT GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 8.500% 31/01/2047	USD	11.859.617,17	0,21					
41.095.000	EGYPT GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 8.700% 01/03/2049	USD	35.037.410,02	0,62					
22.330.000	EGYPT GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 8.750% 30/09/2051 EMTN	USD	19.160.024,27	0,34					
28.495.000	EGYPT GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 8.875% 29/05/2050	USD	24.574.540,50	0,43					
			<b>187.130.211,25</b>	<b>3,30</b>					
<b>Türkei</b>									
4.000.000	HAZINE MUSTESARLIGI VARLIK KIRALAMA ANONIM SIRKETI 7.250% 24/02/2027	USD	4.017.230,24	0,07					
21.000.000	ISTANBUL METROPOLITAN MUNICIPALITY 6.375% 09/12/2025	USD	19.230.434,58	0,34					
8.185.000	PEGASUS HAVA TASIMACILIGI AS 9.250% 30/04/2026	USD	8.036.406,24	0,14					
10.831.000	TURKEY GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.750% 26/01/2026	USD	9.971.429,96	0,18					
8.676.000	TURKEY GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.875% 09/10/2026	USD	7.812.794,83	0,14					
4.400.000	TURKEY GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.875% 16/04/2043	USD	3.122.818,95	0,06					
14.140.000	TURKEY GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.250% 13/03/2030	USD	11.910.738,79	0,21					
1.820.000	TURKEY GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.600% 14/11/2024	USD	1.766.785,98	0,03					
30.050.000	TURKEY GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.750% 11/05/2047	USD	22.406.889,78	0,38					
14.950.000	TURKEY GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.875% 26/06/2031	USD	12.781.464,83	0,23					
4.830.000	TURKEY GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.950% 15/01/2031	USD	4.163.524,96	0,07					

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Emerging Markets Debt (Hard Currency)

(ausgedrückt in USD)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW	Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW
8.890.000	TURKEY GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.350% 10/08/2024	USD	8.812.648,38	0,16	27.600.000	QATAR ENERGY 3.300% 12/07/2051	USD	25.339.518,88	0,45
15.200.000	TURKEY GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.375% 14/10/2025	USD	14.872.807,23	0,26	9.255.000	QATAR GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.750% 16/04/2030	USD	9.774.404,58	0,17
9.965.000	TURKEY GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.500% 20/09/2033	USD	8.707.225,87	0,15	4.000.000	QATAR GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.000% 14/03/2029	USD	4.268.578,56	0,08
28.050.000	TURKEY GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.625% 17/02/2045	USD	23.107.513,42	0,41	13.230.000	QATAR GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.400% 16/04/2050	USD	14.853.674,90	0,26
25.975.000	TURKIYE IHRACAT KREDI BANKASI AS 5.750% 06/07/2026	USD	23.660.340,48	0,42	41.910.000	QATAR GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.817% 14/03/2049	USD	49.722.443,10	0,87
2.210.000	TURKIYE IHRACAT KREDI BANKASI AS 8.250% 24/01/2024	USD	2.264.289,47	0,04	12.750.000	QATAR GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.103% 23/04/2048	USD	15.617.785,97	0,28
			<b>186.645.343,99</b>	<b>3,29</b>				<b>165.659.119,54</b>	<b>2,92</b>
	<b>Vereinigte Staaten</b>					<b>Saudi-Arabien</b>			
3.667.620	BRAZIL LOAN TRUST 1 5.477% 24/07/2023	USD	3.740.177,96	0,07	10.180.000	SAUDI ARABIAN OIL CO 2.250% 24/11/2030	USD	9.349.916,28	0,16
2.000.000	SK BATTERY AMERICA INC 2.125% 26/01/2026	USD	1.849.126,84	0,03	4.920.000	SAUDI ARABIAN OIL CO 3.250% 24/11/2050	USD	4.220.360,11	0,07
175.000.000	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 1.500% 29/02/2024	USD	172.463.866,75	3,04	9.850.000	SAUDI ARABIAN OIL CO 3.500% 24/11/2070	USD	8.345.066,96	0,15
			<b>178.053.171,55</b>	<b>3,14</b>	11.675.000	SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 2.000% 09/07/2039	EUR	12.005.303,21	0,21
	<b>Dominikanische Republik</b>				6.517.000	SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 2.250% 02/02/2033 EMTN	USD	5.999.016,91	0,11
14.975.000	BANCO DE RESERVAS DE LA REPUBLICA DOMINICANA 7.000% 01/02/2023	USD	15.200.053,88	0,27	2.600.000	SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 2.750% 03/02/2032 EMTN	USD	2.529.024,47	0,04
7.750.000	DOMINICAN REPUBLIC INTERNATIONAL BOND 4.500% 30/01/2030	USD	7.134.069,99	0,13	8.885.000	SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.250% 17/11/2051 EMTN	USD	7.847.411,39	0,14
6.200.000	DOMINICAN REPUBLIC INTERNATIONAL BOND 4.875% 23/09/2032	USD	5.622.975,61	0,10	17.506.000	SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.450% 02/02/2061 EMTN	USD	15.510.311,45	0,27
18.000.000	DOMINICAN REPUBLIC INTERNATIONAL BOND 5.300% 21/01/2041	USD	15.699.485,52	0,27	12.000.000	SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.750% 21/01/2055 EMTN	USD	11.537.459,16	0,20
5.838.000	DOMINICAN REPUBLIC INTERNATIONAL BOND 5.500% 22/02/2029	USD	5.785.446,79	0,10	2.950.000	SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.500% 22/04/2060 EMTN	USD	3.196.047,85	0,06
200.000	DOMINICAN REPUBLIC INTERNATIONAL BOND 5.500% 27/01/2025	USD	206.995,23	0,00	31.740.000	SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.500% 26/10/2046 EMTN	USD	33.417.456,14	0,60
55.700.000	DOMINICAN REPUBLIC INTERNATIONAL BOND 5.875% 30/01/2060	USD	47.576.348,28	0,83	17.850.000	SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.625% 04/10/2047 EMTN	USD	19.150.433,19	0,34
11.500.000	DOMINICAN REPUBLIC INTERNATIONAL BOND 6.000% 19/07/2028	USD	11.696.883,22	0,21	9.120.000	SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.000% 17/04/2049 EMTN	USD	10.376.344,57	0,18
4.300.000	DOMINICAN REPUBLIC INTERNATIONAL BOND 6.000% 22/02/2033	USD	4.197.442,51	0,07				<b>143.484.151,69</b>	<b>2,53</b>
14.915.000	DOMINICAN REPUBLIC INTERNATIONAL BOND 6.400% 05/06/2049	USD	14.017.540,88	0,25		<b>Ecuador</b>			
12.875.000	DOMINICAN REPUBLIC INTERNATIONAL BOND 6.500% 15/02/2048	USD	12.314.212,77	0,22	31.349.999	ECUADOR GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND ZCP 31/07/2030	USD	17.467.124,07	0,31
14.000.000	DOMINICAN REPUBLIC INTERNATIONAL BOND 6.850% 27/01/2045	USD	13.921.144,72	0,25	69.200.000	ECUADOR GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 0.500% 31/07/2040 STEP-UP	USD	39.782.956,13	0,70
14.000.000	DOMINICAN REPUBLIC INTERNATIONAL BOND 7.450% 30/04/2044	USD	14.782.921,16	0,26	98.199.999	ECUADOR GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 1.000% 31/07/2035 STEP-UP	USD	64.272.472,83	1,14
5.314.000	EMPRESA GENERADORA DE ELECTRICIDAD HAINA SA 5.625% 08/11/2028	USD	4.930.238,38	0,09	25.500.000	ECUADOR GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.000% 31/07/2030 STEP-UP	USD	21.259.686,35	0,37
			<b>173.085.758,94</b>	<b>3,05</b>				<b>142.782.239,38</b>	<b>2,52</b>
	<b>Bahrain</b>					<b>Chile</b>			
13.900.000	BAHRAIN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.625% 30/09/2031	USD	13.489.213,58	0,24	2.400.000	CHILE GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 2.450% 31/01/2031	USD	2.246.480,11	0,04
13.985.000	BAHRAIN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.250% 25/01/2028 EMTN	USD	13.541.623,62	0,24	16.000.000	CHILE GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.100% 07/05/2041	USD	14.139.202,72	0,25
25.633.000	BAHRAIN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.250% 25/01/2033 EMTN	USD	23.686.719,63	0,42	23.900.000	CHILE GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.100% 22/01/2061	USD	19.668.666,33	0,35
14.650.000	BAHRAIN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.000% 19/09/2044	USD	12.763.473,94	0,22	14.270.000	CHILE GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.250% 21/09/2071	USD	11.557.578,52	0,20
33.445.000	BAHRAIN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.250% 25/01/2051 EMTN	USD	29.452.637,57	0,51	5.611.000	CHILE GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.500% 15/04/2053	USD	5.031.133,51	0,09
24.350.000	BAHRAIN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.000% 12/10/2028	USD	26.415.435,91	0,47	32.000.000	CHILE GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.500% 25/01/2050	USD	29.321.220,16	0,52
16.920.000	BAHRAIN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.375% 14/05/2030	USD	18.339.703,90	0,32	1.300.000	CHILE GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.500% 31/01/2034	USD	1.287.237,72	0,02
16.025.000	BAHRAIN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.500% 20/09/2047	USD	15.752.569,71	0,28	4.000.000	CHILE GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.000% 31/01/2052	USD	3.952.270,88	0,07
9.440.000	CBB INTERNATIONAL SUKUK PROGRAMME CO SPC 6.250% 14/11/2024	USD	9.970.939,68	0,18	4.790.000	CHILE GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.340% 07/03/2042	USD	4.943.557,48	0,09
2.550.000	OIL AND GAS HOLDING CO BSCC/THE 7.625% 07/11/2024	USD	2.679.242,31	0,05	18.900.000	EMPRESA DE LOS FERROCARRILES DEL ESTADO 3.068% 18/08/2050	USD	14.459.238,61	0,25
			<b>166.091.559,85</b>	<b>2,93</b>	27.940.000	EMPRESA DE TRANSPORTE DE PASAJEROS METRO SA 3.693% 13/09/2061	USD	22.726.253,79	0,40
	<b>Katar</b>				11.700.000	EMPRESA DE TRANSPORTE DE PASAJEROS METRO SA 4.700% 07/05/2050	USD	11.877.500,47	0,21
2.500.000	QATAR ENERGY 1.375% 12/09/2026	USD	2.331.418,60	0,04				<b>141.210.340,30</b>	<b>2,49</b>
19.650.000	QATAR ENERGY 2.250% 12/07/2031	USD	18.103.933,48	0,32					
28.100.000	QATAR ENERGY 3.125% 12/07/2041	USD	25.647.361,47	0,45					

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Emerging Markets Debt (Hard Currency)

(ausgedrückt in USD)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW	Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW
<b>Vereinigte Arabische Emirate</b>					11.000.000	OMAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.375% 08/03/2027	USD	11.297.963,82	0,20
1.865.000	ABU DHABI GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 1.875% 15/09/2031 EMTN	USD	1.721.071,18	0,03	7.100.000	OMAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.625% 17/01/2028	USD	7.328.906,70	0,13
4.200.000	ABU DHABI GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.000% 15/09/2051 EMTN	USD	3.761.754,70	0,07	6.000.000	OMAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.000% 01/08/2029 EMTN	USD	6.266.556,72	0,11
46.740.000	ABU DHABI GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.125% 30/09/2049	USD	42.845.589,55	0,75	10.895.000	OMAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.250% 25/01/2031	USD	11.549.046,57	0,20
4.535.000	ABU DHABI GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.875% 16/04/2050 EMTN	USD	4.743.725,23	0,08	15.415.000	OMAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.500% 08/03/2047	USD	15.138.662,23	0,27
4.020.000	ABU DHABI PORTS CO PJSC 2.500% 06/05/2031 EMTN	USD	3.715.788,35	0,07	41.525.000	OMAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.750% 17/01/2048	USD	41.525.224,24	0,73
22.450.000	EMIRATE OF DUBAI GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.900% 09/09/2050 EMTN	USD	19.112.846,11	0,34	12.930.000	OMAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.000% 25/01/2051	USD	13.275.473,57	0,23
5.681.000	EMIRATES DEVELOPMENT BANK PJSC 1.639% 15/06/2026 EMTN	USD	5.317.565,13	0,09	7.975.000	OMAN SOVEREIGN SUKUK CO 4.875% 15/06/2030	USD	8.314.033,60	0,15
7.900.000	FINANCE DEPARTMENT GOVERNMENT OF SHARJAH MTN 4.000% 28/07/2050	USD	6.389.014,08	0,11	4.775.000	OQ SAOC 5.125% 06/05/2028	USD	4.719.146,49	0,08
9.730.000	FINANCE DEPARTMENT GOVERNMENT OF SHARJAH 3.625% 10/03/2033 EMTN	USD	8.950.764,78	0,16				<b>125.458.732,16</b>	<b>2,21</b>
5.530.000	FINANCE DEPARTMENT GOVERNMENT OF SHARJAH 4.375% 10/03/2051 EMTN	USD	4.692.819,27	0,08	<b>Peru</b>				
8.590.000	MDGH GMTN BV 3.700% 07/11/2049 EMTN	USD	8.500.547,09	0,15	2.800.000	CORP FINANCIERA DE DESARROLLO SA 15/07/2029 FRN	USD	2.758.722,99	0,05
8.600.000	MDGH GMTN RSC LTD 2.875% 21/05/2030 GMTN	USD	8.243.147,13	0,15	3.500.000	PERUVIAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 1.250% 11/03/2033	EUR	3.365.939,08	0,06
11.200.000	MDGH GMTN RSC LTD 3.950% 21/05/2050 GMTN	USD	11.535.183,97	0,20	3.100.000	PERUVIAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 1.862% 01/12/2032	USD	2.658.852,61	0,05
10.910.000	NBK TIER 1 LTD FRN PERP	USD	10.195.889,66	0,18	31.900.000	PERUVIAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 2.780% 01/12/2060	USD	25.041.700,97	0,44
			<b>139.725.706,23</b>	<b>2,46</b>	8.720.000	PERUVIAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.000% 15/01/2034	USD	8.178.668,33	0,14
<b>Kolumbien</b>					54.700.000	PERUVIAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.230% 28/07/2121	USD	41.888.228,36	0,74
2.000.000	COLOMBIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.000% 30/01/2030	USD	1.721.178,34	0,03	4.900.000	PERUVIAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.300% 11/03/2041	USD	4.472.762,19	0,08
7.800.000	COLOMBIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.125% 15/04/2031	USD	6.615.711,65	0,12	15.200.000	PERUVIAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.600% 15/01/2072	USD	13.132.110,38	0,23
12.000.000	COLOMBIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.250% 22/04/2032	USD	10.058.420,64	0,18	18.200.000	PETROLEOS DEL PERU SA 5.625% 19/06/2047	USD	15.290.042,40	0,27
30.000.000	COLOMBIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.875% 15/02/2061	USD	21.425.229,90	0,38				<b>116.787.027,31</b>	<b>2,06</b>
18.800.000	COLOMBIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.125% 15/05/2051	USD	14.230.104,27	0,25	<b>Argentinien</b>				
19.300.000	COLOMBIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.125% 22/02/2042	USD	15.143.539,46	0,27	19.200.000	ARGENTINE REPUBLIC GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 0.125% 09/07/2030	EUR	6.438.814,22	0,11
43.900.000	COLOMBIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.000% 15/06/2045	USD	36.923.000,22	0,64	19.592.060	ARGENTINE REPUBLIC GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 0.750% 09/07/2035 STEP-UP	EUR	5.973.383,39	0,11
15.304.000	COLOMBIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.200% 15/05/2049	USD	13.058.416,69	0,23	200.000	ARGENTINE REPUBLIC GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 1.000% 09/07/2029	USD	68.779,45	0,00
12.400.000	ECOPETROL SA 4.625% 02/11/2031	USD	11.223.287,49	0,20	208.000.000	ARGENTINE REPUBLIC GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 1.125% 09/07/2035 STEP-UP	USD	63.770.992,48	1,12
6.000.000	ECOPETROL SA 5.875% 02/11/2051	USD	5.112.470,64	0,09	50.000.000	ARGENTINE REPUBLIC GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 1.125% 09/07/2046 STEP-UP	USD	15.739.112,00	0,28
2.800.000	EMPRESAS PUBLICAS DE MEDELLIN ESP 4.375% 15/02/2031	USD	2.412.074,17	0,04	46.015.220	ARGENTINE REPUBLIC GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 1.500% 09/07/2041 STEP-UP	EUR	15.229.376,18	0,27
			<b>137.923.433,47</b>	<b>2,43</b>	88.000.000	ARGENTINE REPUBLIC GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 15/12/2035 FRN	USD	483.732,48	0,01
<b>Panama</b>					2.883.829	PROVINCIA DE BUENOS AIRES/GOVERNMENT BONDS 2.850% 01/09/2037 EMTN STEP-UP	EUR	1.074.794,57	0,02
12.400.000	AEROPUERTO INTERNACIONAL DE TOCUMEN SA 5.125% 11/08/2061	USD	11.307.170,52	0,20				<b>108.778.984,77</b>	<b>1,92</b>
9.000.000	BANCO NACIONAL DE PANAMA 2.500% 11/08/2030	USD	7.958.530,35	0,14	<b>Nigeria</b>				
6.225.000	PANAMA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 2.252% 29/09/2032	USD	5.511.638,84	0,10	13.140.000	NIGERIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.125% 28/09/2028 EMTN	USD	12.056.225,15	0,21
9.000.000	PANAMA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.362% 30/06/2031	USD	8.448.257,61	0,15	3.250.000	NIGERIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.500% 28/11/2027 EMTN	USD	3.083.395,28	0,05
20.080.000	PANAMA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.870% 23/07/2060	USD	17.626.471,79	0,31	19.410.000	NIGERIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.375% 28/09/2033 EMTN	USD	17.657.411,71	0,31
21.650.000	PANAMA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.870% 23/07/2060	USD	19.004.637,16	0,33	22.760.000	NIGERIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.625% 28/11/2047 EMTN	USD	18.876.966,02	0,33
25.317.000	PANAMA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.300% 29/04/2053	USD	24.449.947,69	0,43	27.025.000	NIGERIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.696% 23/02/2038	USD	23.608.854,34	0,42
3.400.000	PANAMA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.500% 01/04/2056	USD	3.337.249,97	0,06	32.395.000	NIGERIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 8.250% 28/09/2051 EMTN	USD	28.252.263,91	0,51
13.000.000	PANAMA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.500% 01/04/2056	USD	12.760.073,43	0,22	4.000.000	NIGERIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 8.375% 24/03/2029 EMTN	USD	4.038.887,16	0,07
10.650.000	PANAMA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.500% 16/04/2050	USD	10.542.753,12	0,19	665.000	NIGERIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 9.248% 21/01/2049	USD	633.563,12	0,01
8.000.000	PANAMA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 8.125% 28/04/2034	USD	11.499.671,20	0,20				<b>108.207.566,69</b>	<b>1,91</b>
			<b>132.446.401,68</b>	<b>2,33</b>	<b>Oman</b>				
5.925.000	OMAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.875% 01/02/2025 EMTN	USD	6.043.718,22	0,11					

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.



## NN (L) Emerging Markets Debt (Hard Currency)

(ausgedrückt in USD)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW	Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW
<b>Jungferninseln</b>					7.500.000	UKRAINE GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 9.750% 01/11/2028	USD	3.179.666,03	0,06
1.000.000	HUARONG FINANCE 2017 CO LTD FRN PERP EMTN	USD	998.439,38	0,02	<b>89.351.939,55 1,57</b>				
3.000.000	HUARONG FINANCE 2017 CO LTD 4.750% 27/04/2027	USD	2.938.963,17	0,05	<b>Südafrika</b>				
3.000.000	HUARONG FINANCE 2017 CO LTD 4.950% 07/11/2047 EMTN	USD	2.392.354,14	0,04	25.018.000	ESKOM HOLDINGS SOC LTD 6.750% 06/08/2023 EMTN	USD	24.636.532,29	0,43
1.000.000	HUARONG FINANCE 2019 CO LTD 3.250% 13/11/2024 EMTN	USD	959.920,51	0,02	13.429.000	ESKOM HOLDINGS SOC LTD 8.450% 10/08/2028	USD	13.153.467,14	0,23
13.200.000	HUARONG FINANCE 2019 CO LTD 3.375% 24/02/2030 EMTN	USD	11.521.897,46	0,20	8.150.000	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.650% 27/09/2047	USD	7.127.463,18	0,13
1.000.000	HUARONG FINANCE 2019 CO LTD 3.625% 30/09/2030 EMTN	USD	880.636,28	0,02	49.050.000	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.750% 30/09/2049	USD	42.890.129,82	0,76
3.000.000	HUARONG FINANCE 2019 CO LTD 3.750% 29/05/2024 EMTN	USD	2.928.775,14	0,05	<b>87.807.592,43 1,55</b>				
3.000.000	HUARONG FINANCE 2019 CO LTD 3.875% 13/11/2029 EMTN	USD	2.729.863,08	0,05	<b>Sri Lanka</b>				
500.000	HUARONG FINANCE 2019 CO LTD 4.500% 29/05/2029 EMTN	USD	473.621,67	0,01	13.000.000	SRI LANKA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.750% 18/04/2023	USD	6.537.038,30	0,12
16.750.000	TSINGHUA UNIC LTD 5.375% 31/01/2023	USD	10.236.595,67	0,18	1.800.000	SRI LANKA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.125% 03/06/2025	USD	885.898,78	0,02
68.200.000	1MDB GLOBAL INVESTMENTS LTD 4.400% 09/03/2023	USD	66.644.914,51	1,17	20.775.000	SRI LANKA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.200% 11/05/2027	USD	9.933.813,68	0,17
				<b>102.705.981,01 1,81</b>	6.775.000	SRI LANKA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.350% 28/06/2024	USD	3.383.740,69	0,06
<b>Pakistan</b>					40.285.000	SRI LANKA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.750% 18/04/2028	USD	19.081.884,17	0,33
32.525.000	PAKISTAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.000% 08/04/2026 EMTN	USD	24.944.508,84	0,44	6.600.000	SRI LANKA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.825% 18/07/2026	USD	3.209.552,21	0,06
14.800.000	PAKISTAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.875% 05/12/2027	USD	11.356.520,41	0,20	21.977.000	SRI LANKA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.850% 03/11/2025	USD	10.791.099,07	0,18
31.395.000	PAKISTAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.375% 08/04/2031 EMTN	USD	22.450.289,17	0,40	17.850.000	SRI LANKA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.850% 14/03/2024	USD	8.858.824,52	0,16
4.688.000	PAKISTAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.875% 31/03/2036	USD	3.130.830,45	0,06	15.250.000	SRI LANKA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.550% 28/03/2030	USD	7.219.500,82	0,13
37.345.000	PAKISTAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 8.875% 08/04/2051 EMTN	USD	25.052.588,14	0,44	16.200.000	SRI LANKA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.850% 14/03/2029	USD	7.716.893,98	0,14
5.318.000	PAKISTAN WATER & POWER DEVELOPMENT AUTHORITY 7.500% 04/06/2031	USD	3.447.738,32	0,06	11.500.000	SRILANKAN AIRLINES LTD 7.000% 25/06/2024	USD	5.359.433,21	0,09
4.400.000	THIRD PAKISTAN INTERNATIONAL SUKUK CO LTD/THE 5.625% 05/12/2022	USD	4.217.688,60	0,07	<b>82.977.679,43 1,46</b>				
				<b>94.600.163,93 1,67</b>	<b>Brasilien</b>				
<b>Ghana</b>					5.500.000	BANCO VOTORANTIM SA 4.375% 29/07/2025 EMTN	USD	5.511.435,60	0,10
21.102.000	GHANA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND ZCP 07/04/2025	USD	13.744.760,90	0,24	16.000.000	BRAZILIAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.750% 12/09/2031	USD	14.458.574,72	0,25
2.200.000	GHANA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 10.750% 14/10/2030	USD	2.316.813,73	0,04	17.900.000	BRAZILIAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.875% 12/06/2030	USD	16.536.159,62	0,29
4.610.000	GHANA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.375% 11/02/2027	USD	3.454.118,33	0,06	17.495.000	BRAZILIAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.750% 14/01/2050	USD	14.660.782,01	0,26
1.860.000	GHANA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 8.125% 26/03/2032	USD	1.333.678,42	0,02	19.805.000	BRAZILIAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.750% 14/01/2050	USD	16.596.558,31	0,29
17.145.000	GHANA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 8.625% 07/04/2034	USD	12.105.073,80	0,21	15.100.000	BRAZILIAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.000% 27/01/2045	USD	13.442.241,82	0,24
18.333.000	GHANA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 8.627% 16/06/2049	USD	12.668.019,40	0,22	<b>81.205.752,08 1,43</b>				
22.165.000	GHANA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 8.750% 11/03/2061	USD	15.270.477,45	0,28	<b>Rumänien</b>				
25.100.000	GHANA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 8.875% 07/05/2042	USD	17.455.039,24	0,32	20.460.000	ROMANIAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 2.625% 02/12/2040	EUR	17.318.241,94	0,30
16.845.000	GHANA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 8.950% 26/03/2051	USD	11.628.739,57	0,20	14.985.000	ROMANIAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 2.750% 14/04/2041 EMTN	EUR	12.816.582,02	0,23
				<b>89.976.720,84 1,59</b>	16.285.000	ROMANIAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 2.875% 13/04/2042 EMTN	EUR	13.930.275,38	0,25
<b>Ukraine</b>					18.000.000	ROMANIAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.375% 28/01/2050 EMTN	EUR	16.060.740,67	0,28
10.380.000	NPC UKRENERGO 6.875% 09/11/2026	USD	3.884.815,58	0,07	3.800.000	ROMANIAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.000% 14/02/2051	USD	3.307.681,16	0,06
15.235.000	STATE AGENCY OF ROADS OF UKRAINE 6.250% 24/06/2028	USD	5.695.266,53	0,10	11.500.000	ROMANIAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.625% 03/04/2049 EMTN	EUR	12.569.167,60	0,22
79.900.000	UKRAINE GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 31/05/2040 FRN	USD	24.943.974,61	0,43	<b>76.002.688,77 1,34</b>				
11.595.000	UKRAINE GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.876% 21/05/2029	USD	4.778.708,92	0,08	<b>Philippinen</b>				
44.500.000	UKRAINE GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.253% 15/03/2033	USD	18.521.964,89	0,33	500.000	GLOBE TELECOM INC 3.000% 23/07/2035	USD	402.866,82	0,01
50.500.000	UKRAINE GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.375% 25/09/2032	USD	21.177.282,06	0,37	6.650.000	PHILIPPINE GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 1.750% 28/04/2041	EUR	6.280.100,04	0,11
750.000	UKRAINE GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.750% 01/09/2023	USD	377.558,53	0,01	1.000.000	PHILIPPINE GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 1.950% 06/01/2032	USD	906.508,72	0,02
16.000.000	UKRAINE GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.750% 01/09/2027	USD	6.792.702,40	0,12	3.750.000	PHILIPPINE GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 2.252% 29/09/2032	USD	3.246.427,61	0,06
					20.000.000	PHILIPPINE GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 2.650% 10/12/2045	USD	16.554.936,80	0,29

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.



## NN (L) Emerging Markets Debt (Hard Currency)

(ausgedrückt in USD)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW	Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW
6.010.000	PHILIPPINE GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.556% 29/09/2032	USD	6.174.968,07	0,11	23.300.000	PARAGUAY GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.400% 30/03/2050	USD	23.512.498,56	0,42
1.000.000	PHILIPPINE GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.700% 01/03/2041	USD	971.045,99	0,02	5.100.000	PARAGUAY GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.600% 13/03/2048	USD	5.228.956,10	0,09
10.280.000	PHILIPPINE GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.200% 29/03/2047	USD	10.791.205,59	0,19				<b>55.865.706,00</b>	<b>0,98</b>
23.064.000	POWER SECTOR ASSETS & LIABILITIES MANAGEMENT CORP 9.625% 15/05/2028	USD	29.599.063,31	0,51		<b>Hongkong</b>			
			<b>74.927.122,95</b>	<b>1,32</b>	28.500.000	CNAC HK FINBRIDGE CO LTD 3.875% 19/06/2029	USD	28.079.290,13	0,49
	<b>Jordanien</b>				24.727.000	CNAC HK FINBRIDGE CO LTD 4.125% 19/07/2027	USD	24.757.505,95	0,44
11.270.000	JORDAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.950% 07/07/2025	USD	11.247.640,77	0,20				<b>52.836.796,08</b>	<b>0,93</b>
41.225.000	JORDAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.850% 07/07/2030	USD	38.546.931,66	0,68		<b>Kasachstan</b>			
21.250.000	JORDAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.375% 10/10/2047	USD	19.359.104,88	0,34	2.000.000	KAZAKHSTAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.875% 14/10/2044	USD	1.978.315,02	0,03
			<b>69.153.677,31</b>	<b>1,22</b>	54.114.000	KAZMUNAYGAS NATIONAL CO JSC 5.750% 19/04/2047	USD	47.961.618,62	0,85
	<b>Kaimaninseln</b>				3.000.000	KAZMUNAYGAS NATIONAL CO JSC 6.375% 24/10/2048	USD	2.820.447,84	0,05
1.000.000	AGILE GROUP HOLDINGS LTD 5.500% 17/05/2026	USD	301.212,76	0,01				<b>52.760.381,48</b>	<b>0,93</b>
2.800.000	AGILE GROUP HOLDINGS LTD 5.500% 21/04/2025	USD	899.959,98	0,02		<b>Guatemala</b>			
3.000.000	AGILE GROUP HOLDINGS LTD 6.050% 13/10/2025	USD	953.226,03	0,02	50.000	GUATEMALA GOVERNMENT BOND 3.700% 07/10/2033	USD	46.266,30	0,00
9.814.242	BIOCEANICO SOVEREIGN CERTIFICATE LTD ZCP 05/06/2034	USD	7.128.820,75	0,13	10.300.000	GUATEMALA GOVERNMENT BOND 4.650% 07/10/2041	USD	9.601.242,75	0,17
2.000.000	CHINA AOYUAN GROUP LTD 5.375% 13/09/2022	USD	341.648,64	0,01	2.000.000	GUATEMALA GOVERNMENT BOND 4.900% 01/06/2030	USD	2.041.199,78	0,04
4.000.000	CHINA AOYUAN GROUP LTD 5.880% 01/03/2027	USD	638.146,12	0,01	4.500.000	GUATEMALA GOVERNMENT BOND 5.375% 24/04/2032	USD	4.704.547,64	0,08
1.000.000	CHINA AOYUAN GROUP LTD 6.350% 08/02/2024	USD	173.274,89	0,00	850.000	GUATEMALA GOVERNMENT BOND 5.750% 06/06/2022	USD	854.478,61	0,02
1.000.000	CHINA AOYUAN GROUP LTD 7.950% 19/02/2023	USD	169.947,43	0,00	29.000.000	GUATEMALA GOVERNMENT BOND 6.125% 01/06/2050	USD	30.379.754,75	0,53
25.017.000	CHINA EVERGRANDE GROUP 8.750% 28/06/2025	USD	3.117.802,41	0,05				<b>47.627.489,83</b>	<b>0,84</b>
3.500.000	DUBAI DOF SUKUK LTD 2.763% 09/09/2030 EMTN	USD	3.412.005,24	0,06		<b>Angola</b>			
3.500.000	FANTASIA HOLDINGS GROUP CO LTD 10.875% 09/01/2023	USD	498.141,60	0,01	3.540.000	ANGOLAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 8.000% 26/11/2029 EMTN	USD	3.555.496,77	0,06
8.500.000	FANTASIA HOLDINGS GROUP CO LTD 11.875% 01/06/2023	USD	1.220.115,84	0,02	38.660.000	ANGOLAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 9.125% 26/11/2049 EMTN	USD	37.674.091,91	0,66
700.000	INDUSTRIAL SENIOR TRUST 5.500% 01/11/2022	USD	703.237,45	0,01	6.065.000	ANGOLAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 9.375% 08/05/2048	USD	5.961.634,33	0,11
7.311.127	INTEROCEANICA IV FINANCE LTD ZCP 30/11/2025	USD	6.804.464,88	0,12				<b>47.191.223,01</b>	<b>0,83</b>
1.000.000	KAISA GROUP HOLDINGS LTD 11.250% 16/04/2025	USD	190.249,31	0,00		<b>Bahamas</b>			
4.000.000	KAISA GROUP HOLDINGS LTD 11.700% 11/11/2025	USD	747.409,44	0,01	1.000.000	BAHAMAS GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.750% 16/01/2024	USD	900.758,71	0,02
2.000.000	KAISA GROUP HOLDINGS LTD 11.950% 12/11/2023	USD	378.189,66	0,01	22.500.000	BAHAMAS GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.000% 21/11/2028	USD	17.409.235,95	0,31
5.000.000	KAISA GROUP HOLDINGS LTD 9.375% 30/06/2024	USD	951.246,55	0,02	29.800.000	BAHAMAS GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 8.950% 15/10/2032	USD	24.054.604,10	0,42
7.417.000	KSA SUKUK LTD 2.969% 29/10/2029 EMTN	USD	7.385.354,92	0,13				<b>42.364.598,76</b>	<b>0,75</b>
1.563.000	MALDIVES SUKUK ISSUANCE LTD 9.875% 08/04/2026	USD	1.481.077,36	0,03		<b>Costa Rica</b>			
3.600.000	MUMTALAKAT SUKUK HOLDING CO 5.625% 27/02/2024	USD	3.708.064,19	0,07	8.023.714	AUTOPISTAS DEL SOL SA/COSTA RICA 7.375% 30/12/2030	USD	7.940.045,97	0,14
1.215.009.588	NEON CAPITAL LTD/KY ZCP 06/01/2028	JPY	8.812.135,46	0,15	10.200.000	COSTA RICA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.625% 30/04/2043	USD	8.890.541,03	0,16
3.000.000	ORYX FUNDING LTD 5.800% 03/02/2031	USD	3.005.467,53	0,05	6.000.000	COSTA RICA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.125% 19/02/2031	USD	6.092.836,08	0,11
5.062.419	PERU ENHANCED PASS-THROUGH FINANCE LTD ZCP 02/06/2025	USD	4.799.424,08	0,08	1.500.000	COSTA RICA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.000% 04/04/2044	USD	1.474.882,53	0,03
2.993.000	SA GLOBAL SUKUK LTD 0.946% 17/06/2024	USD	2.865.548,63	0,05	1.100.000	COSTA RICA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.158% 12/03/2045	USD	1.091.208,60	0,02
4.773.000	SA GLOBAL SUKUK LTD 1.602% 17/06/2026	USD	4.492.238,01	0,08	11.500.000	INSTITUTO COSTARRICENSE DE ELECTRICIDAD 6.375% 15/05/2043	USD	9.397.091,26	0,16
500.000	SUNAC CHINA HOLDINGS LTD 7.000% 09/07/2025	USD	117.651,36	0,00	5.950.000	INSTITUTO COSTARRICENSE DE ELECTRICIDAD 6.750% 07/10/2031	USD	5.954.447,27	0,10
5.400.000	YUZHOU GROUP HOLDINGS CO LTD 7.700% 20/02/2025	USD	709.806,19	0,01				<b>40.841.052,74</b>	<b>0,72</b>
			<b>66.005.866,71</b>	<b>1,16</b>		<b>Malaysia</b>			
	<b>Uruguay</b>				1.000.000	DUA CAPITAL LTD 1.658% 11/05/2026	USD	923.188,98	0,02
49.000.000	URUGUAY GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.975% 20/04/2055	USD	57.417.907,47	1,01	4.000.000	DUA CAPITAL LTD 2.780% 11/05/2031	USD	3.624.499,96	0,06
2.300.000	URUGUAY GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.625% 21/03/2036	USD	3.265.594,21	0,06	3.000.000	MALAYSIA WAKALA SUKUK BHD 2.070% 28/04/2031	USD	2.801.921,07	0,05
			<b>60.683.501,68</b>	<b>1,07</b>					
	<b>Paraguay</b>								
12.400.000	PARAGUAY GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 2.739% 29/01/2033	USD	10.956.688,61	0,19					
15.409.000	PARAGUAY GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.950% 28/04/2031	USD	16.167.562,73	0,28					

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Emerging Markets Debt (Hard Currency)

(ausgedrückt in USD)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW	Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW
4.700.000	MALAYSIA WAKALA SUKUK BHD 3.075% 28/04/2051	USD	4.266.163,35	0,08	48.620.000	PETROLEOS DE VENEZUELA SA 6.000% 16/05/2024 - DEFAULTED	USD	3.302.167,33	0,06
1.000.000	PETRONAS CAPITAL LTD 2.480% 28/01/2032 EMTN	USD	933.458,07	0,02	8.635.000	PETROLEOS DE VENEZUELA SA 8.500% 27/10/2020	USD	1.426.393,89	0,03
13.900.000	PETRONAS CAPITAL LTD 3.404% 28/04/2061 EMTN	USD	12.480.094,29	0,21	11.475.000	PETROLEOS DE VENEZUELA SA 9.000% 17/11/2021 - DEFAULTED	USD	819.036,16	0,01
925.000	PETRONAS CAPITAL LTD 3.500% 21/04/2030 EMTN	USD	942.648,78	0,02	92.760.000	VENEZUELA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 9.250% 15/09/2027 - DEFAULTED	USD	8.930.301,10	0,16
2.000.000	PETRONAS CAPITAL LTD 4.500% 18/03/2045 EMTN	USD	2.213.276,58	0,04	66.075.000	VENEZUELA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 9.375% 13/01/2034 - DEFAULTED	USD	5.860.875,63	0,10
9.795.000	PETRONAS CAPITAL LTD 4.550% 21/04/2050 EMTN	USD	11.055.219,70	0,19				<b>23.332.915,03</b>	<b>0,41</b>
775.000	PETRONAS CAPITAL LTD 4.800% 21/04/2060 EMTN	USD	911.715,02	0,02		<b>Montenegro</b>			
			<b>40.152.185,80</b>	<b>0,71</b>	24.000.000	MONTENEGRO GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 2.875% 16/12/2027	EUR	22.996.450,42	0,41
	<b>Bermuda</b>							<b>22.996.450,42</b>	<b>0,41</b>
7.400.000	BERMUDA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 2.375% 20/08/2030	USD	6.788.703,46	0,12		<b>Aserbaidsschan</b>			
28.500.000	BERMUDA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.375% 20/08/2050	USD	25.248.099,84	0,45	6.900.000	REPUBLIC OF AZERBAIJAN INTERNATIONAL BOND 3.500% 01/09/2032	USD	6.431.136,79	0,11
6.000.000	INKIA ENERGY LTD 5.875% 09/11/2027	USD	5.795.486,94	0,10	12.000.000	REPUBLIC OF AZERBAIJAN INTERNATIONAL BOND 5.125% 01/09/2029	USD	12.291.923,28	0,22
			<b>37.832.290,24</b>	<b>0,67</b>	3.900.000	SOUTHERN GAS CORRIDOR CISC 6.875% 24/03/2026	USD	4.270.241,51	0,08
	<b>El Salvador</b>							<b>22.993.301,58</b>	<b>0,41</b>
11.800.000	EL SALVADOR GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.875% 30/01/2025	USD	6.578.203,23	0,12		<b>Irak</b>			
6.950.000	EL SALVADOR GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.375% 18/01/2027	USD	3.407.634,83	0,06	22.106.250	IRAQ INTERNATIONAL BOND 5.800% 15/01/2028	USD	21.558.918,91	0,38
22.500.000	EL SALVADOR GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.125% 20/01/2050	USD	10.081.736,10	0,18				<b>21.558.918,91</b>	<b>0,38</b>
19.500.000	EL SALVADOR GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.625% 01/02/2041	USD	9.160.247,46	0,16		<b>Papua-Neuguinea</b>			
8.605.000	EL SALVADOR GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.625% 21/09/2034	USD	3.960.798,81	0,07	23.380.000	PAPUA NEW GUINEA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 8.375% 04/10/2028	USD	20.077.000,79	0,35
2.450.000	EL SALVADOR GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 9.500% 15/07/2052	USD	1.182.562,47	0,02				<b>20.077.000,79</b>	<b>0,35</b>
			<b>34.371.182,90</b>	<b>0,61</b>		<b>Trinidad und Tobago</b>			
	<b>Marokko</b>				16.800.000	TRINIDAD & TOBAGO GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.500% 26/06/2030	USD	16.304.087,35	0,29
9.200.000	MOROCCO GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 2.375% 15/12/2027	USD	8.408.325,28	0,15	3.600.000	TRINIDAD PETROLEUM HOLDINGS LTD 9.750% 15/06/2026	USD	3.654.000,00	0,06
16.850.000	MOROCCO GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.000% 15/12/2050	USD	13.504.802,69	0,24				<b>19.958.087,35</b>	<b>0,35</b>
10.159.000	OCP SA 5.125% 23/06/2051	USD	8.530.268,48	0,15		<b>Benin</b>			
			<b>30.443.396,45</b>	<b>0,54</b>	14.351.000	BENIN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.950% 22/01/2035	EUR	13.022.172,21	0,23
	<b>Niederlande</b>				7.253.000	BENIN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.875% 19/01/2052	EUR	6.767.593,17	0,12
7.250.000	BOI FINANCE BV 7.500% 16/02/2027	EUR	7.965.506,58	0,14				<b>19.789.765,38</b>	<b>0,35</b>
5.400.000	MINEJESA CAPITAL BV 4.625% 10/08/2030	USD	5.122.633,00	0,09		<b>Sambia</b>			
17.550.000	PETROBRAS GLOBAL FINANCE BV 6.850% 05/06/2115	USD	16.365.594,55	0,28	27.625.000	ZAMBIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 8.970% 30/07/2027	USD	19.588.841,37	0,35
			<b>29.453.734,13</b>	<b>0,51</b>				<b>19.588.841,37</b>	<b>0,35</b>
	<b>Jamaika</b>					<b>Libanon</b>			
19.000.000	JAMAICA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.875% 28/07/2045	USD	24.625.242,79	0,43	1.000.000	LEBANON GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.800% 14/04/2020 GMTN	USD	117.511,63	0,00
			<b>24.625.242,79</b>	<b>0,43</b>	15.816.000	LEBANON GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.150% 19/06/2020 GMTN	USD	1.861.105,10	0,03
	<b>Elfenbeinküste</b>				5.201.000	LEBANON GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.375% 01/01/2025 GMTN	USD	611.117,50	0,01
5.290.000	IVORY COAST GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.875% 30/01/2032	EUR	5.177.704,03	0,09	14.250.000	LEBANON GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.650% 03/11/2028 GMTN	USD	1.675.490,49	0,03
2.340.000	IVORY COAST GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.875% 17/10/2031	EUR	2.410.346,88	0,04	29.640.000	LEBANON GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.650% 22/04/2024	USD	3.492.583,46	0,06
5.200.000	IVORY COAST GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.125% 15/06/2033	USD	5.051.032,43	0,09	79.182.000	LEBANON GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.250% 23/03/2037	USD	9.476.705,26	0,18
6.460.000	IVORY COAST GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.625% 22/03/2048	EUR	6.270.509,95	0,12	11.356.000	LEBANON GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 8.250% 12/04/2021 EMTN	USD	1.346.204,74	0,02
5.295.000	IVORY COAST GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.875% 17/10/2040	EUR	5.357.934,63	0,09				<b>18.580.718,18</b>	<b>0,33</b>
			<b>24.267.527,92</b>	<b>0,43</b>		<b>Jersey</b>			
	<b>Venezuela</b>				9.433.155	GALAXY PIPELINE ASSETS BIDCO LTD 2.160% 31/03/2034	USD	8.691.901,26	0,15
42.775.000	PETROLEOS DE VENEZUELA SA 5.500% 12/04/2037 - DEFAULTED	USD	2.994.140,92	0,05					

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Emerging Markets Debt (Hard Currency)

(ausgedrückt in USD)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW	Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW
9.323.004	GALAXY PIPELINE ASSETS BIDCO LTD 2.940% 30/09/2040	USD	8.431.312,64	0,15					
	<b>Gabun</b>		<b>17.123.213,90</b>	<b>0,30</b>		<b>Indien</b>			
16.930.000	GABON GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.000% 24/11/2031	USD	16.242.434,44	0,29	13.100.000	EXPORT-IMPORT BANK OF INDIA 2.250% 13/01/2031 EMTN	USD	11.287.185,98	0,20
	<b>Republik Serbien</b>		<b>16.242.434,44</b>	<b>0,29</b>		<b>Mosambik</b>		<b>11.287.185,98</b>	<b>0,20</b>
6.690.000	SERBIA INTERNATIONAL BOND 1.650% 03/03/2033	EUR	5.833.690,73	0,10	11.600.000	MOZAMBIQUE INTERNATIONAL BOND 5.000% 15/09/2031 STEP-UP	USD	9.980.637,80	0,18
12.000.000	SERBIA INTERNATIONAL BOND 2.125% 01/12/2030	USD	10.106.055,48	0,18		<b>Kenia</b>			
	<b>Albanien</b>		<b>15.939.746,21</b>	<b>0,28</b>	8.540.000	REPUBLIC OF KENYA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.300% 23/01/2034	USD	7.349.249,87	0,13
1.000.000	ALBANIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.500% 16/06/2027	EUR	1.079.614,18	0,02	1.500.000	REPUBLIC OF KENYA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 8.250% 28/02/2048	USD	1.339.477,97	0,02
14.500.000	ALBANIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.500% 23/11/2031	EUR	13.969.181,93	0,25		<b>Tadschikistan</b>		<b>8.688.727,84</b>	<b>0,15</b>
	<b>Armenien</b>		<b>15.048.796,11</b>	<b>0,27</b>	9.390.000	REPUBLIC OF TAJIKISTAN INTERNATIONAL BOND 7.125% 14/09/2027	USD	7.039.656,80	0,12
18.974.000	REPUBLIC OF ARMENIA INTERNATIONAL BOND 3.600% 02/02/2031	USD	15.027.019,41	0,26		<b>Mongolei</b>		<b>7.039.656,80</b>	<b>0,12</b>
	<b>Tunesien</b>		<b>15.027.019,41</b>	<b>0,26</b>	4.000.000	MONGOLIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.500% 07/07/2027	USD	3.638.349,76	0,06
2.200.000.000	TUNISIAN REPUBLIC 3.500% 03/02/2033	JPY	8.945.844,55	0,16	3.550.000	MONGOLIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.450% 07/07/2031	USD	3.208.059,35	0,06
2.450.000	TUNISIAN REPUBLIC 5.625% 17/02/2024	EUR	1.864.445,00	0,03		<b>Mazedonien</b>		<b>6.846.409,11</b>	<b>0,12</b>
5.300.000	TUNISIAN REPUBLIC 5.750% 30/01/2025	USD	3.576.791,28	0,06	6.500.000	NORTH MACEDONIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 1.625% 10/03/2028	EUR	6.322.524,17	0,11
	<b>Bolivien</b>		<b>14.387.080,83</b>	<b>0,25</b>		<b>Weißrussland</b>		<b>6.322.524,17</b>	<b>0,11</b>
3.150.000	BOLIVIAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.500% 20/03/2028	USD	2.742.843,60	0,05	2.705.000	DEVELOPMENT BANK OF THE REPUBLIC OF BELARUS JSC 6.750% 02/05/2024	USD	159.011,13	0,00
11.526.000	BOLIVIAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.500% 02/03/2030	USD	11.422.545,16	0,20	5.666.000	REPUBLIC OF BELARUS INTERNATIONAL BOND 5.875% 24/02/2026	USD	849.900,00	0,01
	<b>Honduras</b>		<b>14.165.388,76</b>	<b>0,25</b>	28.005.000	REPUBLIC OF BELARUS INTERNATIONAL BOND 6.378% 24/02/2031	USD	3.640.650,00	0,07
1.000.000	HONDURAS GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.625% 24/06/2030	USD	904.680,06	0,02	11.300.000	REPUBLIC OF BELARUS INTERNATIONAL BOND 7.625% 29/06/2027	USD	1.659.736,88	0,03
4.000.000	HONDURAS GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.625% 24/06/2030	USD	3.618.720,24	0,06		<b>Kanada</b>		<b>6.309.298,01</b>	<b>0,11</b>
9.900.000	HONDURAS GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.250% 19/01/2027	USD	9.400.837,45	0,17	6.630.000	CANACOL ENERGY LTD 5.750% 24/11/2028	USD	6.176.916,21	0,11
	<b>Uzbekistan</b>		<b>13.924.237,75</b>	<b>0,25</b>		<b>Vereinigtes Königreich</b>		<b>6.176.916,21</b>	<b>0,11</b>
6.171.000	REPUBLIC OF UZBEKISTAN INTERNATIONAL BOND 3.900% 19/10/2031	USD	5.368.476,20	0,09	4.290.000	STATE SAVINGS BANK OF UKRAINE VIA SSB #1 PLC 9.625% 20/03/2025 STEP-UP	USD	1.331.739,17	0,02
10.445.000	UZBEKNEFTEGAZ JSC 4.750% 16/11/2028	USD	8.518.997,88	0,15	4.450.000	UKRAINE RAILWAYS VIA RAIL CAPITAL MARKETS PLC 7.875% 15/07/2026	USD	1.254.997,37	0,02
	<b>Ungarn</b>		<b>13.887.474,08</b>	<b>0,24</b>	4.000.000	UKRAINE RAILWAYS VIA RAIL CAPITAL MARKETS PLC 8.250% 09/07/2024	USD	1.180.890,00	0,02
810.000	HUNGARY GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 2.125% 22/09/2031	USD	734.090,40	0,01		<b>Thailand</b>		<b>3.767.626,54</b>	<b>0,06</b>
12.650.000	HUNGARY GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.125% 21/09/2051	USD	10.645.465,19	0,18	2.000.000	GC TREASURY CENTER CO LTD 5.200% 30/03/2052 EMTN	USD	2.069.406,64	0,04
	<b>Senegal</b>		<b>11.379.555,59</b>	<b>0,19</b>		<b>Supranational-Multinational</b>		<b>2.069.406,64</b>	<b>0,04</b>
11.221.000	SENEGAL GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.375% 08/06/2037	EUR	10.606.320,13	0,19	2.200.000	BLACK SEA TRADE & DEVELOPMENT BANK 3.500% 25/06/2024	USD	1.981.921,74	0,02
850.000	SENEGAL GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.750% 13/03/2048	USD	733.448,39	0,01				<b>1.981.921,74</b>	<b>0,02</b>
			<b>11.339.768,52</b>	<b>0,20</b>					

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Emerging Markets Debt (Hard Currency)

(ausgedrückt in USD)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW
<b>Georgien</b>				
1.792.000	GEORGIAN RAILWAY JSC 4.000% 17/06/2028	USD	1.534.338,12	0,03
			<b>1.534.338,12</b>	<b>0,03</b>
<b>Spanien</b>				
1.100.000	AI CANDELARIA SPAIN SA 7.500% 15/12/2028	USD	1.080.402,93	0,02
			<b>1.080.402,93</b>	<b>0,02</b>
<b>Irland</b>				
1.820.000	GTLK EUROPE CAPITAL DAC 4.349% 27/02/2029	USD	364.000,00	0,01
0,03	SADEREA DAC 12.500% 30/11/2026 EMTN	USD	0,03	0,00
			<b>364.000,03</b>	<b>0,01</b>
			<b>4.775.925.570,90</b>	<b>84,17</b>

### Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente

#### Anleihen und andere Schuldtitel

<b>Russland</b>				
7.200.000	RUSSIAN FOREIGN BOND - EUROBOND 4.375% 21/03/2029	USD	1.152.000,00	0,02
11.800.000	RUSSIAN FOREIGN BOND - EUROBOND 5.100% 28/03/2035	USD	1.888.000,00	0,03
65.400.000	RUSSIAN FOREIGN BOND - EUROBOND 5.250% 23/06/2047	USD	13.734.000,00	0,24
			<b>16.774.000,00</b>	<b>0,29</b>
<b>Tunesien</b>				
730.000.000	TUNISIAN REPUBLIC 4.300% 02/08/2030	JPY	3.397.909,69	0,06
			<b>3.397.909,69</b>	<b>0,06</b>
<b>Kaimaninseln</b>				
3.300.000	BRAZIL MINAS SPE VIA STATE OF MINAS GERAIS 5.333% 15/02/2028	USD	3.339.783,02	0,06
			<b>3.339.783,02</b>	<b>0,06</b>
<b>Argentinien</b>				
1.135.127.000	ARGENTINE REPUBLIC GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 15/12/2035 FRN	JPY	20.834,15	0,00
			<b>20.834,15</b>	<b>0,00</b>
			<b>23.532.526,86</b>	<b>0,41</b>

#### Organismen für gemeinsame Anlagen

#### Offene Fonds

<b>Luxemburg</b>				
1.472	NN (L) ASIAN DEBT (HARD CURRENCY) - Z CAP USD	USD	7.354.480,00	0,13
13.916	NN (L) EMERGING MARKETS CORPORATE DEBT - Z CAP USD	USD	91.208.280,43	1,61
17.858	NN (L) EMERGING MARKETS DEBT SHORT DURATION (HARD CURRENCY) - Z CAP USD	USD	88.999.000,97	1,57
28.737	NN (L) FRONTIER MARKETS DEBT (HARD CURRENCY) - I CAP USD	USD	204.047.875,39	3,59
			<b>391.609.636,79</b>	<b>6,90</b>
			<b>391.609.636,79</b>	<b>6,90</b>

**Wertpapierbestand Gesamt 5.191.067.734,55 91,48**

### Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022

Bezeichnung	Verkauf / Kauf	Zinssatz (%)	Fälligkeits- datum	Währung	Nennwert	Swap-Wert in USD
<b>Credit Default Swaps</b>						
CDS REPUBLIC OF COLOMBIA 1.000% 20/06/2027	Kauf	1,000	20/06/2027	USD	24.000.000,00	1.048.662,48
CDX EMERGING MARKETS SERIES 37 VERSION 1 CDS UNITED MEXICAN STATES 1.000% 20/06/2027	Kauf	1,000	20/06/2027	USD	15.000.000,00	881.308,95
CDS UNITED MEXICAN STATES 1.000% 20/06/2027	Kauf	1,000	20/06/2027	USD	22.500.000,00	2.329,88
CDS UNITED MEXICAN STATES 1.000% 20/06/2027	Kauf	1,000	20/06/2027	USD	22.500.000,00	2.329,88
CDS REPUBLIC OF PERU 1.000% 20/12/2022	Kauf	1,000	20/06/2027	USD	22.000.000,00	(241.319,98)
CDS REPUBLIC OF PERU 1.000% 20/12/2022	Kauf	1,000	20/06/2027	USD	22.200.000,00	(243.513,80)
						<b>1.449.797,41</b>

Zu erhalten	Zu zahlen	Fälligkeits- datum	Engagement in USD	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in USD

#### Devisentermingeschäfte

22.772.185.748,32	ZAR	1.478.876.100,66	USD	05/04/2022	1.478.876.100,66	79.333.469,31
319.921.553,35	AUD	232.661.440,26	USD	19/04/2022	232.661.440,26	7.625.257,02
23.083.601,18	USD	2.635.000.000,00	JPY	28/04/2022	23.083.601,18	1.364.062,05
309.291.507,60	USD	276.692.306,87	EUR	19/04/2022	309.291.507,60	1.296.086,06
187.620.075,65	PLN	44.257.276,62	USD	19/04/2022	44.257.276,62	703.169,29
58.737.805,42	CZK	2.582.584,45	USD	19/04/2022	2.582.584,45	88.399,24
3.430.099,73	USD	2.540.000,00	GBP	28/04/2022	3.430.099,73	86.326,98
4.999.561,88	USD	72.256.167,97	ZAR	04/04/2022	4.999.561,88	54.742,86
8.576.217,23	USD	124.633.876,95	ZAR	01/04/2022	8.576.217,23	46.952,77
197.165,82	USD	2.871.931,07	ZAR	19/04/2022	197.165,82	1.000,21
403.464,09	USD	536.129,28	AUD	04/04/2022	403.464,09	857,93
49.294,55	USD	37.266,18	GBP	19/04/2022	49.294,55	233,25
49.538,26	USD	44.371,23	EUR	04/04/2022	49.538,26	168,60
67.466,89	EUR	74.905,11	USD	01/04/2022	74.905,11	161,94
77.273,20	AUD	57.981,95	USD	01/04/2022	57.981,95	46,34
8.410,98	USD	183.972,60	CZK	04/04/2022	8.410,98	30,49
	USD	45,16	CZK	01/04/2022	45,16	(0,22)
13.583,83	USD	12.234,93	EUR	01/04/2022	13.583,83	(29,37)
41.688,50	USD	38.435,79	CHF	19/04/2022	41.688,50	(98,89)
68.200,14	AUD	51.324,02	USD	04/04/2022	51.324,02	(109,14)
50.286,05	EUR	56.141,87	USD	04/04/2022	56.141,87	(191,08)
1.328.967,97	USD	1.771.130,76	AUD	01/04/2022	1.328.967,97	(1.062,26)
2.871.931,07	ZAR	197.621,27	USD	01/04/2022	197.621,27	(1.081,93)
677.082,20	CHF	737.508,51	USD	19/04/2022	737.508,51	(1.384,77)

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Emerging Markets Debt (Hard Currency)

(ausgedrückt in USD)

### Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Zu erhalten	Zu zahlen	Fälligkeits- datum	Engagement in USD	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in USD
524.486,43 GBP	700.128,06 USD	19/04/2022	700.128,06	(9.636,38)
282.393,27 USD	6.523.316,53 CZK	19/04/2022	282.393,27	(14.241,44)
2.540.000,00 GBP	3.385.327,82 USD	28/04/2022	3.385.327,82	(41.555,07)
23.214.919,24 USD	31.815.673,22 AUD	19/04/2022	23.214.919,24	(681.198,30)
19.147.321,69 USD	83.476.107,42 PLN	19/04/2022	19.147.321,69	(856.523,84)
188.558.451,55 USD	170.500.000,00 EUR	31/05/2022	188.558.451,55	(1.548.409,69)
1.555.040.315,42 USD	22.772.185.748,19 ZAR	05/04/2022	1.555.040.315,42	(3.169.254,55)
2.274.129.682,05 EUR	2.537.872.175,85 USD	19/04/2022	2.537.872.175,85	(6.462.690,78)
20.552.024.578,12 ZAR	1.410.512.078,23 USD	19/04/2022	1.410.512.078,23	(6.717.768,67)
			<b>7.849.739.142,63</b>	<b>71.095.727,96</b>

Stückzahl	Bezeich- nung	Währung	Engagement in USD	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in USD
<b>Zins-Futures</b>				
(300)	EURO-BOBL FUTURE 08/06/2022	EUR	43.012.822,92	1.311.814,33
(378)	EURO-BUND FUTURE 08/06/2022	EUR	66.729.491,31	3.259.237,39
(391)	EURO-BUXL 30Y BOND 08/06/2022	EUR	81.005.591,66	6.035.988,18
(1.873)	US ULTRA BOND (CBT) 21/06/2022	USD	331.755.125,00	17.499.490,60
2.507	US 10YR NOTE (CBT) 21/06/2022	USD	308.047.625,00	(9.212.281,26)
1.151	US 2YR NOTE (CBT) 30/06/2022	USD	243.922.079,28	(2.125.452,06)
4.591	US 5YR NOTE (CBT) 30/06/2022	USD	526.530.312,50	(13.724.620,94)
			<b>1.601.003.047,67</b>	<b>3.044.176,24</b>

**Derivative Finanzinstrumente Gesamt 75.589.701,61**

### Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick

		% NIW
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	<b>5.191.067.734,55</b>	<b>91,48</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	<b>75.589.701,61</b>	<b>1,33</b>
<b>Bankguthaben</b>	<b>402.582.593,94</b>	<b>7,09</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>	<b>5.499.066,90</b>	<b>0,10</b>
<b>Nettovermögen Gesamt</b>	<b>5.674.739.097,00</b>	<b>100,00</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Emerging Markets Debt (Local Bond)

(ausgedrückt in USD)

### Statistische Angaben

### Anzahl der Anteile

<b>Nettovermögen</b>	31.03.2022	USD	234.273.166,11	Capitalisation I (USD)	31.03.2022	2.415		
	30.09.2021	USD	512.289.311,69		30.09.2021	2.411		
	30.09.2020	USD	324.808.260,12		30.09.2020	2.918		
<b>Nettoinventarwert pro Anteil**</b>				Capitalisation I Hedged (i) (PLN)	31.03.2022	2.264		
					30.09.2021	2.757		
					30.09.2020	4.268		
Capitalisation I (USD)	31.03.2022	USD	5.089,15	Capitalisation I Hedged (iv) (EUR)	31.03.2022	3.604		
	30.09.2021	USD	5.587,77		30.09.2021	4.088		
	30.09.2020	USD	5.469,93		30.09.2020	4.725		
Capitalisation I Hedged (i) (PLN)	31.03.2022	PLN	17.662,61	Capitalisation N Hedged (iv) (EUR)	31.03.2022	28.081		
	30.09.2021	PLN	19.350,94		30.09.2021	26.636		
	30.09.2020	PLN	19.117,05		30.09.2020	25.372		
Capitalisation I Hedged (iv) (EUR)	31.03.2022	EUR	5.452,13	Capitalisation P (USD)	31.03.2022	263		
	30.09.2021	EUR	5.887,71		30.09.2021	263		
	30.09.2020	EUR	5.764,68		30.09.2020	328		
Capitalisation N Hedged (iv) (EUR)	31.03.2022	EUR	239,47	Capitalisation P Hedged (iv) (EUR)	31.03.2022	44		
	30.09.2021	EUR	258,47		30.09.2021	44		
	30.09.2020	EUR	252,87		30.09.2020	44		
Capitalisation P (USD)	31.03.2022	USD	247,41	Capitalisation R Hedged (iv) (EUR)	31.03.2022	38		
	30.09.2021	USD	272,22		30.09.2021	38		
	30.09.2020	USD	267,60		30.09.2020	38		
Capitalisation P Hedged (iv) (EUR)	31.03.2022	EUR	229,32	Capitalisation X (USD)	31.03.2022	15.649		
	30.09.2021	EUR	248,24		30.09.2021	16.582		
	30.09.2020	EUR	244,23		30.09.2020	19.953		
Capitalisation R Hedged (iv) (EUR)	31.03.2022	EUR	231,27	Capitalisation Z (USD)	31.03.2022	-		
	30.09.2021	EUR	249,98		30.09.2021	-		
	30.09.2020	EUR	245,22		30.09.2020	1.631		
Capitalisation X (USD)	31.03.2022	USD	187,26	Capitalisation Zz (EUR)	31.03.2022	33.131		
	30.09.2021	USD	206,55		30.09.2021	75.856		
	30.09.2020	USD	204,06		30.09.2020	39.980		
Capitalisation Z (USD)	31.03.2022	USD	-	Capitalisation Zz Hedged (iv) (EUR)	31.03.2022	1.536		
	30.09.2021	USD	-		30.09.2021	1.536		
	30.09.2020	USD	4.922,12		30.09.2020	1.634		
Capitalisation Zz (EUR)	31.03.2022	EUR	4.663,08	Distribution I (EUR)	31.03.2022	-		
	30.09.2021	EUR	4.894,05		30.09.2021	1.603		
	30.09.2020	EUR	4.693,90		30.09.2020	1.527		
Capitalisation Zz Hedged (iv) (EUR)	31.03.2022	EUR	4.748,15	Distribution P (USD)	31.03.2022	25		
	30.09.2021	EUR	5.104,30		30.09.2021	25		
	30.09.2020	EUR	4.954,10		30.09.2020	25		
Distribution I (EUR)	31.03.2022	EUR	-	<b>Dividende</b>				
	30.09.2021	EUR	3.575,48		Distribution P (USD)	14.12.2021	USD	25,05
	30.09.2020	EUR	3.630,94					
Distribution P (USD)	31.03.2022	USD	535,18					
	30.09.2021	USD	614,86					
	30.09.2020	USD	631,07					

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

## NN (L) Emerging Markets Debt (Local Bond)

(ausgedrückt in USD)

### Statistische Angaben (Fortsetzung)

**Laufende Kosten in %\***

Capitalisation I (USD)	31.03.2022	0,88%
Capitalisation I Hedged (i) (PLN)	31.03.2022	0,90%
Capitalisation I Hedged (iv) (EUR)	31.03.2022	0,90%
Capitalisation N Hedged (iv) (EUR)	31.03.2022	0,82%
Capitalisation P (USD)	31.03.2022	1,30%
Capitalisation P Hedged (iv) (EUR)	31.03.2022	1,32%
Capitalisation R Hedged (iv) (EUR)	31.03.2022	1,04%
Capitalisation X (USD)	31.03.2022	1,80%
Capitalisation Zz (EUR)	31.03.2022	0,01%
Capitalisation Zz Hedged (iv) (EUR)	31.03.2022	0,03%
Distribution P (USD)	31.03.2022	1,30%
<b>Portfolioumsatz in %*</b>	31.03.2022	97,86%

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

## NN (L) Emerging Markets Debt (Local Bond)

(ausgedrückt in USD)

### Finanzabschlüsse

#### Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022

	Erläuterungen	
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	2	<b>223.261.697,94</b>
Anleihen und andere Schuldtitel		223.261.697,94
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	2	<b>284.652,32</b>
Zinsswaps		116.402,98
Devisentermingeschäfte		168.249,34
<b>Bankguthaben</b>		<b>8.620.546,95</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte</b>	4, 12	<b>5.022.871,40</b>
<b>Vermögenswerte Gesamt</b>		<b>237.189.768,61</b>
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>	4, 12	<b>(2.916.602,50)</b>
<b>Verbindlichkeiten Gesamt</b>		<b>(2.916.602,50)</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Berichtszeitraums</b>		<b>234.273.166,11</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.



## NN (L) Emerging Markets Debt (Local Bond)

(ausgedrückt in USD)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW	Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW
<b>Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>									
<b>Anleihen und andere Schuldtitel</b>									
<b>Malaysia</b>									
22.050.000	MALAYSIA GOVERNMENT BOND 3.502% 31/05/2027	MYR	5.226.543,16	2,24					
4.500.000	MALAYSIA GOVERNMENT BOND 3.733% 15/06/2028	MYR	1.067.126,57	0,46					
13.800.000	MALAYSIA GOVERNMENT BOND 3.828% 05/07/2034	MYR	3.149.123,57	1,34					
16.200.000	MALAYSIA GOVERNMENT BOND 3.885% 15/08/2029	MYR	3.853.115,65	1,64					
1.600.000	MALAYSIA GOVERNMENT BOND 4.065% 15/06/2050	MYR	352.085,42	0,15					
13.565.000	MALAYSIA GOVERNMENT BOND 4.181% 15/07/2024	MYR	3.319.713,71	1,42					
3.000	MALAYSIA GOVERNMENT BOND 4.392% 15/04/2026	MYR	740,01	0,00					
17.100.000	MALAYSIA GOVERNMENT INVESTMENT ISSUE 3.726% 31/03/2026	MYR	4.113.693,13	1,76					
18.400.000	MALAYSIA GOVERNMENT INVESTMENT ISSUE 4.258% 26/07/2027	MYR	4.507.373,27	1,92					
9.000.000	MALAYSIA GOVERNMENT INVESTMENT ISSUE 4.467% 15/09/2039	MYR	2.116.588,95	0,90					
			<b>27.706.103,44</b>	<b>11,83</b>					
<b>Brasilien</b>									
15.000.000	BRAZIL LETRAS DO TESOIRO NACIONAL ZCP 01/01/2024	BRL	2.585.619,12	1,10					
60.400.000	BRAZIL LETRAS DO TESOIRO NACIONAL ZCP 01/07/2023*	BRL	10.960.328,94	4,68					
30.000.000	BRAZIL NOTAS DO TESOIRO NACIONAL SERIE F 10.000% 01/01/2025*	BRL	6.104.870,04	2,61					
20.000.000	BRAZIL NOTAS DO TESOIRO NACIONAL SERIE F 10.000% 01/01/2029*	BRL	3.937.218,83	1,68					
			<b>23.588.036,93</b>	<b>10,07</b>					
<b>Südafrika</b>									
71.100.000	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA GOVERNMENT BOND 10.500% 21/12/2026	ZAR	5.308.263,43	2,26					
23.700.000	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA GOVERNMENT BOND 7.000% 28/02/2031	ZAR	1.352.710,43	0,58					
1.200.000	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA GOVERNMENT BOND 7.750% 28/02/2023	ZAR	83.783,76	0,04					
31.500.000	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA GOVERNMENT BOND 8.000% 31/01/2030	ZAR	1.969.632,93	0,84					
32.100.000	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA GOVERNMENT BOND 8.250% 31/03/2032	ZAR	1.962.052,37	0,84					
46.400.000	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA GOVERNMENT BOND 8.500% 31/01/2037	ZAR	2.705.210,50	1,15					
27.900.000	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA GOVERNMENT BOND 8.750% 28/02/2048	ZAR	1.605.510,44	0,69					
48.700.000	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA GOVERNMENT BOND 8.750% 31/01/2044	ZAR	2.807.996,01	1,19					
33.100.000	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA GOVERNMENT BOND 8.875% 28/02/2035	ZAR	2.035.100,65	0,87					
38.243.062	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA GOVERNMENT BOND 9.000% 31/01/2040	ZAR	2.285.576,91	0,98					
			<b>22.115.837,43</b>	<b>9,44</b>					
<b>China</b>									
28.000.000	CHINA GOVERNMENT BOND 1.990% 09/04/2025	CNY	4.347.179,95	1,86					
37.100.000	CHINA GOVERNMENT BOND 2.680% 21/05/2030	CNY	5.758.069,79	2,46					
20.000.000	CHINA GOVERNMENT BOND 2.850% 04/06/2027	CNY	3.181.194,56	1,36					
5.000.000	CHINA GOVERNMENT BOND 3.020% 27/05/2031	CNY	797.383,99	0,34					
30.000.000	CHINA GOVERNMENT BOND 3.120% 05/12/2026	CNY	4.831.146,44	2,06					
11.000.000	CHINA GOVERNMENT BOND 3.810% 14/09/2050	CNY	1.853.454,32	0,79					
			<b>20.768.429,05</b>	<b>8,87</b>					
<b>Mexiko</b>									
50.000.000	MEXICAN BONOS 10.000% 05/12/2024	MXN	2.606.230,02	1,11					
					88.000.000	MEXICAN BONOS 5.750% 05/03/2026	MXN	4.026.961,64	1,72
					51.000.000	MEXICAN BONOS 7.500% 03/06/2027	MXN	2.466.369,85	1,05
					38.000.000	MEXICAN BONOS 7.750% 13/11/2042	MXN	1.784.361,17	0,76
					19.000.000	MEXICAN BONOS 7.750% 23/11/2034	MXN	914.923,69	0,39
					40.000.000	MEXICAN BONOS 7.750% 29/05/2031	MXN	1.943.487,87	0,83
					83.000.000	MEXICAN BONOS 8.500% 18/11/2038	MXN	4.239.853,51	1,81
					53.000.000	MEXICAN BONOS 8.500% 31/05/2029	MXN	2.686.004,47	1,15
								<b>20.668.192,22</b>	<b>8,82</b>
<b>Indonesien</b>									
					6.000.000.000	INDONESIA TREASURY BOND 5.500% 15/04/2026	IDR	419.094,84	0,18
					29.000.000.000	INDONESIA TREASURY BOND 6.500% 15/02/2031	IDR	1.988.859,88	0,85
					1	INDONESIA TREASURY BOND 7.000% 15/05/2022	IDR	0,00	0,00
					1	INDONESIA TREASURY BOND 7.000% 15/05/2027	IDR	0,00	0,00
					101.000.000.000	INDONESIA TREASURY BOND 7.000% 15/09/2030	IDR	7.162.688,92	3,06
					1	INDONESIA TREASURY BOND 7.500% 15/08/2032	IDR	0,00	0,00
					24.000.000.000	INDONESIA TREASURY BOND 8.250% 15/05/2029	IDR	1.819.539,48	0,78
					18.000.000.000	INDONESIA TREASURY BOND 8.250% 15/05/2036	IDR	1.363.510,30	0,58
					49.000.000.000	INDONESIA TREASURY BOND 8.375% 15/03/2034	IDR	3.744.299,39	1,60
					8.000.000.000	INDONESIA TREASURY BOND 8.750% 15/05/2031	IDR	630.984,71	0,27
					22.500.000.000	INDONESIA TREASURY BOND 9.000% 15/03/2029	IDR	1.768.406,13	0,75
								<b>18.897.383,65</b>	<b>8,07</b>
<b>Thailand</b>									
					22.000.000	THAILAND GOVERNMENT BOND 1.000% 17/06/2027	THB	641.439,09	0,27
					51.311.000	THAILAND GOVERNMENT BOND 1.585% 17/12/2035	THB	1.317.716,70	0,56
					20.000.000	THAILAND GOVERNMENT BOND 2.000% 17/06/2042	THB	481.254,49	0,21
					62.000.000	THAILAND GOVERNMENT BOND 2.000% 17/12/2022	THB	1.884.841,66	0,80
					105.000.000	THAILAND GOVERNMENT BOND 2.000% 17/12/2031	THB	3.087.045,51	1,32
					6.600.000	THAILAND GOVERNMENT BOND 2.400% 17/12/2023	THB	204.171,73	0,09
					32.800.000	THAILAND GOVERNMENT BOND 2.875% 17/06/2046	THB	899.926,50	0,38
					44.000.000	THAILAND GOVERNMENT BOND 2.875% 17/12/2028	THB	1.388.360,61	0,59
					75.000.000	THAILAND GOVERNMENT BOND 3.300% 17/06/2038	THB	2.297.408,82	0,98
					43.000.000	THAILAND GOVERNMENT BOND 3.400% 17/06/2036	THB	1.355.121,00	0,58
					40.694.000	THAILAND GOVERNMENT BOND 3.650% 20/06/2031	THB	1.363.418,37	0,58
					29.000.000	THAILAND GOVERNMENT BOND 3.775% 25/06/2032	THB	981.285,62	0,42
					57.960.000	THAILAND GOVERNMENT BOND 4.875% 22/06/2029	THB	2.053.788,21	0,88
								<b>17.955.778,31</b>	<b>7,66</b>
<b>Polen</b>									
					9.800.000	POLAND GOVERNMENT BOND 0.250% 25/10/2026	PLN	1.860.829,29	0,79
					21.300.000	POLAND GOVERNMENT BOND 2.500% 25/04/2024	PLN	4.820.259,13	2,06
					23.600.000	POLAND GOVERNMENT BOND 2.500% 25/07/2026	PLN	5.008.060,22	2,13
					10.600.000	POLAND GOVERNMENT BOND 2.750% 25/04/2028	PLN	2.201.931,99	0,94
					8.650.000	POLAND GOVERNMENT BOND 2.750% 25/10/2029	PLN	1.769.682,71	0,76
								<b>15.660.763,34</b>	<b>6,68</b>
<b>Kolumbien</b>									
					3.000.000.000	COLOMBIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.375% 21/03/2023	COP	781.103,37	0,33
					344.000.000	COLOMBIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 9.850% 28/06/2027	COP	94.726,29	0,04
					1	COLOMBIAN TES 10.000% 24/07/2024	COP	0,00	0,00
					6.300.000.000	COLOMBIAN TES 6.000% 28/04/2028	COP	1.423.203,20	0,61

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Emerging Markets Debt (Local Bond)

(ausgedrückt in USD)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW	Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW
5.500.000.000	COLOMBIAN TES 7.000% 30/06/2032	COP	1.210.700,77	0,52	15.300.000	EGYPT GOVERNMENT BOND 14.556% 13/10/2027	EGP	818.175,72	0,35
7.317.200.000	COLOMBIAN TES 7.250% 18/10/2034	COP	1.601.289,22	0,68	8.000.000	EGYPT GOVERNMENT BOND 14.664% 06/10/2030	EGP	432.586,30	0,18
2.000.000.000	COLOMBIAN TES 7.250% 26/10/2050	COP	396.033,60	0,17				<b>2.399.304,23</b>	<b>1,02</b>
10.900.000.000	COLOMBIAN TES 7.500% 26/08/2026	COP	2.722.376,83	1,17		<b>Türkei</b>			
7.600.000.000	COLOMBIAN TES 7.750% 18/09/2030	COP	1.813.338,19	0,77	3.550.000	TURKEY GOVERNMENT BOND 10.500% 11/08/2027	TRY	142.138,58	0,06
			<b>10.042.771,47</b>	<b>4,29</b>	8.100.000	TURKEY GOVERNMENT BOND 10.600% 11/02/2026	TRY	369.190,86	0,16
					9.190.000	TURKEY GOVERNMENT BOND 12.600% 01/10/2025	TRY	461.017,22	0,20
	<b>Tschechische Republik</b>				28.450.000	TURKEY GOVERNMENT BOND 8.000% 12/03/2025	TRY	1.291.717,24	0,55
30.000.000	CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 0.950% 15/05/2030	CZK	1.105.450,77	0,47				<b>2.264.063,90</b>	<b>0,97</b>
107.500.000	CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 1.000% 26/06/2026	CZK	4.292.958,25	1,84		<b>Supranational-Multinational</b>			
54.000.000	CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 2.000% 13/10/2033	CZK	2.053.820,34	0,88	28.000.000.000	EUROPEAN INVESTMENT BANK 5.750% 24/01/2025 EMTN	IDR	1.985.320,40	0,84
39.800.000	CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 2.500% 25/08/2028	CZK	1.670.386,83	0,71				<b>1.985.320,40</b>	<b>0,84</b>
12.000.000	CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 4.200% 04/12/2036	CZK	571.219,51	0,24		<b>Südkorea</b>			
4.000.000	CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 5.700% 25/05/2024	CZK	185.870,75	0,08	14.000.000.000	EXPORT-IMPORT BANK OF KOREA 7.250% 07/12/2024 EMTN	IDR	1.013.191,88	0,43
			<b>9.879.706,45</b>	<b>4,22</b>				<b>1.013.191,88</b>	<b>0,43</b>
	<b>Ungarn</b>					<b>Republik Serbien</b>			
1.190.000.000	HUNGARY GOVERNMENT BOND 1.000% 26/11/2025	HUF	2.985.772,08	1,28	32.000.000	SERBIA TREASURY BONDS 4.500% 11/01/2026	RSD	291.694,71	0,12
270.000.000	HUNGARY GOVERNMENT BOND 2.250% 20/04/2033	HUF	576.738,97	0,25	45.000.000	SERBIA TREASURY BONDS 4.500% 20/08/2032	RSD	374.655,66	0,15
627.700.000	HUNGARY GOVERNMENT BOND 3.000% 21/08/2030	HUF	1.524.460,66	0,65				<b>666.350,37</b>	<b>0,27</b>
473.500.000	HUNGARY GOVERNMENT BOND 3.000% 26/06/2024	HUF	1.334.407,67	0,57		<b>Dominikanische Republik</b>			
440.000.000	HUNGARY GOVERNMENT BOND 3.000% 27/10/2027	HUF	1.124.569,95	0,48	11.000.000	DOMINICAN REPUBLIC INTERNATIONAL BOND 8.900% 15/02/2023	DOP	204.183,09	0,09
90.000.000	HUNGARY GOVERNMENT BOND 3.000% 27/10/2038	HUF	188.964,36	0,08	10.000.000	DOMINICAN REPUBLIC INTERNATIONAL BOND 9.750% 05/06/2026	DOP	185.580,45	0,08
81.000.000	HUNGARY GOVERNMENT BOND 3.250% 22/10/2031	HUF	197.190,97	0,08				<b>389.763,54</b>	<b>0,17</b>
			<b>7.932.104,66</b>	<b>3,39</b>		<b>Uruguay</b>			
	<b>Rumänien</b>				8.000.000	URUGUAY GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 8.250% 21/05/2031	UYU	185.790,75	0,08
4.640.000	ROMANIA GOVERNMENT BOND 3.650% 24/09/2031	RON	863.615,84	0,37	7.000.000	URUGUAY GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 8.500% 15/03/2028	UYU	167.224,28	0,07
8.780.000	ROMANIA GOVERNMENT BOND 4.750% 24/02/2025	RON	1.925.606,88	0,82				<b>353.015,03</b>	<b>0,15</b>
6.100.000	ROMANIA GOVERNMENT BOND 5.000% 12/02/2029	RON	1.291.544,57	0,55		<b>Philippinen</b>			
4.620.000	ROMANIA GOVERNMENT BOND 5.800% 26/07/2027	RON	1.030.785,02	0,44	10.000.000	PHILIPPINE GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.250% 14/01/2036	PHP	210.132,71	0,09
10.600.000	ROMANIA GOVERNMENT BOND 5.850% 26/04/2023	RON	2.411.826,33	1,03				<b>210.132,71</b>	<b>0,09</b>
			<b>7.523.378,64</b>	<b>3,21</b>				<b>222.000.073,77</b>	<b>94,76</b>
	<b>Chile</b>					<b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>			
2.310.000.000	BONOS DE LA TESORERIA DE LA REPUBLICA EN PESOS 4.500% 01/03/2026**	CLP	2.714.661,69	1,16		<b>Anleihen und andere Schuldtitel</b>			
1.050.000.000	BONOS DE LA TESORERIA DE LA REPUBLICA EN PESOS 4.700% 01/09/2030*	CLP	1.206.845,48	0,52		<b>Peru</b>			
350.000.000	BONOS DE LA TESORERIA DE LA REPUBLICA EN PESOS 5.000% 01/03/2035	CLP	399.869,80	0,17	2.800.000	PERUVIAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.900% 12/08/2037	PEN	745.281,74	0,32
660.000.000	BONOS DE LA TESORERIA DE LA REPUBLICA EN PESOS 6.000% 01/01/2043**	CLP	821.210,37	0,35				<b>745.281,74</b>	<b>0,32</b>
			<b>5.142.587,34</b>	<b>2,20</b>		<b>Russland</b>			
	<b>Peru</b>				288.000.000	RUSSIAN FEDERAL BOND - OFZ 7.000% 16/08/2023	RUB	104.918,03	0,04
4.370.000	ALICORP SAA 6.875% 17/04/2027	PEN	1.166.593,49	0,50	408.700.000	RUSSIAN FEDERAL BOND - OFZ 7.050% 19/01/2028	RUB	148.888,89	0,07
5.400.000	PERU GOVERNMENT BOND 5.940% 12/02/2029	PEN	1.410.237,44	0,60	150.200.000	RUSSIAN FEDERAL BOND - OFZ 7.250% 10/05/2034	RUB	54.717,67	0,02
8.700.000	PERU GOVERNMENT BOND 6.150% 12/08/2032	PEN	2.261.027,85	0,97	77.000.000	RUSSIAN FEDERAL BOND - OFZ 7.400% 17/07/2024	RUB	28.051,00	0,01
			<b>4.837.858,78</b>	<b>2,07</b>	200.000.000	RUSSIAN FEDERAL BOND - OFZ 7.650% 10/04/2030	RUB	72.859,74	0,03
	<b>Ägypten</b>								
2.000.000	EGYPT GOVERNMENT BOND 14.060% 12/01/2026	EGP	105.996,83	0,05					
13.000.000	EGYPT GOVERNMENT BOND 14.483% 06/04/2026	EGP	691.084,30	0,29					
6.500.000	EGYPT GOVERNMENT BOND 14.531% 14/09/2024	EGP	351.461,08	0,15					

\* Dirty Valued Bond/Swap (einschließlich Zinsforderungen).

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Emerging Markets Debt (Local Bond)

(ausgedrückt in USD)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW
54.000.000	RUSSIAN FEDERAL BOND - OFZ 7.700% 16/03/2039	RUB	19.672,13	0,01
140.460.000	RUSSIAN FEDERAL BOND - OFZ 7.950% 07/10/2026	RUB	51.169,40	0,02
99.000.000	RUSSIAN FEDERAL BOND - OFZ 8.500% 17/09/2031	RUB	36.065,57	0,02
			<b>516.342,43</b>	<b>0,22</b>
			<b>1.261.624,17</b>	<b>0,54</b>
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>			<b>223.261.697,94</b>	<b>95,30</b>

### Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022

Zu erhalten (%)	Zu zahlen (%)	Fälligkeits- datum	Währung	Nennwert	Swap-Wert in USD
<b>Zinsswaps</b>					
Floating	1.595	23/07/2031	KRW	9.150.000.000,00	660.222,87
Floating	1.485	29/06/2031	THB	102.000.000,00	187.573,34
1.013	Floating	12/05/2026	THB	114.000.000,00	(85.667,76)
0.955	Floating	29/06/2026	THB	101.000.000,00	(87.747,76)
2,078	1,500	23/11/2026	KRW	8.500.000.000,00	(197.351,48)
1.500	Floating	23/07/2026	KRW	8.780.000.000,00	(360.626,23)
					<b>116.402,98</b>

Zu erhalten	Zu zahlen	Fälligkeits- datum	Engagement in USD	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in USD	
<b>Devisentermingeschäfte</b>					
22.300.000,00	PLN	4.932.470,95	USD 25/04/2022	4.932.470,95	408.195,31
5.235.392,80	USD	406.000.000,00	RUB 04/04/2022	5.235.392,80	305.216,72
47.314.865,84	PLN	11.163.651,99	USD 19/04/2022	11.163.651,99	174.673,39
5.363.954,71	USD	21.770.000,00	PLN 25/04/2022	5.363.954,71	150.219,10
68.800.000,00	MXN	3.326.707,53	USD 02/05/2022	3.326.707,53	106.516,32
3.300.000,00	BRL	621.964,39	USD 11/05/2022	621.964,39	65.143,82
7.500.000,00	ZAR	484.980,85	USD 03/05/2022	484.980,85	26.382,71
148.500.000,00	CZK	6.729.016,32	USD 29/04/2022	6.729.016,32	15.355,50
30.000.000.000,00	IDR	2.083.579,18	USD 04/04/2022	2.083.579,18	5.193,67
1.292.230,11	USD	8.200.000,00	CNH 05/05/2022	1.292.230,11	3.116,92
110.000.000,00	CLP	136.679,92	USD 04/04/2022	136.679,92	3.104,68
400.000,00	PEN	105.681,99	USD 17/05/2022	105.681,99	1.570,36
5.604,40	USD	5.019,84	EUR 04/04/2022	5.604,40	19,07
7.672,28	USD	6.910,41	EUR 01/04/2022	7.672,28	(16,59)
12.500.000.000,00	IDR	871.505,00	USD 18/04/2022	871.505,00	(841,66)
10.000.000.000,00	IDR	696.229,50	USD 21/06/2022	696.229,50	(1.119,87)

\* Dirty Valued Bond/Swap (einschließlich Zinsforderungen).

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

Zu erhalten	Zu zahlen	Fälligkeits- datum	Engagement in USD	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in USD	
2.087.319,64	USD	30.000.000.000,00	IDR 04/04/2022	2.087.319,64	(1.453,22)
555.709,84	USD	8.000.000.000,00	IDR 18/04/2022	555.709,84	(1.514,69)
250.950,47	USD	200.000.000,00	CLP 04/04/2022	250.950,47	(3.203,36)
304.931,81	USD	1.160.000,00	PEN 17/05/2022	304.931,81	(6.100,01)
23.400.000,00	CNH	3.686.610,20	USD 05/05/2022	3.686.610,20	(7.921,35)
200.169,10	USD	4.200.000,00	MXN 02/05/2022	200.169,10	(9.417,24)
16.000.000,00	THB	491.732,74	USD 03/05/2022	491.732,74	(10.474,51)
3.729.201,88	USD	3.363.077,68	EUR 19/04/2022	3.729.201,88	(14.351,89)
292.395,38	USD	1.500.000,00	BRL 13/06/2022	292.395,38	(16.716,18)
20.700.000,00	ILS	6.510.291,76	USD 09/05/2022	6.510.291,76	(19.346,79)
430.150,54	USD	6.600.000,00	ZAR 03/05/2022	430.150,54	(19.849,39)
20.067.144,47	EUR	22.389.875,17	USD 19/04/2022	22.389.875,17	(52.468,36)
1.738.092,04	USD	7.505.813,56	PLN 19/04/2022	1.738.092,04	(60.567,96)
614.250,54	USD	3.300.000,00	BRL 11/05/2022	614.250,54	(72.857,67)
19.000.000,00	EGP	1.175.481,82	USD 02/06/2022	1.175.481,82	(143.480,71)
6.344.172,97	USD	20.700.000,00	ILS 09/05/2022	6.344.172,97	(146.772,00)
412.677.865,00	RUB	5.190.622,73	USD 04/04/2022	5.190.622,73	(179.355,40)
5.437.013,73	USD	126.950.000,00	CZK 29/04/2022	5.437.013,73	(328.629,38)
				<b>104.486.294,28</b>	<b>168.249,34</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>					<b>284.652,32</b>

### Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick

		% NIW
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	<b>223.261.697,94</b>	<b>95,30</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	<b>284.652,32</b>	<b>0,12</b>
<b>Bankguthaben</b>	<b>8.620.546,95</b>	<b>3,68</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>	<b>2.106.268,90</b>	<b>0,90</b>
<b>Nettovermögen Gesamt</b>	<b>234.273.166,11</b>	<b>100,00</b>

## NN (L) Emerging Markets Debt (Local Currency)

(ausgedrückt in USD)

### Statistische Angaben

<b>Nettovermögen</b>	31.03.2022	USD	31.371.933,66	Distribution R (USD)	31.03.2022	USD	29,36
	30.09.2021	USD	44.449.058,08		30.09.2021	USD	30,75
	30.09.2020	USD	52.790.927,05		30.09.2020	USD	30,95
<b>Nettoinventarwert pro Anteil**</b>				Distribution X (M) (USD)	31.03.2022	USD	65,59
					30.09.2021	USD	67,69
					30.09.2020	USD	68,33
Capitalisation I (USD)	31.03.2022	USD	56,66	Distribution Z Hedged (iv) (EUR)	31.03.2022	EUR	3.572,95
	30.09.2021	USD	57,76		30.09.2021	EUR	3.712,99
	30.09.2020	USD	56,18		30.09.2020	EUR	3.753,69
Capitalisation I Hedged (iv) (EUR)	31.03.2022	EUR	43,41	<b>Anzahl der Anteile</b>	Capitalisation I (USD)	31.03.2022	5.680
	30.09.2021	EUR	44,09			30.09.2021	209.466
	30.09.2020	EUR	43,12			30.09.2020	223.366
Capitalisation N (USD)	31.03.2022	USD	54,71	Capitalisation I Hedged (iv) (EUR)	31.03.2022	21.224	
	30.09.2021	USD	55,81		30.09.2021	20.970	
	30.09.2020	USD	54,24		30.09.2020	59.491	
Capitalisation N Hedged (iv) (EUR)	31.03.2022	EUR	41,06	Capitalisation N (USD)	31.03.2022	1.647	
	30.09.2021	EUR	41,68		30.09.2021	1.647	
	30.09.2020	EUR	40,72		30.09.2020	1.683	
Capitalisation P (USD)	31.03.2022	USD	52,48	Capitalisation N Hedged (iv) (EUR)	31.03.2022	5.807	
	30.09.2021	USD	53,66		30.09.2021	6.065	
	30.09.2020	USD	52,41		30.09.2020	8.132	
Capitalisation P Hedged (i) (SGD)	31.03.2022	SGD	9,50	Capitalisation P (USD)	31.03.2022	67.622	
	30.09.2021	SGD	9,71		30.09.2021	69.680	
	30.09.2020	SGD	-		30.09.2020	83.626	
Capitalisation P Hedged (iv) (EUR)	31.03.2022	EUR	39,27	Capitalisation P Hedged (i) (SGD)	31.03.2022	1.129	
	30.09.2021	EUR	39,97		30.09.2021	895	
	30.09.2020	EUR	39,25		30.09.2020	-	
Capitalisation R (USD)	31.03.2022	USD	53,15	Capitalisation P Hedged (iv) (EUR)	31.03.2022	88.069	
	30.09.2021	USD	54,27		30.09.2021	112.969	
	30.09.2020	USD	52,86		30.09.2020	161.038	
Capitalisation X (USD)	31.03.2022	USD	47,15	Capitalisation R (USD)	31.03.2022	9.449	
	30.09.2021	USD	48,33		30.09.2021	10.202	
	30.09.2020	USD	47,44		30.09.2020	12.820	
Capitalisation X Hedged (iv) (EUR)	31.03.2022	EUR	205,30	Capitalisation X (USD)	31.03.2022	84.445	
	30.09.2021	EUR	209,40		30.09.2021	89.309	
	30.09.2020	EUR	206,68		30.09.2020	115.909	
Capitalisation Zz Hedged (iv) (EUR)	31.03.2022	EUR	4.998,88	Capitalisation X Hedged (iv) (EUR)	31.03.2022	499	
	30.09.2021	EUR	5.055,85		30.09.2021	2.024	
	30.09.2020	EUR	4.902,43		30.09.2020	3.957	
Distribution N (USD)	31.03.2022	USD	29,37	Capitalisation Zz Hedged (iv) (EUR)	31.03.2022	1.586	
	30.09.2021	USD	30,78		30.09.2021	1.586	
	30.09.2020	USD	30,96		30.09.2020	1.691	
Distribution P (USD)	31.03.2022	USD	29,40				
	30.09.2021	USD	30,73				
	30.09.2020	USD	30,92				

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

## NN (L) Emerging Markets Debt (Local Currency)

(ausgedrückt in USD)

### Statistische Angaben (Fortsetzung)

<b>Anzahl der Anteile</b>			Capitalisation P Hedged (i) (SGD)	31.03.2022	1,33%
			Capitalisation P Hedged (iv) (EUR)	31.03.2022	1,33%
Distribution N (USD)	31.03.2022	7.398	Capitalisation R (USD)	31.03.2022	1,03%
	30.09.2021	8.392	Capitalisation X (USD)	31.03.2022	1,81%
	30.09.2020	8.884	Capitalisation X Hedged (iv) (EUR)	31.03.2022	1,82%
Distribution P (USD)	31.03.2022	6.932	Capitalisation Zz Hedged (iv) (EUR)	31.03.2022	0,04%
	30.09.2021	7.168	Distribution N (USD)	31.03.2022	0,81%
	30.09.2020	8.278	Distribution P (USD)	31.03.2022	1,31%
Distribution R (USD)	31.03.2022	15.036	Distribution R (USD)	31.03.2022	1,03%
	30.09.2021	15.036	Distribution X (M) (USD)	31.03.2022	1,81%
	30.09.2020	15.186	Distribution Z Hedged (iv) (EUR)	31.03.2022	0,13%
Distribution X (M) (USD)	31.03.2022	4.300	<b>Portfolioumsatz in %*</b>	31.03.2022	35,58%
	30.09.2021	4.300			
	30.09.2020	6.065			
Distribution Z Hedged (iv) (EUR)	31.03.2022	1.937			
	30.09.2021	1.401			
	30.09.2020	1.519			
<b>Dividende</b>					
Distribution N (USD)	14.12.2021	USD	0,80		
Distribution P (USD)	14.12.2021	USD	0,65		
Distribution R (USD)	14.12.2021	USD	0,75		
Distribution X (M) (USD)	02.03.2022	USD	0,07		
Distribution X (M) (USD)	02.02.2022	USD	0,07		
Distribution X (M) (USD)	04.01.2022	USD	0,07		
Distribution X (M) (USD)	02.12.2021	USD	0,08		
Distribution X (M) (USD)	02.11.2021	USD	0,08		
Distribution X (M) (USD)	04.10.2021	USD	0,08		
Distribution Z Hedged (iv) (EUR)	14.12.2021	EUR	94,60		
<b>Laufende Kosten in %*</b>					
Capitalisation I (USD)	31.03.2022		0,89%		
Capitalisation I Hedged (iv) (EUR)	31.03.2022		0,91%		
Capitalisation N (USD)	31.03.2022		0,81%		
Capitalisation N Hedged (iv) (EUR)	31.03.2022		0,83%		
Capitalisation P (USD)	31.03.2022		1,31%		

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

## NN (L) Emerging Markets Debt (Local Currency)

(ausgedrückt in USD)

### Finanzabschlüsse

#### Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022

	Erläuterungen	
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	2	<b>28.542.314,90</b>
Organismen für gemeinsame Anlagen		2.670.930,79
Anleihen und andere Schuldtitel		15.423.981,36
Geldmarktinstrumente		10.447.402,75
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	2	<b>21.353,27</b>
Credit Default Swaps		13.055,94
Zinsswaps		8.297,33
<b>Bankguthaben</b>		<b>4.477.302,33</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte</b>	4, 12	<b>808.267,26</b>
<b>Vermögenswerte Gesamt</b>		<b>33.849.237,76</b>
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>	4, 12	<b>(2.436.871,34)</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	2	<b>(40.432,76)</b>
Devisentermingeschäfte		(40.432,76)
<b>Verbindlichkeiten Gesamt</b>		<b>(2.477.304,10)</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Berichtszeitraums</b>		<b>31.371.933,66</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Emerging Markets Debt (Local Currency)

(ausgedrückt in USD)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW
<b>Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>				
<b>Anleihen und andere Schuldtitel</b>				
<b>Singapur</b>				
600.000	SINGAPORE GOVERNMENT BOND 1.750% 01/02/2023	SGD	444.449,72	1,42
3.590.000	SINGAPORE GOVERNMENT BOND 1.750% 01/04/2022	SGD	2.652.676,69	8,45
2.321.000	SINGAPORE GOVERNMENT BOND 3.125% 01/09/2022	SGD	1.728.432,30	5,51
			<b>4.825.558,71</b>	<b>15,38</b>
<b>Südkorea</b>				
3.400.000.000	KOREA TREASURY BOND 1.250% 10/12/2022	KRW	2.795.361,71	8,91
			<b>2.795.361,71</b>	<b>8,91</b>
<b>Brasilien</b>				
3.100.000	BRAZIL LETRAS DO TESOIRO NACIONAL ZCP 01/04/2022	BRL	652.076,43	2,08
5.350.000	BRAZIL LETRAS DO TESOIRO NACIONAL ZCP 01/07/2022*	BRL	1.094.084,47	3,48
1.530.000	BRAZIL LETRAS DO TESOIRO NACIONAL ZCP 01/10/2022	BRL	303.233,36	0,97
			<b>2.049.394,26</b>	<b>6,53</b>
<b>Malaysia</b>				
2.600.000	MALAYSIA GOVERNMENT BOND 3.480% 15/03/2023	MYR	626.083,62	2,00
2.040.000	MALAYSIA GOVERNMENT BOND 3.502% 31/05/2027	MYR	483.544,13	1,54
3.800.000	MALAYSIA GOVERNMENT BOND 3.795% 30/09/2022	MYR	912.660,18	2,91
			<b>2.022.287,93</b>	<b>6,45</b>
<b>Tschechische Republik</b>				
27.800.000	CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 0.100% 17/04/2022	CZK	1.262.304,14	4,03
			<b>1.262.304,14</b>	<b>4,03</b>
<b>Mexiko</b>				
21.000.000	MEXICAN BONOS 8.000% 07/12/2023	MXN	1.048.330,26	3,34
			<b>1.048.330,26</b>	<b>3,34</b>
<b>Israel</b>				
1.200.000	ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 0.750% 31/07/2022	ILS	376.767,40	1,20
790.000	ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 1.250% 30/11/2022	ILS	249.017,88	0,79
			<b>625.785,28</b>	<b>1,99</b>
<b>Ungarn</b>				
136.000.000	HUNGARY GOVERNMENT BOND 7.000% 24/06/2022	HUF	413.137,53	1,32
			<b>413.137,53</b>	<b>1,32</b>
<b>Rumänien</b>				
1.130.000	ROMANIA GOVERNMENT BOND 4.000% 08/08/2022	RON	253.794,64	0,81
			<b>253.794,64</b>	<b>0,81</b>
<b>Südafrika</b>				
1.500.000	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA GOVERNMENT BOND 10.500% 21/12/2026	ZAR	111.988,68	0,36
			<b>111.988,68</b>	<b>0,36</b>

\* Dirty Valued Bond/Swap (einschließlich Zinsforderungen).

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW
<b>China</b>				
100.000	CHINA GOVERNMENT BOND 3.190% 11/04/2024	CNY	16.038,22	0,05
			<b>16.038,22</b>	<b>0,05</b>
			<b>15.423.981,36</b>	<b>49,17</b>

<b>Geldmarktinstrumente</b>				
<b>Vereinigte Staaten</b>				
2.000.000	UNITED STATES TREASURY BILL ZCP 02/06/2022	USD	1.998.896,46	6,37
1.300.000	UNITED STATES TREASURY BILL ZCP 05/04/2022	USD	1.299.978,97	4,14
1.300.000	UNITED STATES TREASURY BILL ZCP 12/04/2022	USD	1.299.950,03	4,14
850.000	UNITED STATES TREASURY BILL ZCP 19/04/2022	USD	849.930,09	2,71
1.800.000	UNITED STATES TREASURY BILL ZCP 19/05/2022	USD	1.799.415,11	5,74
1.400.000	UNITED STATES TREASURY BILL ZCP 24/05/2022	USD	1.399.383,76	4,46
1.800.000	UNITED STATES TREASURY BILL ZCP 26/04/2022	USD	1.799.848,33	5,74
			<b>10.447.402,75</b>	<b>33,30</b>
			<b>10.447.402,75</b>	<b>33,30</b>

<b>Organismen für gemeinsame Anlagen</b>				
<b>Offene Fonds</b>				
<b>Luxemburg</b>				
536	NN (L) EMERGING MARKETS DEBT SHORT DURATION (HARD CURRENCY) - Z CAP USD	USD	2.670.930,79	8,51
			<b>2.670.930,79</b>	<b>8,51</b>
			<b>2.670.930,79</b>	<b>8,51</b>

**Wertpapierbestand Gesamt** **28.542.314,90** **90,98**

### Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022

Bezeichnung	Verkauf / Kauf	Zinssatz (%)	Fälligkeits- datum	Währung	Nennwert	Swap-Wert in USD
<b>Credit Default Swaps</b>						
CDS REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 1.000% 20/06/2025	Kauf	1,000	20/06/2027	USD	560.000,00	28.923,22
CDS REPUBLIC OF PERU 1.000% 20/12/2022	Kauf	1,000	20/06/2027	USD	530.000,00	(5.813,62)
CDS PEOPLE'S REPUBLIC OF CHINA 1.000%	Kauf	1,000	20/06/2027	USD	520.000,00	(10.053,66)
						<b>13.055,94</b>
<b>Zinsswaps</b>						
Zu erhalten (%)	Zu zahlen (%)	Fälligkeits- datum	Währung	Nennwert	Swap-Wert in USD	
Floating	1,595	23/07/2031	KRW	850.000.000,00	61.332,18	
Floating	2,048	23/11/2031	KRW	500.000.000,00	21.276,70	
1,500	Floating	23/07/2026	KRW	820.000.000,00	(33.680,36)	

## NN (L) Emerging Markets Debt (Local Currency)

(ausgedrückt in USD)

### Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Zu erhalten (%)	Zu zahlen (%)	Fälligkeitsdatum	Währung	Nennwert	Swap-Wert in USD	Zu erhalten	Zu zahlen	Fälligkeitsdatum	Engagement in USD	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in USD		
2,078	Floating	23/11/2026	KRW	1.750.000.000,00	(40.631,19)							
					<b>8.297,33</b>	3.100.000,00	EGP	168.112,80	USD	06/06/2022	168.112,80	114,03
						22.805,05	USD	1.730.000,00	INR	29/04/2022	22.805,05	62,63
						430.000,00	CZK	19.508,65	USD	19/04/2022	19.508,65	44,74
						39.457,08	USD	250.000,00	CNY	08/04/2022	39.457,08	38,67
						11.023,80	SGD	8.120,11	USD	19/04/2022	8.120,11	24,84
Zu erhalten	Zu zahlen	Fälligkeitsdatum	Engagement in USD	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in USD		221,80	USD	300,00	SGD	04/04/2022	221,80	0,13
						348,52	USD	473,80	SGD	19/04/2022	348,52	(1,55)
						1.350.722,66	USD	19.400.000.000,00	IDR	04/04/2022	1.350.722,66	(17,12)
						23.884,50	USD	100.000,00	PLN	10/05/2022	23.884,50	(27,25)
						19.415,67	USD	430.000,00	CZK	19/04/2022	19.415,67	(137,72)
						16.281,14	USD	13.000.000,00	CLP	18/04/2022	16.281,14	(198,55)
						20.400.000,00	MXN	955.786,07	USD	14/06/2022	955.786,07	53.929,87
						1.590.000,00	BRL	281.831,77	USD	06/04/2022	281.831,77	52.562,65
						3.190.000,00	PLN	713.728,73	USD	10/05/2022	713.728,73	49.056,17
						769.954,96	USD	59.800.000,00	RUB	11/04/2022	769.954,96	48.216,51
						7.400.000,00	TRY	473.142,39	USD	11/04/2022	473.142,39	29.541,88
						7.540.000,00	ZAR	486.427,43	USD	13/04/2022	486.427,43	28.985,26
						1.410.000,00	PEN	356.743,13	USD	12/04/2022	356.743,13	22.540,25
						275.400.000,00	CLP	328.123,62	USD	11/04/2022	328.123,62	21.450,83
						549.818,50	USD	17.660.000,00	THB	18/04/2022	549.818,50	18.674,02
						720.000.000,00	COP	176.513,94	USD	12/04/2022	176.513,94	15.090,12
						584.498,78	USD	19.000.000,00	THB	08/04/2022	584.498,78	13.072,67
						752.000.000,00	COP	188.434,74	USD	10/05/2022	188.434,74	10.874,99
						275.000.000,00	CLP	337.216,43	USD	16/05/2022	337.216,43	9.640,10
						689.671,04	USD	826.130.000,00	KRW	18/04/2022	689.671,04	8.961,84
						818.475,61	USD	1.100.200,00	SGD	01/04/2022	818.475,61	5.529,96
						14.990.000,00	PHP	283.104,81	USD	17/05/2022	283.104,81	5.307,42
						14.000.000,00	PHP	265.176,63	USD	19/04/2022	265.176,63	4.845,01
						11.330.000.000,00	IDR	784.471,79	USD	04/05/2022	784.471,79	4.393,58
						500.000,00	RON	107.865,19	USD	09/05/2022	107.865,19	4.176,26
						78.300.000,00	INR	1.025.326,81	USD	29/04/2022	1.025.326,81	3.997,12
						120.000.000,00	CLP	148.146,32	USD	18/04/2022	148.146,32	3.973,90
						1.800.000,00	ZAR	118.591,22	USD	18/05/2022	118.591,22	3.885,53
						1.890.000,00	CZK	83.396,45	USD	20/04/2022	83.396,45	2.536,84
						300.000,00	RON	65.066,96	USD	11/04/2022	65.066,96	2.421,66
						107.685,02	USD	470.000,00	RON	03/05/2022	107.685,02	2.273,27
						470.000,00	RON	102.631,34	USD	14/06/2022	102.631,34	2.135,86
						19.400.000.000,00	IDR	1.348.792,34	USD	04/04/2022	1.348.792,34	1.947,44
						13.900.000,00	CZK	630.002,63	USD	29/04/2022	630.002,63	1.288,74
						160.000,00	SGD	117.119,68	USD	01/04/2022	117.119,68	1.105,47
						24.372,76	USD	680.000,00	TWD	10/05/2022	24.372,76	582,40
						7.190.000,00	CNY	1.126.015,82	USD	08/07/2022	1.126.015,82	513,83
						60.000,00	ILS	18.401,56	USD	01/08/2022	18.401,56	482,40
						4.200.000.000,00	IDR	291.576,16	USD	01/07/2022	291.576,16	282,31
						72.089,58	USD	300.000,00	PLN	25/04/2022	72.089,58	242,05
											<b>53.453.814,33</b>	<b>(40.432,76)</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>										<b>(19.079,49)</b>		

\* Dirty Valued Bond/Swap (einschließlich Zinsforderungen).

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.



## NN (L) Emerging Markets Debt (Local Currency)

(ausgedrückt in USD)

### Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick

		% NIW
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	<b>28.542.314,90</b>	<b>90,98</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	<b>(19.079,49)</b>	<b>(0,06)</b>
<b>Bankguthaben</b>	<b>4.477.302,33</b>	<b>14,27</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>	<b>(1.628.604,08)</b>	<b>(5,19)</b>
<b>Nettovermögen Gesamt</b>	<b>31.371.933,66</b>	<b>100,00</b>

\* Dirty Valued Bond/Swap (einschließlich Zinsforderungen).

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Emerging Markets Debt Short Duration (Hard Currency)

(ausgedrückt in USD)

### Statistische Angaben

<b>Nettovermögen</b>	31.03.2022	USD	91.946.466,21
	30.09.2021	USD	102.935.994,80
	30.09.2020	USD	102.061.065,87
<b>Nettoinventarwert pro Anteil**</b>			
Capitalisation I (USD)	31.03.2022	USD	4.886,32
	30.09.2021	USD	5.435,84
	30.09.2020	USD	5.359,65
Capitalisation P Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	EUR	219,73
	30.09.2021	EUR	246,63
	30.09.2020	EUR	246,71
Capitalisation Z (USD)	31.03.2022	USD	4.983,74
	30.09.2021	USD	5.530,41
	30.09.2020	USD	5.425,72
<b>Anzahl der Anteile</b>			
Capitalisation I (USD)	31.03.2022		56
	30.09.2021		62
	30.09.2020		75
Capitalisation P Hedged (i) (EUR)	31.03.2022		9
	30.09.2021		9
	30.09.2020		29
Capitalisation Z (USD)	31.03.2022		18.394
	30.09.2021		18.551
	30.09.2020		18.735
<b>Laufende Kosten in %*</b>			
Capitalisation I (USD)	31.03.2022		0,66%
Capitalisation P Hedged (i) (EUR)	31.03.2022		1,22%
Capitalisation Z (USD)	31.03.2022		0,16%
<b>Portfolioumsatz in %*</b>	31.03.2022		73,95%

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

## NN (L) Emerging Markets Debt Short Duration (Hard Currency)

(ausgedrückt in USD)

### Finanzabschlüsse

#### Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022

	Erläuterungen	
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	2	<b>82.730.172,35</b>
Anleihen und andere Schuldtitel		82.730.172,35
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	2	<b>365.699,29</b>
Credit Default Swaps		254.136,79
Futures		111.562,50
<b>Bankguthaben</b>		<b>7.859.887,80</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte</b>	4	<b>8.117.885,56</b>
<b>Vermögenswerte Gesamt</b>		<b>99.073.645,00</b>
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>	4, 12	<b>(7.127.172,22)</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	2	<b>(6,57)</b>
Devisentermingeschäfte		(6,57)
<b>Verbindlichkeiten Gesamt</b>		<b>(7.127.178,79)</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Berichtszeitraums</b>		<b>91.946.466,21</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Emerging Markets Debt Short Duration (Hard Currency)

(ausgedrückt in USD)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW	Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW
<b>Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>					<b>Vereinigte Arabische Emirate</b>				
<b>Anleihen und andere Schuldtitel</b>					<b>Saudi-Arabien</b>				
<b>Jungferneinseln</b>					<b>Mexiko</b>				
500.000	ARCOS DORADOS HOLDINGS INC 6.625% 27/09/2023	USD	517.830,47	0,56	200.000	BBVA BANCORER SA/TEXAS 6.750% 30/09/2022	USD	203.308,71	0,22
200.000	BAIC FINANCE INVESTMENT CO LTD 2.000% 16/03/2024	USD	193.710,91	0,21	950.000	MEXICO CITY AIRPORT TRUST 4.250% 31/10/2026	USD	938.832,48	1,02
250.000	BEIJING GAS SINGAPORE CAPITAL CORP 1.875% 18/01/2025 EMTN	USD	240.134,87	0,26	521.000	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV 1.875% 11/05/2026	USD	488.846,90	0,53
200.000	BLUESTAR FINANCE HOLDINGS LTD 3.375% 16/07/2024	USD	198.742,79	0,22	1.000.000	PETROLEOS MEXICANOS 4.875% 18/01/2024	USD	1.013.734,02	1,10
700.000	CMHI FINANCE BVI CO LTD 4.375% 06/08/2023	USD	711.103,67	0,77	300.000	PETROLEOS MEXICANOS 6.500% 13/03/2027	USD	304.564,12	0,33
200.000	EASY TACTIC LTD 5.875% 13/02/2023	USD	42.104,52	0,05	500.000	PETROLEOS MEXICANOS 6.875% 04/08/2026	USD	522.785,60	0,57
200.000	EASY TACTIC LTD 8.125% 27/02/2023	USD	41.834,30	0,05	400.000	PETROLEOS MEXICANOS 6.875% 16/10/2025	USD	419.117,42	0,46
250.000	EASY TACTIC LTD 8.625% 27/02/2024	USD	50.437,79	0,05	400.000	TRUST FIBRA UNO 5.250% 15/12/2024	USD	412.310,20	0,45
200.000	FORTUNE STAR BVI LTD 5.000% 18/05/2026	USD	168.789,90	0,18	<b>4.303.499,45 4,68</b>				
200.000	FORTUNE STAR BVI LTD 5.950% 19/10/2025	USD	183.239,02	0,20	<b>Türkei</b>				
200.000	HONG SENG LTD 9.875% 27/08/2022	USD	55.438,04	0,06	300.000	HAZINE MUSTESARLI VARLIK KIRALAMA ANONIM SIRKETI 7.250% 24/02/2027	USD	301.292,27	0,33
200.000	LEVC FINANCE LTD 1.375% 25/03/2024	USD	192.816,53	0,21	330.000	ISTANBUL METROPOLITAN MUNICIPALITY 6.375% 09/12/2025	USD	302.192,54	0,33
250.000	MIDEA INVESTMENT DEVELOPMENT CO LTD 2.880% 24/02/2027	USD	240.376,16	0,26	718.000	TURKEY GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.750% 26/01/2026	USD	661.018,07	0,72
200.000	SHANGHAI PORT GROUP BVI DEVELOPMENT CO LTD 2.875% 18/06/2024	USD	198.748,31	0,22	350.000	TURKEY GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.875% 09/10/2026	USD	315.177,29	0,34
1.000.000	STATE GRID OVERSEAS INVESTMENT BVI LTD 2.750% 04/05/2022 EMTN	USD	1.000.108,61	1,09	600.000	TURKEY GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.750% 22/03/2024	USD	592.715,57	0,64
200.000	STUDIO CITY CO LTD 7.000% 15/02/2027	USD	190.081,98	0,21	1.000.000	TURKEY GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.350% 10/08/2024	USD	991.299,03	1,08
610.000	TALENT YIELD INVESTMENTS LTD 4.500% 25/04/2022	USD	610.586,16	0,66	740.000	TURKEY GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.375% 14/10/2025	USD	724.070,88	0,79
3.400.000	1MDB GLOBAL INVESTMENTS LTD 4.400% 09/03/2023	USD	3.322.473,74	3,61	300.000	TURKIYE IHRACAT KREDI BANKASI AS 5.750% 06/07/2026	USD	273.266,69	0,30
			<b>8.158.557,77</b>	<b>8,87</b>	<b>4.161.032,34 4,53</b>				
<b>Kaimaninseln</b>					<b>Indonesien</b>				
200.000	AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC 2.625% 02/06/2026	USD	179.680,07	0,20	400.000	BANK MANDIRI PERSERO TBK PT 4.750% 13/05/2025 EMTN	USD	413.646,99	0,45
300.000	ABQ FINANCE 3.125% 24/09/2024 EMTN	USD	298.470,61	0,32	200.000	BANK NEGARA INDONESIA PERSERO TBK PT 3.750% 30/03/2026 EMTN	USD	190.304,67	0,21
500.000	AGILE GROUP HOLDINGS LTD 5.750% 02/01/2025	USD	168.551,90	0,18	950.000	INDONESIA ASAHAN ALUMINIUM PERSERO PT 4.750% 15/05/2025	USD	971.008,33	1,06
200.000	CHINA HONGQIAO GROUP LTD 6.250% 08/06/2024	USD	192.212,08	0,21	1.000.000	PERTAMINA PERSERO PT 1.400% 09/02/2026	USD	926.030,94	1,00
660.000	CHINA OVERSEAS FINANCE CAYMAN V LTD 3.950% 15/11/2022	USD	662.232,42	0,72	1.000.000	PERUSAHAAN PENERBIT SBSN INDONESIA III 1.500% 09/06/2026	USD	944.494,53	1,03
800.000	CHINA OVERSEAS FINANCE CAYMAN VII LTD 4.250% 26/04/2023	USD	804.831,79	0,87	<b>3.445.485,46 3,75</b>				
1.000.000	DIB SUKUK LTD 1.500% 22/06/2026 EMTN	USD	943.664,26	1,02	<b>Katar</b>				
270.000	DIB SUKUK LTD 3.625% 06/02/2023	USD	272.821,01	0,30	400.000	QATAR ENERGY 1.375% 12/09/2026	USD	373.026,98	0,41
200.000	HPHT FINANCE 21 LTD 2.000% 19/03/2026	USD	189.469,90	0,21	1.000.000	QATAR GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.375% 14/03/2024	USD	1.015.309,32	1,10
500.000	INDUSTRIAL SENIOR TRUST 5.500% 01/11/2022	USD	502.312,47	0,55	<b>7.350.323,54 7,99</b>				
299.526	INTEROCEANICA IV FINANCE LTD ZCP 30/11/2025	USD	278.768,82	0,30					
386.503	PERU ENHANCED PASS-THROUGH FINANCE LTD ZCP 02/06/2025	USD	366.424,19	0,40					
1.400.000	QIB SUKUK LTD 3.982% 26/03/2024 EMTN	USD	1.420.001,00	1,53					
400.000	QNB FINANCE LTD 3.500% 28/03/2024 EMTN	USD	401.929,00	0,44					
400.000	REDSUN PROPERTIES GROUP LTD 7.300% 13/01/2025	USD	60.736,87	0,07					
62.012	SPARC EM SPC PANAMA METRO LINE 2 SP ZCP 05/12/2022	USD	61.160,91	0,07					
250.000	SUN HUNG KAI PROPERTIES CAPITAL MARKET LTD 3.625% 16/01/2023 EMTN	USD	251.475,24	0,27					
200.000	TIMES CHINA HOLDINGS LTD 5.550% 04/06/2024	USD	89.885,71	0,10					
300.000	TIMES CHINA HOLDINGS LTD 6.200% 22/03/2026	USD	117.023,99	0,13					
200.000	YUZHOU GROUP HOLDINGS CO LTD 8.375% 30/10/2024	USD	26.746,66	0,03					
200.000	YUZHOU GROUP HOLDINGS CO LTD 8.500% 04/02/2023	USD	28.563,84	0,03					
300.000	ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD 7.100% 10/09/2024	USD	33.360,80	0,04					

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Emerging Markets Debt Short Duration (Hard Currency)

(ausgedrückt in USD)

## Wertpapierbestand zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW	Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW
1.550.000	QATAR GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.875% 23/04/2023	USD	1.577.250,98	1,72	506.000	SEPLAT ENERGY PLC 7.750% 01/04/2026	USD	484.672,61	0,53
			<b>2.965.587,28</b>	<b>3,23</b>				<b>1.717.140,74</b>	<b>1,87</b>
<b>Kolumbien</b>					<b>Singapur</b>				
500.000	BANCO DE BOGOTA SA 5.375% 19/02/2023	USD	510.710,65	0,56	300.000	GLOBAL PRIME CAPITAL PTE LTD 5.950% 23/01/2025	USD	289.892,78	0,32
500.000	BANCOLOMBIA SA 3.000% 29/01/2025	USD	485.750,34	0,53	285.000	LMIRT CAPITAL PTE LTD 7.250% 19/06/2024	USD	283.842,12	0,31
400.000	COLOMBIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.000% 26/02/2024	USD	400.455,39	0,44	500.000	ONGC VIDESH VANKORNEFT PTE LTD 3.750% 27/07/2026	USD	491.288,91	0,53
500.000	COLOMBIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.500% 28/01/2026	USD	499.721,37	0,53	600.000	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP LTD 4.250% 19/06/2024 EMTN	USD	611.962,63	0,66
450.000	ECOPETROL SA 4.125% 16/01/2025	USD	443.431,53	0,48				<b>1.676.986,44</b>	<b>1,82</b>
500.000	GRUPOSURA FINANCE SA 5.500% 29/04/2026	USD	504.961,81	0,55					
			<b>2.845.031,09</b>	<b>3,09</b>	<b>Südafrika</b>				
<b>Bermuda</b>					1.000.000	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.875% 14/04/2026	USD	1.016.934,96	1,11
250.000	BERMUDA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.717% 25/01/2027	USD	253.570,86	0,28	600.000	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.875% 16/09/2025	USD	634.584,55	0,69
600.000	BERMUDA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.138% 03/01/2023	USD	606.467,32	0,66				<b>1.651.519,51</b>	<b>1,80</b>
600.000	BERMUDA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.854% 06/02/2024	USD	619.645,16	0,67	<b>Pakistan</b>				
1.000.000	CBQ FINANCE LTD 2.000% 12/05/2026 EMTN	USD	943.793,76	1,02	750.000	PAKISTAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.000% 08/04/2026 EMTN	USD	575.200,05	0,63
200.000	CHINA OIL & GAS GROUP LTD 4.700% 30/06/2026	USD	190.415,71	0,21	900.000	PAKISTAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 8.250% 15/04/2024	USD	770.322,21	0,84
200.000	CHINA OIL & GAS GROUP LTD 5.500% 25/01/2023	USD	200.437,59	0,22	300.000	THIRD PAKISTAN INTERNATIONAL SUKUK CO LTD/THE 5.625% 05/12/2022	USD	287.569,68	0,31
			<b>2.814.330,40</b>	<b>3,06</b>				<b>1.633.091,94</b>	<b>1,78</b>
<b>Dominikanische Republik</b>					<b>Supranational-Multinational</b>				
1.750.000	BANCO DE RESERVAS DE LA REPUBLICA DOMINICANA 7.000% 01/02/2023	USD	1.776.300,12	1,93	333.000	AFRICAN EXPORT-IMPORT BANK/THE 2.634% 17/05/2026	USD	309.860,35	0,34
550.000	DOMINICAN REPUBLIC INTERNATIONAL BOND 5.500% 27/01/2025	USD	569.236,89	0,62	660.000	AFRICAN EXPORT-IMPORT BANK/THE 5.250% 11/10/2023 EMTN	USD	670.040,02	0,73
300.000	DOMINICAN REPUBLIC INTERNATIONAL BOND 5.950% 25/01/2027	USD	308.397,19	0,34	500.000	ATP TOWER HOLDINGS LLC / ANDEAN TOWER PARTNERS COLOMBIA SAS / ANDEAN TELECOM PAR 4.050% 27/04/2026	USD	477.033,28	0,52
			<b>2.653.934,20</b>	<b>2,89</b>				<b>1.456.933,65</b>	<b>1,59</b>
<b>Oman</b>					<b>Peru</b>				
200.000	OMAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.125% 17/01/2023	USD	202.062,96	0,22	1.400.000	PERUVIAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 2.392% 23/01/2026	USD	1.361.570,70	1,48
750.000	OMAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.750% 15/06/2026	USD	753.445,86	0,81				<b>1.361.570,70</b>	<b>1,48</b>
735.000	OMAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.875% 01/02/2025 EMTN	USD	749.727,07	0,82	<b>Trinidad und Tobago</b>				
400.000	OMAN SOVEREIGN SUKUK CO 4.397% 01/06/2024	USD	404.453,74	0,44	300.000	TRINIDAD & TOBAGO GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.375% 16/01/2024	USD	303.840,68	0,33
			<b>2.109.689,63</b>	<b>2,29</b>	600.000	TRINIDAD & TOBAGO GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.500% 04/08/2026	USD	599.987,31	0,65
<b>Ägypten</b>					323.125	TRINIDAD PETROLEUM HOLDINGS LTD 6.000% 08/05/2022	USD	322.281,23	0,35
744.000	EGYPT GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.875% 16/02/2026 EMTN	USD	666.093,75	0,73				<b>1.226.109,22</b>	<b>1,33</b>
230.000	EGYPT GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.250% 06/10/2025	USD	221.776,57	0,24	<b>China</b>				
650.000	EGYPT GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.750% 29/05/2024	USD	645.494,06	0,70	600.000	SHOUGANG GROUP CO LTD 4.000% 23/05/2024	USD	602.082,14	0,65
300.000	EGYPT GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.200% 01/03/2024 EMTN	USD	301.357,27	0,33	600.000	ZHEJIANG EXPRESSWAY CO LTD 1.638% 14/07/2026	USD	558.001,36	0,61
			<b>1.834.721,65</b>	<b>2,00</b>				<b>1.160.083,50</b>	<b>1,26</b>
<b>Vereinigte Staaten</b>					<b>Brazilien</b>				
500.000	KOSMOS ENERGY LTD 7.125% 04/04/2026	USD	491.150,54	0,54	595.000	BRAZILIAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 2.875% 06/06/2025	USD	583.538,01	0,63
500.000	NBM US HOLDINGS INC 7.000% 15/05/2026	USD	518.733,10	0,56	500.000	BRF SA 4.750% 22/05/2024	USD	505.583,07	0,55
500.000	STILLWATER MINING CO 4.000% 16/11/2026	USD	480.645,08	0,52				<b>1.089.121,08</b>	<b>1,18</b>
300.000	WIPRO IT SERVICES LLC 1.500% 23/06/2026	USD	276.207,25	0,30	<b>Rumänien</b>				
			<b>1.766.735,97</b>	<b>1,92</b>	500.000	ROMANIA GOVERNMENT BOND 3.000% 27/02/2027	USD	485.608,41	0,53
<b>Nigeria</b>					500.000	ROMANIAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.875% 22/01/2024 EMTN	USD	516.435,99	0,56
800.000	NIGERIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.375% 12/07/2023	USD	816.778,06	0,89				<b>1.002.044,40</b>	<b>1,09</b>
400.000	NIGERIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.625% 21/11/2025	USD	415.690,07	0,45					

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Emerging Markets Debt Short Duration (Hard Currency)

(ausgedrückt in USD)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW	Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW
<b>Luxemburg</b>					<b>Panama</b>				
400.000	AEGEA FINANCE SARL 5.750% 10/10/2024	USD	403.024,42	0,44	500.000	PANAMA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.125% 29/01/2026	USD	570.770,64	0,62
500.000	FS LUXEMBOURG SARL 10.000% 15/12/2025	USD	525.063,19	0,57				<b>570.770,64</b>	<b>0,62</b>
			<b>928.087,61</b>	<b>1,01</b>					
<b>Chile</b>					<b>Südkorea</b>				
528.000	CHILE GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 2.750% 31/01/2027	USD	517.094,29	0,56	400.000	KB KOOKMIN CARD 1.500% 13/05/2026	USD	372.157,67	0,40
300.000	CORP NACIONAL DEL COBRE DE CHILE 3.000% 17/07/2022	USD	300.175,63	0,33	200.000	MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD 2.625% 30/07/2025	USD	193.150,88	0,21
			<b>817.269,92</b>	<b>0,89</b>				<b>565.308,55</b>	<b>0,61</b>
<b>Vereinigtes Königreich</b>					<b>Kuwait</b>				
716.000	ENDEAVOUR MINING PLC 5.000% 14/10/2026	USD	656.481,81	0,72	500.000	KUWAIT INTERNATIONAL GOVERNMENT BOND 3.500% 20/03/2027	USD	520.647,85	0,57
202.000	UKRAINE RAILWAYS VIA RAIL CAPITAL MARKETS PLC 7.875% 15/07/2026	USD	56.968,42	0,06				<b>520.647,85</b>	<b>0,57</b>
310.000	UKRAINE RAILWAYS VIA RAIL CAPITAL MARKETS PLC 8.250% 09/07/2024	USD	91.518,98	0,10					
			<b>804.969,21</b>	<b>0,88</b>					
<b>Kenia</b>					<b>Mauritius</b>				
800.000	REPUBLIC OF KENYA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.875% 24/06/2024	USD	803.047,36	0,87	480.000	GREENKO INVESTMENT CO 4.875% 16/08/2023	USD	480.064,16	0,52
			<b>803.047,36</b>	<b>0,87</b>				<b>480.064,16</b>	<b>0,52</b>
<b>Israel</b>					<b>Philippinen</b>				
800.000	ENERGEAN ISRAEL FINANCE LTD 4.500% 30/03/2024	USD	794.035,74	0,86	400.000	PHILIPPINE GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.229% 29/03/2027	USD	405.750,24	0,44
			<b>794.035,74</b>	<b>0,86</b>				<b>405.750,24</b>	<b>0,44</b>
<b>Georgien</b>					<b>Malaysia</b>				
700.000	TBC BANK JSC 5.750% 19/06/2024 EMTN	USD	722.111,24	0,79	400.000	PETRONAS CAPITAL LTD 7.875% 22/05/2022	USD	402.966,15	0,44
			<b>722.111,24</b>	<b>0,79</b>				<b>402.966,15</b>	<b>0,44</b>
<b>Indien</b>					<b>Polen</b>				
300.000	ADANI GREEN ENERGY LTD 4.375% 08/09/2024	USD	293.593,18	0,32	300.000	POLAND GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.250% 06/04/2026	USD	305.477,58	0,33
400.000	BHARTI AIRTEL LTD 4.375% 10/06/2025	USD	404.928,98	0,44				<b>305.477,58</b>	<b>0,33</b>
			<b>698.522,16</b>	<b>0,76</b>					
<b>Honduras</b>					<b>Aserbaidschan</b>				
666.700	HONDURAS GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.500% 15/03/2024	USD	663.208,19	0,72	300.000	REPUBLIC OF AZERBAIJAN INTERNATIONAL BOND 4.750% 18/03/2024	USD	304.634,07	0,33
			<b>663.208,19</b>	<b>0,72</b>				<b>304.634,07</b>	<b>0,33</b>
<b>Jordanien</b>					<b>Schweden</b>				
610.000	JORDAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.950% 07/07/2025	USD	608.789,78	0,66	300.000	POWSZECHNA KASA OSZCZEDNOSCI BANK POLSKI SA VIA PKO FINANCE AB 4.630% 26/09/2022	USD	301.599,06	0,33
			<b>608.789,78</b>	<b>0,66</b>				<b>301.599,06</b>	<b>0,33</b>
<b>Niederlande</b>					<b>Namibia</b>				
595.000	SABIC CAPITAL II BV 4.000% 10/10/2023	USD	606.654,89	0,66	300.000	NAMIBIA INTERNATIONAL BONDS 5.250% 29/10/2025	USD	301.378,23	0,33
			<b>606.654,89</b>	<b>0,66</b>				<b>301.378,23</b>	<b>0,33</b>
<b>Paraguay</b>					<b>Thailand</b>				
630.000	BANCO CONTINENTAL SAECA 2.750% 10/12/2025	USD	576.938,85	0,63	300.000	INDORAMA VENTURES GLOBAL SERVICES LTD 4.375% 12/09/2024 EMTN	USD	295.045,18	0,32
			<b>576.938,85</b>	<b>0,63</b>				<b>295.045,18</b>	<b>0,32</b>
<b>Hongkong</b>					<b>Angola</b>				
200.000	CNAC HK FINBRIDGE CO LTD 4.875% 14/03/2025	USD	205.460,95	0,23	200.000	ANGOLAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 9.500% 12/11/2025	USD	219.324,40	0,24
200.000	FAR EAST HORIZON LTD 2.625% 03/03/2024 EMTN	USD	187.089,18	0,20				<b>219.324,40</b>	<b>0,24</b>
200.000	FAR EAST HORIZON LTD 3.375% 18/02/2025 EMTN	USD	183.465,37	0,20					
			<b>576.015,50</b>	<b>0,63</b>					
					<b>Ukraine</b>				
					240.000	NPC UKRENERGO 6.875% 09/11/2026	USD	89.822,33	0,10
					300.000	UKRAINE GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.750% 01/09/2025	USD	128.898,04	0,14
								<b>218.720,37</b>	<b>0,24</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Emerging Markets Debt Short Duration (Hard Currency)

(ausgedrückt in USD)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW
<b>Ghana</b>				
300.000	GHANA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND ZCP 07/04/2025	USD	195.404,62	0,21
			<b>195.404,62</b>	<b>0,21</b>
<b>Weißrussland</b>				
650.000	DEVELOPMENT BANK OF THE REPUBLIC OF BELARUS ISC 6.750% 02/05/2024	USD	38.209,70	0,04
300.000	REPUBLIC OF BELARUS INTERNATIONAL BOND 5.875% 24/02/2026	USD	45.000,00	0,05
			<b>83.209,70</b>	<b>0,09</b>
<b>Irland</b>				
800.000	SOVCOMBANK 3.400% 26/01/2025	USD	40.000,00	0,04
			<b>40.000,00</b>	<b>0,04</b>
			<b>82.686.172,35</b>	<b>89,93</b>
<b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>				
<b>Anleihen und andere Schuldtitel</b>				
<b>Russland</b>				
200.000	RUSSIAN FOREIGN BOND - EUROBOND 4.750% 27/05/2026	USD	44.000,00	0,05
			<b>44.000,00</b>	<b>0,05</b>
			<b>44.000,00</b>	<b>0,05</b>

**Wertpapierbestand Gesamt 82.730.172,35 89,98**

### Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022

Bezeichnung	Verkauf / Kauf	Zinssatz (%)	Fälligkeits- datum	Währung	Nennwert	Swap-Wert in USD
<b>Credit Default Swaps</b>						
CDS REPUBLIC OF TURKEY 5.000% 20/06/2024	Kauf	1,000	20/06/2024	USD	1.000.000,00	87.355,91
CDS REPUBLIC OF TURKEY 5.000% 20/06/2024	Kauf	1,000	20/12/2024	USD	750.000,00	79.434,90
CDS REPUBLIC OF TURKEY 5.000% 20/06/2024	Kauf	1,000	20/06/2027	USD	400.000,00	75.041,50
CDS REPUBLIC OF TURKEY 5.000% 20/06/2024	Kauf	1,000	20/12/2025	USD	500.000,00	70.306,36
CDS PEOPLE'S REPUBLIC OF CHINA 1.000% 20/06/2027	Kauf	1,000	20/06/2027	USD	1.000.000,00	(19.333,96)
CDS PEOPLE'S REPUBLIC OF CHINA 1.000% 20/06/2027	Kauf	1,000	20/06/2027	USD	2.000.000,00	(38.667,92)
						<b>254.136,79</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

Zu erhalten	Zu zahlen	Fälligkeits- datum	Engagement in USD	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in USD
<b>Devisentermingeschäfte</b>				
175,07 USD	157,21 EUR	19/04/2022	175,07	0,07
2.200,20 EUR	2.455,76 USD	19/04/2022	2.455,76	(6,64)
			<b>2.630,83</b>	<b>(6,57)</b>
<b>Zins-Future</b>				
(35) US 5YR NOTE (CBT) 30/06/2022		USD	4.014.062,50	111.562,50
			<b>4.014.062,50</b>	<b>111.562,50</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>				<b>365.692,72</b>

### Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick

		% NIW
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	<b>82.730.172,35</b>	<b>89,98</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	<b>365.692,72</b>	<b>0,40</b>
<b>Bankguthaben</b>	<b>7.859.887,80</b>	<b>8,55</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>	<b>990.713,34</b>	<b>1,07</b>
<b>Nettovermögen Gesamt</b>	<b>91.946.466,21</b>	<b>100,00</b>

## NN (L) Emerging Markets Enhanced Index Sustainable Equity

(ausgedrückt in USD)

### Statistische Angaben

<b>Nettovermögen</b>	31.03.2022	USD	763.006.279,33	Distribution R (USD)	31.03.2022	USD	248,07
	30.09.2021	USD	700.781.355,34		30.09.2021	USD	276,21
	30.09.2020	USD	197.163.900,26		30.09.2020	USD	237,22
<b>Nettoinventarwert pro Anteil**</b>				<b>Anzahl der Anteile</b>			
	<b>Capitalisation I (EUR)</b>				<b>Capitalisation I (EUR)</b>		
	31.03.2022	EUR	5.457,86		31.03.2022		22.129
30.09.2021	EUR	5.726,31	30.09.2021		13.607		
30.09.2020	EUR	-	30.09.2020		-		
<b>Capitalisation I (USD)</b>			<b>Capitalisation I (USD)</b>				
31.03.2022	USD	4.478,02	31.03.2022		600		
30.09.2021	USD	4.893,76	30.09.2021		400		
30.09.2020	USD	4.135,23	30.09.2020		735		
<b>Capitalisation I Hedged (i) (PLN)</b>			<b>Capitalisation I Hedged (i) (PLN)</b>				
31.03.2022	PLN	17.836,78	31.03.2022		8.400		
30.09.2021	PLN	19.462,29	30.09.2021		7.197		
30.09.2020	PLN	16.625,59	30.09.2020		4.366		
<b>Capitalisation N (EUR)</b>			<b>Capitalisation N (EUR)</b>				
31.03.2022	EUR	365,12	31.03.2022		1.711		
30.09.2021	EUR	383,25	30.09.2021		1.453		
30.09.2020	EUR	320,37	30.09.2020		1.326		
<b>Capitalisation P (EUR)</b>			<b>Capitalisation P (EUR)</b>				
31.03.2022	EUR	345,93	31.03.2022		3.568		
30.09.2021	EUR	363,57	30.09.2021		3.158		
30.09.2020	EUR	304,68	30.09.2020		3.220		
<b>Capitalisation P (USD)</b>			<b>Capitalisation P (USD)</b>				
31.03.2022	USD	2.237,16	31.03.2022		10.262		
30.09.2021	USD	2.449,00	30.09.2021		10.034		
30.09.2020	USD	2.076,54	30.09.2020		10.223		
<b>Capitalisation R (USD)</b>			<b>Capitalisation R (USD)</b>				
31.03.2022	USD	268,82	31.03.2022		2.124		
30.09.2021	USD	293,91	30.09.2021		2.675		
30.09.2020	USD	248,59	30.09.2020		2.903		
<b>Capitalisation X (HUF)</b>			<b>Capitalisation X (HUF)</b>				
31.03.2022	HUF	58.894,86	31.03.2022		331		
30.09.2021	HUF	60.695,17	30.09.2021		334		
30.09.2020	HUF	51.679,17	30.09.2020		517		
<b>Capitalisation X (USD)</b>			<b>Capitalisation X (USD)</b>				
31.03.2022	USD	2.027,92	31.03.2022		3.154		
30.09.2021	USD	2.225,27	30.09.2021		3.402		
30.09.2020	USD	1.895,82	30.09.2020		2.991		
<b>Capitalisation X Hedged (i) (EUR)</b>			<b>Capitalisation X Hedged (i) (EUR)</b>				
31.03.2022	EUR	208,53	31.03.2022		8		
30.09.2021	EUR	230,75	30.09.2021		8		
30.09.2020	EUR	-	30.09.2020		-		
<b>Capitalisation Y (USD)</b>			<b>Capitalisation Y (USD)</b>				
31.03.2022	USD	186,68	31.03.2022		3.380		
30.09.2021	USD	205,87	30.09.2021		10.811		
30.09.2020	USD	177,20	30.09.2020		10.161		
<b>Capitalisation Z (EUR)</b>			<b>Capitalisation Z (EUR)</b>				
31.03.2022	EUR	125.810,93	31.03.2022		3.964		
30.09.2021	EUR	131.932,67	30.09.2021		3.486		
30.09.2020	EUR	110.076,97	30.09.2020		1.096		
<b>Distribution P (USD)</b>			<b>Distribution P (USD)</b>				
31.03.2022	USD	1.395,20	31.03.2022		1.147		
30.09.2021	USD	1.551,26	30.09.2021		1.361		
30.09.2020	USD	1.332,92	30.09.2020		1.423		

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.



## NN (L) Emerging Markets Enhanced Index Sustainable Equity

(ausgedrückt in USD)

### Statistische Angaben (Fortsetzung)

#### Anzahl der Anteile

Distribution R (USD)	31.03.2022	3.244
	30.09.2021	3.328
	30.09.2020	3.485

#### Dividende

Distribution P (USD)	14.12.2021	USD	23,30
Distribution R (USD)	14.12.2021	USD	4,85

#### Laufende Kosten in %\*

Capitalisation I (EUR)	31.03.2022	0,26%
Capitalisation I (USD)	31.03.2022	0,26%
Capitalisation I Hedged (i) (PLN)	31.03.2022	0,28%
Capitalisation N (EUR)	31.03.2022	0,35%
Capitalisation P (EUR)	31.03.2022	0,60%
Capitalisation P (USD)	31.03.2022	0,60%
Capitalisation R (USD)	31.03.2022	0,35%
Capitalisation X (HUF)	31.03.2022	1,10%
Capitalisation X (USD)	31.03.2022	1,10%
Capitalisation X Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	1,09%
Capitalisation Y (USD)	31.03.2022	2,09%
Capitalisation Z (EUR)	31.03.2022	0,16%
Distribution P (USD)	31.03.2022	0,60%
Distribution R (USD)	31.03.2022	0,35%
<b>Portfolioumsatz in %*</b>	31.03.2022	<b>86,04%</b>

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

## NN (L) Emerging Markets Enhanced Index Sustainable Equity

(ausgedrückt in USD)

### Finanzabschlüsse

#### Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022

	Erläuterungen	
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	2	<b>757.005.402,58</b>
Aktien		757.003.882,50
Anleihen und andere Schuldtitel		1.520,08
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	2	<b>478.275,74</b>
Devisentermingeschäfte		478.275,74
<b>Bankguthaben</b>		<b>4.104.396,62</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte</b>	4	<b>8.338.416,80</b>
<b>Vermögenswerte Gesamt</b>		<b>769.926.491,74</b>
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>	4, 12	<b>(6.920.212,41)</b>
<b>Verbindlichkeiten Gesamt</b>		<b>(6.920.212,41)</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Berichtszeitraums</b>		<b>763.006.279,33</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Emerging Markets Enhanced Index Sustainable Equity

(ausgedrückt in USD)

## Wertpapierbestand zum 31.03.2022

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW	Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW
<b>Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>									
<b>Aktien</b>									
<b>Kaimaninseln</b>									
1.624.200	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	HKD	22.437.291,41	2,94	75.500	TAL EDUCATION GROUP ADR	USD	227.255,00	0,03
149.000	ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	HKD	1.861.993,34	0,24	619.400	TENCENT HOLDINGS LTD	HKD	29.062.622,26	3,81
4.300	AUTOHOME INC ADR	USD	130.763,00	0,02	379.600	TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LTD	HKD	674.049,18	0,09
34.200	BAIDU INC ADR	USD	4.524.660,00	0,59	356.000	TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	HKD	297.734,26	0,04
7.400	BEIGENE LTD ADR	USD	1.395.640,00	0,18	81.000	UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS LTD	HKD	70.532,36	0,01
16.100	BILIBILI INC - ADR	USD	411.838,00	0,05	52.100	VIPSHOP HOLDINGS LTD ADR	USD	468.900,00	0,06
648.000	BOSIDENG INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	HKD	302.362,24	0,04	1.090.000	WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	HKD	1.006.917,46	0,13
138.220	CHAILEASE HOLDING CO LTD	TWD	1.220.825,75	0,16	6.000	WEIBO CORP ADR	USD	147.060,00	0,02
137.000	CHINA CONCH ENVIRONMENT PROTECTION HOLDINGS LTD	HKD	171.438,06	0,02	159.000	WEIMOB INC	HKD	102.897,51	0,01
137.000	CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS LTD	HKD	399.565,94	0,05	470.051	WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	HKD	3.882.441,14	0,51
323.000	CHINA EDUCATION GROUP HOLDINGS LTD	HKD	280.016,72	0,04	843.985	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	HKD	1.481.406,30	0,19
185.000	CHINA EVERGRANDE GROUP	HKD	39.313,98	0,01	380.671	YADEA GROUP HOLDINGS LTD	HKD	586.524,94	0,08
552.000	CHINA FEIHE LTD	HKD	545.680,20	0,07	103.000	YIHAI INTERNATIONAL HOLDING LTD	HKD	293.920,43	0,04
275.000	CHINA LESSO GROUP HOLDINGS LTD	HKD	332.637,60	0,04	109.000	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING LTD	TWD	409.168,19	0,05
31.000	CHINA LITERATURE LTD	HKD	128.252,56	0,02	146.500	ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS LTD	HKD	1.031.901,49	0,14
221.000	CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDINGS LTD	HKD	346.919,83	0,05	243.500	ZS BIO INC	HKD	198.683,95	0,03
103.796	CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS LTD	HKD	395.974,45	0,05	4.500	51JOB INC ADR	USD	263.475,00	0,03
564.000	CHINA MENGNIU DAIRY CO LTD	HKD	3.028.488,94	0,40				<b>123.721.597,74</b>	<b>16,22</b>
110.000	CHINA OVERSEAS PROPERTY	HKD	130.222,39	0,02	<b>Taiwan</b>				
534.000	CHINA RESOURCES LAND LTD	HKD	2.477.848,30	0,32	71.000	ACCTON TECHNOLOGY CORP	TWD	549.164,05	0,07
829.500	CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	HKD	486.131,76	0,06	543.000	ACER INC	TWD	567.874,64	0,07
964.300	COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD	HKD	739.952,80	0,10	186.493	ADVANTECH CO LTD	TWD	2.397.707,56	0,31
215.000	COUNTRY GARDEN SERVICES HOLDINGS CO LTD	HKD	914.959,93	0,12	2.000	ASMEDIA TECHNOLOGY INC	TWD	136.024,13	0,02
1.101.000	DALI FOODS GROUP CO LTD	HKD	578.165,17	0,08	125.000	ASUSTEK COMPUTER INC	TWD	1.630.119,65	0,21
157.900	ENK ENERGY HOLDINGS LTD	HKD	2.371.075,61	0,31	1.333.000	AU OPTRONICS CORP	TWD	915.948,28	0,12
912.000	GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LTD	HKD	1.421.457,98	0,19	131.000	CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	TWD	660.483,73	0,09
228.000	GENSCRIPT BIOTECH CORP	HKD	726.075,45	0,10	426.000	CATHAY FINANCIAL HOLDING CO LTD	TWD	958.680,00	0,13
46.000	GREENTOWN SERVICE GROUP CO LTD	HKD	46.211,56	0,01	2.623.000	CHINA STEEL CORP	TWD	3.572.983,47	0,47
174.000	HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	HKD	290.782,34	0,04	38.000	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	TWD	168.389,56	0,02
167.000	INNOVENT BIOLOGICS INC	HKD	568.844,98	0,07	904.000	COMPAL ELECTRONICS INC	TWD	846.004,29	0,11
184.011	JD.COM INC - A	HKD	5.291.316,87	0,69	896.000	CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD	TWD	917.449,87	0,12
171.031	JINXIN FERTILITY GROUP LTD	HKD	130.691,06	0,02	434.000	DELTA ELECTRONICS INC	TWD	4.067.199,53	0,53
435.000	KINGDEE INTERNATIONAL SOFTWARE GROUP CO LTD	HKD	953.132,91	0,12	152.000	E INK HOLDINGS INC	TWD	980.364,94	0,13
116.200	KINGSOFT CORP LTD	HKD	371.533,22	0,05	20.000	ECLAT TEXTILE CO LTD	TWD	333.018,65	0,04
40.000	KUAISHOU TECHNOLOGY - B	HKD	370.134,22	0,05	7.000	EMEMORY TECHNOLOGY INC	TWD	452.686,02	0,06
82.000	KWG GROUP HOLDINGS LTD	HKD	33.646,95	0,00	1.261.785	E.SUN FINANCIAL HOLDING CO LTD	TWD	1.453.879,44	0,19
76.400	LI AUTO INC - ADR	USD	1.971.884,00	0,26	277.000	EVERGREEN MARINE CORP TAIWAN LTD	TWD	1.309.348,53	0,17
308.000	LI NING CO LTD	HKD	2.641.831,24	0,35	98.480	FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	TWD	655.759,52	0,09
117.000	LOGAN GROUP CO LTD	HKD	33.297,49	0,00	179.349	FIRST FINANCIAL HOLDING CO LTD	TWD	177.817,40	0,02
305.000	LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	HKD	1.564.264,24	0,21	184.000	FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	TWD	403.697,16	0,05
457.900	MEITUAN - B	HKD	8.928.488,57	1,17	711.375	FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD	TWD	1.896.352,74	0,25
92.800	MICROPORT SCIENTIFIC CORP	HKD	208.778,98	0,03	32.718	HIWIN TECHNOLOGIES CORP	TWD	273.541,99	0,04
50.400	NETEASE INC ADR	USD	4.520.376,00	0,59	1.968.000	HON HAI PRECISION INDUSTRY CO LTD	TWD	7.280.951,80	0,95
4.900	NOAH HOLDINGS LTD ADR	USD	115.297,00	0,02	1.368.000	INNOLUX CORP	TWD	803.489,00	0,11
9.000	PARADE TECHNOLOGIES LTD	TWD	566.861,33	0,07	219.000	INVENTEC CORP	TWD	188.659,53	0,02
51.200	PINDUODUO INC - ADR	USD	2.053.632,00	0,27	536.000	LITE-ON TECHNOLOGY CORP ADR	TWD	1.271.577,82	0,17
41.100	PING AN HEALTHCARE AND TECHNOLOGY CO LTD	HKD	106.861,37	0,01	196.000	MEDIATEK INC	TWD	6.190.433,19	0,81
390.000	SEAZEN GROUP LTD	HKD	208.878,88	0,03	965.000	MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD	TWD	1.441.449,28	0,19
72.800	SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP HOLDINGS LTD	HKD	964.424,07	0,13	10.000	MOMO.COM INC	TWD	328.558,69	0,04
13.000	SILERGY CORP	TWD	1.554.476,85	0,20	55.000	NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD CORP	TWD	1.006.717,26	0,13
124.000	SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	HKD	71.856,84	0,01	379.000	NANYA TECHNOLOGY CORP	TWD	915.108,76	0,12
134.300	SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	HKD	2.149.053,89	0,28	101.000	NOVATEK MICROELECTRONICS CORP	TWD	1.502.600,67	0,20
					457.000	PEGATRON CORP	TWD	1.154.598,67	0,15
					280.000	POU CHEN CORP	TWD	308.120,72	0,04
					96.000	PRESIDENT CHAIN STORE CORP	TWD	880.384,40	0,12
					441.000	QUANTA COMPUTER INC	TWD	1.358.023,29	0,18
					87.000	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	TWD	1.305.857,19	0,17
					124.000	RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	TWD	343.262,02	0,04
					245.000	SYNNEX TECHNOLOGY INTERNATIONAL CORP	TWD	643.094,60	0,08

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Emerging Markets Enhanced Index Sustainable Equity

(ausgedrückt in USD)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW	Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW
2.688.000	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING CO LTD	TWD	55.769.807,23	7,32	647.700	COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD - H	HKD	1.124.936,73	0,15
216.000	UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	TWD	1.879.233,85	0,25	410.273	DAQIN RAILWAY CO LTD - A	CNH	443.587,57	0,06
780.000	UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CORP	TWD	1.784.598,29	0,23	12.100	ECOVACS ROBOTICS CO LTD - A	CNH	206.562,67	0,03
1.646.000	UNITED MICROELECTRONICS CORP	TWD	3.093.167,46	0,41	31.700	EVE ENERGY CO LTD - A	CNH	401.014,25	0,05
211.000	VANGUARD INTERNATIONAL SEMICONDUCTOR CORP	TWD	915.388,66	0,12	59.900	FOCUS MEDIA INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD - A	CNH	57.470,33	0,01
4.000	VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY CORP	TWD	203.656,20	0,03	514.684	FOXCONN INDUSTRIAL INTERNET CO LTD	CNH	821.922,24	0,11
20.000	WIWYNN CORP	TWD	711.579,10	0,09	31.700	FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD - A	CNH	177.317,63	0,02
183.000	YANG MING MARINE TRANSPORT CORP	TWD	798.283,73	0,10	117.200	FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD - H	HKD	477.771,81	0,06
309.880	YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	TWD	285.525,35	0,04	23.500	GANFENG LITHIUM CO LTD - A	CNH	464.467,04	0,06
			<b>117.688.621,91</b>	<b>15,42</b>	56.595	GANFENG LITHIUM CO LTD - H	HKD	803.998,39	0,11
					249.100	GEM CO LTD - A	CNH	328.202,44	0,04
					203.000	GF SECURITIES CO LTD - H	HKD	287.002,33	0,04
					4.200	GIGADEVICE SEMICONDUCTOR BEIJING INC - A	CNH	93.141,41	0,01
					102.900	GOERTEK INC - A	CNH	556.788,30	0,07
					6.600	GOTION HIGH-TECH CO LTD - A	CNH	35.718,42	0,00
					46.400	GUANGDONG HAID GROUP CO LTD - A	CNH	400.741,94	0,05
					7.500	GUANGDONG KINLONG HARDWARE PRODUCTS CO LTD - A	CNH	126.339,34	0,02
					844.000	GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD - H	HKD	699.098,07	0,09
					9.100	GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRONIC TECHNOLOGY CO LTD	CNH	91.849,05	0,01
					122.000	HAIER SMART HOME CO LTD - A	CNH	442.669,10	0,06
					326.600	HAIER SMART HOME CO LTD - H	HKD	1.053.864,48	0,14
					201.200	HAITONG SECURITIES CO LTD	HKD	153.280,47	0,02
					20.300	HANGZHOU ROBAM APPLIANCES CO LTD - A	CNH	93.117,28	0,01
					39.900	HANGZHOU TIGERMED CONSULTING CO LTD - H	HKD	484.519,50	0,06
					19.253	HEFEI MEIYA OPTOELECTRONIC TECHNOLOGY INC - A	CNH	81.138,92	0,01
					62.800	HENAN SHUANGHUI INVESTMENT & DEVELOPMENT CO LTD - A	CNH	286.920,27	0,04
					929.600	HESTEEL CO LTD	CNH	348.294,17	0,05
					24.304	HOSHINE SILICON INDUSTRY CO LTD	CNH	399.211,72	0,05
					151.400	HUAFON CHEMICAL CO LTD	CNH	217.096,81	0,03
					275.800	HUATAI SECURITIES CO LTD - H	HKD	423.293,84	0,06
					181.380	HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS CO LTD - A	CNH	568.762,12	0,07
					9.200	HUIZHOU DESAY SV AUTOMOTIVE CO LTD	CNH	183.189,05	0,02
					1.519.200	INDUSTRIAL & COMMERCIAL BANK OF CHINA LTD - A	CNH	1.140.220,37	0,15
					7.030.000	INDUSTRIAL & COMMERCIAL BANK OF CHINA LTD - H	HKD	4.309.669,00	0,56
					226.300	INDUSTRIAL BANK CO LTD - A	CNH	735.396,07	0,10
					90.700	INNER MONGOLIA YILI INDUSTRIAL GROUP CO LTD - A	CNH	525.852,84	0,07
					30.468	JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD	CNH	376.820,67	0,05
					274.000	JIANGSU EXPRESSWAY CO LTD - H	HKD	286.433,95	0,04
					951.000	JIANGXI COPPER CO LTD - H	HKD	1.594.554,16	0,21
					9.700	JONJEE HI-TECH INDUSTRIAL AND COMMERCIAL HOLDING CO LTD - A	CNH	42.881,49	0,01
					12.800	JUEWEI FOOD CO LTD - A	CNH	84.860,57	0,01
					115.300	KINGFA SCI & TECH CO LTD - A	CNH	176.498,16	0,02
					96.900	LENS TECHNOLOGY CO LTD - A	CNH	177.617,53	0,02
					87.860	LONGI GREEN ENERGY TECHNOLOGY CO LTD - A	CNH	995.239,75	0,13
					4.600	MAXSCEND MICROELECTRONICS CO LTD - A	CNH	151.773,34	0,02
					73.000	MUYUAN FOODS CO LTD - A	CNH	652.329,32	0,09
					67.863	NARI TECHNOLOGY CO LTD - A	CNH	336.242,70	0,04
					7.000	NAURA TECHNOLOGY GROUP CO LTD - A	CNH	300.747,25	0,04
					124.000	NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD - H	HKD	345.237,46	0,05
					41.300	NINESTAR CORP - A	CNH	277.731,14	0,04
					44.711	NINGBO SHANSHAN CO LTD	CNH	196.349,53	0,03
					2.408.000	PEOPLE'S INSURANCE CO GROUP - H	HKD	788.435,67	0,10
					45.209	PHARMARON BEIJING CO LTD - H	HKD	545.426,33	0,07
					992.000	PICC PROPERTY & CASUALTY CO LTD - H	HKD	1.010.437,01	0,13
					127.200	PING AN BANK CO LTD - A	CNH	307.041,88	0,04
					34.600	PING AN INSURANCE GROUP CO OF CHINA LTD - A	CNH	263.202,79	0,03

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Emerging Markets Enhanced Index Sustainable Equity

(ausgedrückt in USD)

## Wertpapierbestand zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW	Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW
731.500	PING AN INSURANCE GROUP CO OF CHINA LTD - H	HKD	5.159.654,78	0,68	35.600	ZHONGAN ONLINE P&C INSURANCE CO LTD - H	HKD	119.715,32	0,02
698.692	POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD - A	CNH	591.799,53	0,08	501.400	ZOOMLION HEAVY INDUSTRY SCIENCE AND TECHNOLOGY CO LTD - H	HKD	317.557,58	0,04
1.151.000	POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD - H	HKD	930.024,28	0,12	181.000	ZTE CORP - H	HKD	367.678,09	0,05
295.000	SAIC MOTOR CORP LTD - A	CNH	787.617,29	0,10	49.700	360 SECURITY TECHNOLOGY INC	CNH	77.960,42	0,01
165.600	SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD - A	CNH	455.393,03	0,06				<b>99.693.515,36</b>	<b>13,07</b>
12.000	SEAZEN HOLDINGS CO LTD - A	CNH	60.709,21	0,01		<b>Indien</b>			
235.265	SHANDONG GOLD MINING CO LTD	CNH	797.554,32	0,10	348.013	AMBUJA CEMENTS LTD	INR	1.375.555,12	0,18
916.750	SHANDONG GOLD MINING CO LTD - H	HKD	1.836.305,01	0,24	10.958	APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE LTD	INR	654.306,35	0,09
446.400	SHANDONG WEIGAO GROUP MEDICAL POLYMER CO LTD - H	HKD	477.972,74	0,06	86.829	ASIAN PAINTS LTD	INR	3.529.831,58	0,46
11.291	SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE CO LTD - A	CNH	86.613,82	0,01	22.710	AUROBINDO PHARMA LTD	INR	200.533,10	0,03
116.500	SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD - H	HKD	569.038,49	0,07	30.561	AVENUE SUPERMARTS LTD	INR	1.617.792,26	0,21
49.600	SHANGHAI INTERNATIONAL AIRPORT CO LTD - A	CNH	382.477,76	0,05	235.664	AXIS BANK LTD	INR	2.367.298,76	0,31
120.300	SHANGHAI INTERNATIONAL PORT GROUP CO LTD	CNH	103.440,55	0,01	24.431	BAJAJ AUTO LTD	INR	1.178.758,96	0,15
24.200	SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD - H	HKD	46.639,55	0,01	31.776	BAJAJ FINANCE LTD	INR	3.046.786,03	0,40
23.200	SHANGHAI YUYUAN TOURIST MART GROUP CO LTD - A	CNH	37.097,66	0,00	6.434	BAJAJ FINSERV LTD	INR	1.452.799,15	0,19
304.900	SHANXI MEIJIN ENERGY CO LTD	CNH	613.870,94	0,08	166.553	BERGER PAINTS INDIA LTD	INR	1.540.173,26	0,20
30.100	SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD - A	CNH	76.353,43	0,01	303.128	BHARTI AIRTEL LTD	INR	3.022.989,14	0,40
13.300	SHENZHEN CAPCHEM TECHNOLOGY CO LTD	CNH	170.079,10	0,02	27.323	BIOCON LTD	INR	121.163,68	0,02
7.275	SHENZHEN GOODIX TECHNOLOGY CO LTD - A	CNH	81.083,77	0,01	18.041	BRITANNIA INDUSTRIES LTD	INR	762.426,99	0,10
12.800	SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDICAL ELECTRONICS CO LTD - A	CNH	618.734,86	0,08	32.917	CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND FINANCE CO LTD	INR	312.281,30	0,04
432.500	SHENZHEN OVERSEAS CHINESE TOWN CO LTD - A	CNH	501.003,57	0,07	55.735	CIPLA LTD/INDIA	INR	749.382,96	0,10
8.500	SHENZHEN SC NEW ENERGY TECHNOLOGY CORP - A	CNH	98.072,45	0,01	5.898	COLGATE-PALMOLIVE INDIA LTD	INR	120.193,83	0,02
231.300	SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO LTD	CNH	390.823,80	0,05	37.761	CONTAINER CORP OF INDIA LTD	INR	335.333,76	0,04
543.800	SINOPEC SHANGHAI PETROCHEMICAL CO LTD	CNH	301.521,98	0,04	97.153	DABUR INDIA LTD	INR	688.028,57	0,09
200.400	SINOPHARM GROUP CO LTD - H	HKD	455.818,62	0,06	19.674	DIVI'S LABORATORIES LTD	INR	1.144.321,17	0,15
16.200	SKSHU PAINT CO LTD	CNH	226.201,70	0,03	187.553	DLF LTD	INR	941.884,09	0,12
22.800	SUNGROW POWER SUPPLY CO LTD - A	CNH	383.791,04	0,05	29.297	EICHER MOTORS LTD	INR	949.635,82	0,12
76.400	SUNING.COM CO LTD - A	CNH	41.416,34	0,01	76.682	GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	INR	756.622,87	0,10
4.581	THUNDER SOFTWARE TECHNOLOGY CO LTD - A	CNH	71.443,12	0,01	86.620	GRASIM INDUSTRIES LTD	INR	1.902.816,55	0,25
64.500	TONGWEI CO LTD - A	CNH	432.059,45	0,06	33.195	HAVELLS INDIA LTD	INR	505.434,25	0,07
113.800	TRANSFAR ZHILIAN CO LTD	CNH	112.985,49	0,01	204.195	HCL TECHNOLOGIES LTD	INR	3.136.273,60	0,41
438.000	TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD - H	HKD	630.045,72	0,08	126.611	HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	INR	900.068,60	0,12
9.100	TRUNGROUP GUOXIN MICROELECTRONICS CO LTD - A	CNH	292.826,31	0,04	23.645	HERO MOTOCORP LTD	INR	716.587,44	0,09
57.040	UNISPLENDOR CORP LTD - A	CNH	175.522,41	0,02	139.373	HINDUSTAN UNILEVER LTD	INR	3.771.393,56	0,49
94.200	UNIVERSAL SCIENTIFIC INDUSTRIAL SHANGHAI CO LTD - A	CNH	179.306,33	0,02	187.726	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP LTD	INR	5.924.340,87	0,78
4.000	WALVAX BIOTECHNOLOGY CO LTD - A	CNH	34.584,78	0,00	611.666	ICICI BANK LTD	INR	5.908.724,52	0,77
38.300	WEICHAI POWER CO LTD - A	CNH	80.376,07	0,01	30.459	ICICI LOMBARD GENERAL INSURANCE CO LTD	INR	534.184,46	0,07
341.000	WEICHAI POWER CO LTD - H	HKD	536.246,34	0,07	58.182	ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURANCE CO LTD	INR	384.836,20	0,05
81.260	WENS FOODSTUFFS GROUP CO LTD - A	CNH	281.650,69	0,04	52.530	INDIAN RAILWAY CATERING & TOURISM CORP LTD	INR	537.887,74	0,07
15.000	WILL SEMICONDUCTOR CO LTD SHANGHAI - A	CNH	455.207,99	0,06	190.202	INDRAPRASTHA GAS LTD	INR	938.828,23	0,12
28.600	WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD - A	CNH	366.137,91	0,05	30.337	INDUS TOWERS LTD	INR	89.043,16	0,01
103.247	WUHAN GUIDE INFRARED CO LTD - A	CNH	276.948,22	0,04	5.596	INFO EDGE INDIA LTD	INR	333.375,24	0,04
42.400	WUS PRINTED CIRCUIT KUNSHAN CO LTD	CNH	88.155,92	0,01	466.022	INFOSYS LTD	INR	11.750.872,63	1,54
93.080	WUXI APPTEC CO LTD - H	HKD	1.474.066,38	0,19	83.540	KOTAK MAHINDRA BANK LTD	INR	1.934.302,49	0,25
43.700	WUXI LEAD INTELLIGENT EQUIPMENT CO LTD - A	CNH	402.074,66	0,05	9.956	LUPIN LTD	INR	98.227,01	0,01
170.800	XINJIANG GOLDWIND SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD - H	HKD	257.555,71	0,03	147.846	MAHINDRA & MAHINDRA LTD	INR	1.575.347,45	0,21
31.850	YEALINK NETWORK TECHNOLOGY CORP LTD - A	CNH	389.811,40	0,05	77.869	MARICO LTD	INR	518.524,36	0,07
7.500	YIFENG PHARMACY CHAIN CO LTD - A	CNH	47.163,49	0,01	25.867	MPHASIS LTD	INR	1.154.529,58	0,15
50.830	YONYOU NETWORK TECHNOLOGY CO LTD - A	CNH	183.082,61	0,02	1.606	MUTHOOT FINANCE LTD	INR	28.249,61	0,00
28.385	YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD - A	CNH	365.291,55	0,05	6.767	NESTLE INDIA LTD	INR	1.551.806,72	0,20
14.900	ZHANGZHOU PIENZHEHUANG PHARMACEUTICAL CO LTD - A	CNH	742.069,88	0,10	752	PAGE INDUSTRIES LTD	INR	428.969,43	0,06
25.100	ZHEJIANG JINGSHENG MECHANICAL & ELECTRICAL CO LTD - A	CNH	236.886,47	0,03	1.047.995	PETRONET LNG LTD	INR	2.681.747,36	0,36
90.200	ZHEJIANG JUHUA CO LTD	CNH	185.273,45	0,02	67.237	PIDILITE INDUSTRIES LTD	INR	2.179.379,22	0,29
8.700	ZHEJIANG SANHUA INTELLIGENT CONTROLS CO LTD	CNH	22.722,79	0,00	3.661	PIRAMAL ENTERPRISES LTD	INR	105.753,79	0,01
22.100	ZHEJIANG SUPOR CO LTD - A	CNH	173.664,60	0,02	1.113.732	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	INR	3.186.933,53	0,43
					6.993	SBI CARDS & PAYMENT SERVICES LTD	INR	78.707,68	0,01
					53.385	SBI LIFE INSURANCE CO LTD	INR	790.221,43	0,10
					3.835	SHREE CEMENT LTD	INR	1.216.819,78	0,16

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Emerging Markets Enhanced Index Sustainable Equity

(ausgedrückt in USD)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl/ Nominal	Bezeich- nung	Währung	Marktwert in USD	% NIW	Stückzahl/ Nominal	Bezeich- nung	Währung	Marktwert in USD	% NIW
7.919	SHRIRAM TRANSPORT FINANCE CO LTD	INR	118.722,78	0,02	52.686	SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	KRW	1.137.001,47	0,15
22.640	SIEMENS LTD	INR	707.137,68	0,09	7.022	SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANCE CO LTD	KRW	1.265.527,76	0,17
241.766	STATE BANK OF INDIA	INR	1.575.326,52	0,21	158.646	SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES CO LTD	KRW	741.747,70	0,09
160.446	SUN PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	INR	1.937.919,17	0,25	17.698	SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LTD	KRW	960.669,23	0,13
138.488	TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	INR	1.422.104,89	0,19	10.028	SAMSUNG SDI CO LTD	KRW	4.922.964,51	0,65
321.999	TATA MOTORS LTD	INR	1.842.352,44	0,24	13.294	SAMSUNG SDS CO LTD	KRW	1.515.310,75	0,20
124.117	TECH MAHINDRA LTD	INR	2.455.137,83	0,32	7.499	SAMSUNG SECURITIES CO LTD	KRW	258.816,75	0,03
95.033	TITAN CO LTD	INR	3.185.690,29	0,42	4.497	SEEGENE INC	KRW	190.205,10	0,02
5.260	TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	INR	193.930,34	0,03	80.194	SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD	KRW	2.741.178,82	0,36
19.300	TRENT LTD	INR	325.445,87	0,04	2.521	SK CHEMICALS CO LTD	KRW	282.369,75	0,04
315.816	WIPRO LTD	INR	2.469.146,61	0,32	78.255	SK HYNIX INC	KRW	7.605.758,28	1,00
			<b>97.965.199,66</b>	<b>12,84</b>	23.535	SK INNOVATION CO LTD	KRW	4.174.519,40	0,55
	<b>Südkorea</b>				6.841	SK TELECOM CO LTD	KRW	320.701,04	0,04
5.516	AMOREPACIFIC CORP	KRW	727.637,33	0,10	6.841	SKC CO LTD	KRW	870.344,09	0,11
15.364	AMOREPACIFIC GROUP	KRW	554.658,11	0,07	41.512	WOORI FINANCIAL GROUP INC	KRW	524.584,35	0,07
4.684	BGF RETAIL CO LTD	KRW	673.115,60	0,09	12.521	YUHAN CORP	KRW	602.077,37	0,08
11.714	CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	KRW	629.194,65	0,08				<b>87.310.556,78</b>	<b>11,44</b>
15.315	CELLTRION INC	KRW	2.169.443,36	0,28		<b>Brasilien</b>			
2.807	CJ CHEILJEDANG CORP	KRW	854.828,74	0,11	70.300	ALPARGATAS SA - PREF	BRL	385.677,67	0,05
8.305	CJ CORP	KRW	577.814,79	0,08	66.100	AMERICANAS SA	BRL	454.164,08	0,06
7.078	CJ ENM CO LTD	KRW	766.829,21	0,10	93.100	ATACADAO SA	BRL	441.210,87	0,06
1.129	CJ LOGISTICS CORP	KRW	120.475,73	0,02	155.900	BANCO BTG PACTUAL SA	BRL	854.309,49	0,11
17.036	COWAY CO LTD	KRW	961.000,02	0,13	101.300	BANCO DO BRASIL SA	BRL	739.719,48	0,10
7.893	DONGBU INSURANCE CO LTD	KRW	453.478,45	0,06	21.200	BANCO INTER SA	BRL	94.580,12	0,01
18.237	DOOSAN BOBCAT INC	KRW	584.992,55	0,08	138.200	BANCO SANTANDER BRASIL SA	BRL	1.072.573,58	0,14
2.832	E-MART INC	KRW	328.817,63	0,04	108.700	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES SA	BRL	584.680,39	0,08
662	GREEN CROSS CORP/SOUTH KOREA	KRW	110.049,50	0,01	74.200	BRASKEM SA -PREF A	BRL	691.728,66	0,09
22.420	GS ENGINEERING & CONSTRUCTION CORP	KRW	857.562,10	0,11	150.900	BRF SA	BRL	590.332,60	0,08
49.383	HANA FINANCIAL GROUP INC	KRW	1.980.561,99	0,26	816.800	B3 SA - BRASIL BOLSA BALCAO	BRL	2.700.349,96	0,36
40.835	HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO LTD	KRW	1.130.263,25	0,15	272.900	CCR SA	BRL	786.778,06	0,10
828	HANMI PHARM CO LTD	KRW	186.796,15	0,02	199.000	CIA DE SANEAMENTO BASICO DO ESTADO DE SAO PAULO	BRL	1.997.977,67	0,26
103.927	HANON SYSTEMS	KRW	1.006.976,76	0,13	677.224	CIA ENERGETICA DE MINAS GERAIS - PREF	BRL	2.167.652,66	0,28
47.169	HMM CO LTD	KRW	1.134.127,27	0,15	683.700	GERDAU SA - PREF	BRL	4.432.874,29	0,59
9.607	HONAM PETROCHEMICAL CORP	KRW	1.659.207,17	0,22	647.500	HAPVIDA PARTICIPACOES E INVESTIMENTOS	BRL	1.613.316,64	0,21
27.026	HYUNDAI ENGINEERING & CONSTRUCTION CO LTD	KRW	1.065.280,18	0,14	114.300	HYPERA SA	BRL	931.102,60	0,12
3.508	HYUNDAI GLOVIS CO LTD	KRW	556.829,06	0,07	646.800	ITAU UNIBANCO HOLDING SA - PREF	BRL	3.740.372,69	0,49
15.364	HYUNDAI MOBIS CO LTD	KRW	2.721.883,70	0,36	175.200	ITAUSA SA	BRL	848.788,39	0,11
63.819	HYUNDAI STEEL CO	KRW	2.185.396,14	0,29	186.200	KLABIN SA	BRL	945.116,01	0,12
63.656	INDUSTRIAL BANK OF KOREA	KRW	568.780,26	0,07	122.700	LOCALIZA RENT A CAR SA	BRL	1.577.661,80	0,21
45.114	KAKAO CORP	KRW	3.953.314,07	0,52	214.850	LOJAS RENNER SA	BRL	1.243.357,99	0,16
59.622	KB FINANCIAL GROUP INC	KRW	3.007.228,19	0,39	481.100	MAGAZINE LUIZA SA	BRL	690.474,86	0,09
7.657	KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO LTD	KRW	494.460,77	0,06	182.500	NATURA & CO HOLDING SA	BRL	1.000.457,71	0,13
13.054	KOREA SHIPBUILDING & OFFSHORE ENGINEERING CO LTD	KRW	955.735,93	0,13	188.200	RAIA DROGASIL SA	BRL	948.138,76	0,12
5.487	KOREA ZINC CO LTD	KRW	2.646.804,08	0,35	89.100	REDE D'OR SAO LUIZ SA	BRL	935.634,84	0,12
40.218	KOREAN AIR LINES CO LTD	KRW	1.001.018,07	0,13	177.700	RUMO SA	BRL	693.680,49	0,09
7.723	LG CHEM LTD	KRW	3.383.300,19	0,44	143.300	SUZANO SA	BRL	1.663.105,67	0,22
111.477	LG DISPLAY CO LTD	KRW	1.900.333,50	0,25	116.000	TELEFONICA BRASIL SA	BRL	1.310.628,27	0,17
21.924	LG ELECTRONICS INC	KRW	2.176.798,93	0,29	142.800	TIM SA/BRAZIL	BRL	414.400,82	0,05
2.052	LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD	KRW	1.453.436,83	0,19	189.000	TOTVS SA	BRL	1.446.947,04	0,19
594	LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD - PREF	KRW	248.053,38	0,03	152.400	VIBRA ENERGIA SA	BRL	749.821,02	0,10
5.733	LG INNOTEK CO LTD	KRW	1.829.124,38	0,24	379.800	WEG SA	BRL	2.786.987,66	0,37
28.019	LG UPLUS CORP	KRW	323.351,25	0,04				<b>41.534.602,84</b>	<b>5,44</b>
3.861	MERITZ FINANCIAL GROUP INC	KRW	129.468,07	0,02		<b>Saudi-Arabien</b>			
90.165	MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD	KRW	635.983,51	0,08	159.449	AL RAJHI BANK	SAR	6.825.129,08	0,89
16.874	NAVER CORP	KRW	4.721.847,42	0,62	55.531	ALINMA BANK	SAR	574.939,21	0,08
1.083	NCSOFT CORP	KRW	417.284,59	0,05	103.709	ALMARAI CO JSC	SAR	1.415.407,38	0,19
2.610	NETMARBLE CORP	KRW	239.639,21	0,03	110.416	ARAB NATIONAL BANK	SAR	818.223,32	0,11
21.845	SAMSUNG C&T CORP	KRW	2.049.101,78	0,27	54.246	BANK ALBILAD	SAR	896.508,60	0,12
22.514	SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO LTD	KRW	3.064.496,56	0,40					

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Emerging Markets Enhanced Index Sustainable Equity

(ausgedrückt in USD)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW	Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW
99.328	BANQUE SAUDI FRANSI	SAR	1.421.808,24	0,19	234.600	HOME PRODUCT CENTER PCL	THB	112.184,66	0,01
139.443	EMAAR ECONOMIC CITY	SAR	434.144,81	0,06	603.600	INDORAMA VENTURES PCL	THB	844.132,33	0,11
14.200	MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO	SAR	804.723,44	0,11	93.700	INTOUCH HOLDINGS PCL	THB	219.103,01	0,03
333.964	NATIONAL INDUSTRIALIZATION CO	SAR	2.056.395,68	0,26	1.574.000	LAND & HOUSES PCL	THB	449.714,29	0,07
258.282	RIYAD BANK	SAR	2.585.229,67	0,34	102.000	MINOR INTERNATIONAL PCL	THB	102.774,18	0,01
166.751	SAUDI BRITISH BANK	SAR	1.769.076,32	0,23	365.358	MINOR INTERNATIONAL PCL	THB	368.105,05	0,05
326.494	SAUDI NATIONAL BANK	SAR	6.170.445,05	0,80	85.300	OSOTSPA PCL	THB	96.203,01	0,01
98.817	SAUDI TELECOM CO	SAR	2.839.523,55	0,37	26.700	PTT EXPLORATION & PRODUCTION PCL	THB	115.633,08	0,02
22.463	SAVOLA GROUP	SAR	218.253,06	0,03	1.148.500	PTT EXPLORATION & PRODUCTION PCL	THB	4.995.074,96	0,65
			<b>28.829.807,41</b>	<b>3,78</b>	8.400	SIAM CEMENT PCL	THB	96.879,08	0,01
	<b>Südafrika</b>				177.700	SIAM CEMENT PCL/THE - REG	THB	2.043.048,78	0,27
54.441	ABSA GROUP LTD	ZAR	709.512,00	0,09	48.900	SIAM COMMERCIAL BANK PCL/THE	THB	167.221,80	0,02
67.309	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LTD	ZAR	914.941,77	0,12	219.200	THAI UNION GROUP PCL	THB	124.597,89	0,02
66.671	BID CORP LTD	ZAR	1.450.998,22	0,19				<b>18.104.545,35</b>	<b>2,37</b>
59.512	BIDVEST GROUP LTD/THE	ZAR	911.057,96	0,12		<b>Vereinigte Arabische Emirate</b>			
11.895	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	ZAR	1.906.089,80	0,25	1.019.360	ABU DHABI NATIONAL OIL CO FOR DISTRIBUTION PJSC	AED	1.165.601,34	0,15
21.348	CLICKS GROUP LTD	ZAR	451.503,81	0,06	532.722	ALDAR PROPERTIES PJSC	AED	715.024,15	0,09
87.483	DISCOVERY LTD	ZAR	1.090.626,39	0,14	728.054	EMAAR PROPERTIES PJSC	AED	1.189.290,64	0,16
738.439	FIRSTSTRAND LTD	ZAR	3.914.926,90	0,51	559.877	EMIRATES TELECOMMUNICATIONS GROUP CO PJSC	AED	5.633.752,31	0,74
572.900	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	ZAR	577.114,66	0,08	580.564	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	AED	3.730.227,03	0,49
243.605	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	ZAR	3.751.475,32	0,49				<b>12.433.895,47</b>	<b>1,63</b>
29.988	MR PRICE GROUP LTD	ZAR	444.325,19	0,06		<b>Indonesien</b>			
26.273	NASPERS LTD	ZAR	2.992.056,44	0,39	8.806.500	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	IDR	4.887.377,91	0,64
62.496	NEDBANK GROUP LTD	ZAR	996.813,87	0,13	2.406.800	BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	IDR	1.325.290,79	0,17
895.967	OLD MUTUAL LTD	ZAR	844.309,02	0,12	1.024.600	BANK NEGARA INDONESIA PERSERO TBK PT	IDR	588.051,11	0,08
30.948	RAND MERCHANT INVESTMENT HOLDINGS LTD	ZAR	110.533,87	0,01	4.695.000	BANK RAKYAT INDONESIA PERSERO TBK PT	IDR	1.522.883,48	0,20
316.924	SANLAM LTD	ZAR	1.565.913,62	0,21	1.957.300	CHAROEN POKPHAND INDONESIA TBK PT	IDR	769.855,69	0,10
170.198	STANDARD BANK GROUP LTD	ZAR	2.121.462,02	0,28	2.688.000	KALBE FARMA TBK PT	IDR	301.368,48	0,04
112.312	VODACOM GROUP LTD	ZAR	1.229.763,56	0,16	6.934.000	TELKOM INDONESIA PERSERO TBK PT	IDR	2.208.528,36	0,29
26.028	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD/SOUTH AFRICA	ZAR	102.918,59	0,01	1.058.900	UNILEVER INDONESIA TBK PT	IDR	269.592,21	0,04
			<b>26.086.343,01</b>	<b>3,42</b>				<b>11.872.948,03</b>	<b>1,56</b>
	<b>Mexiko</b>					<b>Polen</b>			
4.149.900	AMERICA MOVIL SAB DE CV	MXN	4.384.635,09	0,58	8.243	BANK POLSKA KASA OPIEKI SA	PLN	223.321,06	0,03
83.300	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	MXN	563.868,57	0,07	2.671	DINO POLSKA SA	PLN	218.243,57	0,03
2.738.500	CEMEX SAB DE CV	MXN	1.459.746,01	0,20	68.722	KGHM POLSKA MIEDZ SA	PLN	2.851.288,93	0,37
252.000	FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB DE CV	MXN	2.086.815,77	0,27	220	LPP SA	PLN	605.531,23	0,08
59.200	GRUPO AEROPORTUARIO DEL PACIFICO SAB DE CV - B	MXN	951.825,09	0,12	298.404	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN SA	PLN	5.443.559,20	0,71
35.465	GRUPO AEROPORTUARIO DEL SURESTE SAB DE CV - B	MXN	785.682,60	0,10	29.974	POWSZECHNA KASA OSZCZEDNOSCI BANK POLSKI SA	PLN	286.559,28	0,04
74.200	GRUPO CARSO SAB DE CV	MXN	278.277,91	0,04				<b>9.628.503,27</b>	<b>1,26</b>
246.300	GRUPO FINANCIERO BANORTE SAB DE CV	MXN	1.850.399,46	0,24		<b>Malaysia</b>			
169.700	GRUPO TELEVISIA SAB	MXN	397.401,97	0,05	316.329	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	MYR	400.587,28	0,05
115.000	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	MXN	1.447.447,60	0,19	140.600	DIGI.COM BHD	MYR	130.204,01	0,02
384.300	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	MXN	1.013.841,29	0,13	57.700	FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	MYR	288.229,94	0,04
899.700	WAL-MART DE MEXICO SAB DE CV	MXN	3.677.391,79	0,49	489.700	HAP SENG CONSOLIDATED BHD	MYR	870.596,87	0,11
			<b>18.897.333,15</b>	<b>2,48</b>	249.800	HARTALEGA HOLDINGS BHD	MYR	288.109,18	0,04
	<b>Thailand</b>				37.700	HONG LEONG BANK BHD	MYR	180.953,32	0,02
17.400	ADVANCED INFO SERVICE	THB	121.927,68	0,02	772.000	IHH HEALTHCARE BHD	MYR	1.136.091,89	0,15
152.000	ADVANCED INFO SERVICE PCL	THB	1.058.463,48	0,14	862.500	INARI AMERTRON BHD	MYR	628.836,40	0,08
1.082.300	AIRPORTS OF THAILAND PCL	THB	2.156.462,41	0,28	397.641	MALAYAN BANKING BHD	MYR	845.412,62	0,11
139.800	BANGKOK DUSIT MEDICAL SERVICES PCL	THB	105.107,82	0,01	126.200	MALAYSIA AIRPORTS HOLDINGS BHD	MYR	208.425,89	0,03
1.347.100	BANGKOK DUSIT MEDICAL SERVICES PCL	THB	1.013.156,42	0,13	324.000	MAXIS BHD	MYR	302.286,24	0,04
237.900	CENTRAL RETAIL CORP PCL	THB	284.406,77	0,04	16.900	NESTLE MALAYSIA BHD	MYR	536.301,44	0,07
859.200	CP ALL PCL	THB	1.676.676,14	0,22	165.000	PPB GROUP BHD	MYR	670.908,38	0,09
48.400	DELTA ELECTRONICS THAI	THB	564.787,97	0,07	1.976.200	PUBLIC BANK BHD	MYR	2.193.521,61	0,29
7.400	DELTA ELECTRONICS THAILAND PCL	THB	86.370,40	0,01	150.900	QL RESOURCES BHD	MYR	180.231,11	0,02
50.200	ENERGY ABSOLUTE PCL	THB	148.313,98	0,02					
400.000	ENERGY ABSOLUTE PCL	THB	1.154.200,16	0,15					

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.



## NN (L) Emerging Markets Enhanced Index Sustainable Equity

(ausgedrückt in USD)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW	Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW
378.800	SIME DARBY BHD	MYR	216.190,54	0,03	101.392	SHENZHEN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	HKD	107.071,05	0,01
4.400	TELEKOM MALAYSIA BHD	MYR	5.112,88	0,00				<b>4.401.841,50</b>	<b>0,58</b>
110.100	WESTPORTS HOLDINGS BHD	MYR	104.792,13	0,01					
			<b>9.186.791,73</b>	<b>1,20</b>					
<b>Kolumbien</b>					<b>Türkei</b>				
7.746.297	ECOPETROL SA	COP	7.301.159,46	0,96	98.978	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	TRY	571.218,33	0,07
61.554	INTERCONEXION ELECTRICA SA ESP	COP	398.476,23	0,05	48.652	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	TRY	990.769,03	0,13
			<b>7.699.635,69</b>	<b>1,01</b>	316.546	KOC HOLDING AS	TRY	855.905,94	0,12
					314.896	TURKCELL ILETISIM HIZMETLERI AS	TRY	483.902,16	0,06
					123.776	TURKIYE SISE VE CAM FABRIKALARI AS	TRY	128.351,86	0,02
								<b>3.030.147,32</b>	<b>0,40</b>
<b>Philippinen</b>					<b>Griechenland</b>				
73.350	AYALA CORP	PHP	1.167.652,07	0,15	217.162	ALPHA SERVICES AND HOLDINGS SA	EUR	269.653,83	0,04
1.886.790	AYALA LAND INC	PHP	1.277.210,43	0,17	568.144	EUROBANK ERGASIAS SERVICES AND HOLDINGS SA	EUR	671.654,50	0,08
303.140	BANK OF THE PHILIPPINE ISLANDS	PHP	583.180,00	0,08	50.811	HELLENIC TELECOMMUNICATIONS ORGANIZATION SA	EUR	927.171,67	0,12
274.270	BDO UNIBANK INC	PHP	702.472,27	0,09				<b>1.868.480,00</b>	<b>0,24</b>
239.660	INTERNATIONAL CONTAINER TERMINAL SERVICES INC	PHP	1.042.442,19	0,14					
49.090	SM INVESTMENTS CORP	PHP	861.718,22	0,11					
1.291.400	SM PRIME HOLDINGS INC	PHP	943.273,65	0,12					
200.250	UNIVERSAL ROBINA CORP	PHP	468.916,79	0,06					
			<b>7.046.865,62</b>	<b>0,92</b>					
<b>Hongkong</b>					<b>Ägypten</b>				
220.000	CHINA MERCHANTS HOLDINGS INTERNATIONAL CO LTD	HKD	397.571,16	0,05	310.346	COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK EGYPT SAE	EGP	784.183,90	0,10
414.000	CHINA OVERSEAS LAND & INVESTMENT LTD	HKD	1.235.596,46	0,16				<b>784.183,90</b>	<b>0,10</b>
56.000	CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS CO LTD	HKD	68.272,58	0,01					
484.000	CHINA TRADITIONAL CHINESE MEDICINE HOLDINGS CO LTD	HKD	252.689,91	0,03					
1.486.880	CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LTD	HKD	1.712.518,04	0,23					
1.408.000	LENOVO GROUP LTD	HKD	1.527.410,32	0,20					
127.500	SINOTRUK HONG KONG LTD	HKD	194.545,91	0,03					
332.000	WHARF HOLDINGS LTD/THE	HKD	1.011.689,09	0,13					
			<b>6.400.293,47</b>	<b>0,84</b>					
<b>Chile</b>					<b>Insel Man</b>				
310.145	EMPRESAS COPEC SA	CLP	2.561.797,50	0,34	108.433	NEPI ROCKCASTLE PLC	ZAR	720.314,20	0,09
8.882.556	ENEL AMERICAS SA	CLP	1.072.329,41	0,14				<b>720.314,20</b>	<b>0,09</b>
23.375	SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHILE SA - B	CLP	2.020.184,58	0,26					
			<b>5.654.311,49</b>	<b>0,74</b>					
<b>Ungarn</b>					<b>Tschechische Republik</b>				
590.495	MOL HUNGARIAN OIL & GAS PLC	HUF	5.241.944,24	0,69	16.157	KOMERCNI BANKA AS	CZK	630.750,44	0,08
			<b>5.241.944,24</b>	<b>0,69</b>				<b>630.750,44</b>	<b>0,08</b>
<b>Katar</b>					<b>Singapur</b>				
1.951.232	QATAR GAS TRANSPORT CO NAKILAT	QAR	1.918.146,65	0,25	67.500	BOC AVIATION LTD	HKD	532.789,31	0,07
521.140	QATAR NATIONAL BANK QPSC	QAR	3.301.352,32	0,43				<b>532.789,31</b>	<b>0,07</b>
			<b>5.219.498,97</b>	<b>0,68</b>					
<b>Kuwait</b>					<b>Niederlande</b>				
608.529	AGILITY PUBLIC WAREHOUSING CO KSC	KWD	2.213.379,02	0,29	50.792	X5 RETAIL GROUP NV - GDR REG	USD	5,08	0,00
1.172.139	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO KSC	KWD	2.422.986,48	0,32	41.044	YANDEX NV - A	USD	4,10	0,00
			<b>4.636.365,50</b>	<b>0,61</b>				<b>9,18</b>	<b>0,00</b>
<b>Bermuda</b>					<b>Zypern</b>				
704.000	ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY LTD	HKD	448.206,20	0,06	23.842	TCS GROUP HOLDING PLC	USD	2,38	0,01
2.578.000	BEIJING ENTERPRISES WATER GROUP LTD	HKD	790.277,45	0,11				<b>2,38</b>	<b>0,01</b>
698.000	BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE HOLDINGS LTD	HKD	650.637,18	0,09					
312.000	CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD	HKD	1.321.203,55	0,17					
5.900	CREDICORP LTD	USD	1.014.033,00	0,13					
1.128.000	GOME RETAIL HOLDINGS LTD	HKD	70.413,07	0,01					
								<b>756.821.694,92</b>	<b>99,19</b>
					<b>Anleihen und andere Schuldtitel</b>				
					<b>Indien</b>				
					397.213	BRITANNIA INDUSTRIES LTD 5.500% 03/06/2024	INR	1.520,08	0,00
								<b>1.520,08</b>	<b>0,00</b>
								<b>1.520,08</b>	<b>0,00</b>
					<b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>				
					<b>Aktien</b>				
					<b>Russland</b>				
					97.724	MAGNIT PJSC	USD	9,77	0,00
					95.900	MOBILE TELESYSTEMS PJSC ADR	USD	9,59	0,00
					469.460	MOSCOW EXCHANGE MICEX-RTS PJSC	USD	46,95	0,00

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.



## NN (L) Emerging Markets Enhanced Index Sustainable Equity

(ausgedrückt in USD)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW
1.328.980	NOVOLIPETSK STEEL PJSC	USD	132,90	0,00
1.881.270	SBERBANK OF RUSSIA PJSC	USD	188,13	0,00
1.782.350	UNITED CO RUSAL INTERNATIONAL PJSC	USD	178,24	0,00
1.816.220.000	VTB BANK PJSC	USD	181.622,00	0,02
			<b>182.187,58</b>	<b>0,02</b>
			<b>182.187,58</b>	<b>0,02</b>

**Wertpapierbestand Gesamt** 757.005.402,58 99,21

### Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022

Zu erhalten	Zu zahlen	Fälligkeits- datum	Engagement in USD	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in USD
-------------	-----------	-----------------------	----------------------	---

#### Devisentermingeschäfte

180.063.281,64	PLN	42.440.887,82	USD	19/04/2022	42.440.887,82	708.681,36
296,11	USD	269,83	EUR	19/04/2022	296,11	(4,25)
1.901,04	EUR	2.121,01	USD	19/04/2022	2.121,01	(4,90)
6.857.313,51	USD	29.577.035,03	PLN	19/04/2022	6.857.313,51	(230.396,47)
					<b>49.300.618,45</b>	<b>478.275,74</b>

**Derivative Finanzinstrumente Gesamt** 478.275,74

### Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick

		% NIW
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	<b>757.005.402,58</b>	<b>99,21</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	<b>478.275,74</b>	<b>0,06</b>
<b>Bankguthaben</b>	<b>4.104.396,62</b>	<b>0,54</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>	<b>1.418.204,39</b>	<b>0,19</b>
<b>Nettovermögen Gesamt</b>	<b>763.006.279,33</b>	<b>100,00</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Emerging Markets High Dividend

(ausgedrückt in EUR)

### Statistische Angaben

<b>Nettovermögen</b>	31.03.2022	EUR	177.299.811,62	<b>Capitalisation Zz (EUR)</b>	31.03.2022	EUR	6.951,44
	30.09.2021	EUR	189.300.228,00		30.09.2021	EUR	7.316,38
	30.09.2020	EUR	205.342.749,48		30.09.2020	EUR	6.296,11
<b>Nettoinventarwert pro Anteil**</b>				<b>Distribution N (EUR)</b>	31.03.2022	EUR	872,12
					30.09.2021	EUR	944,23
					30.09.2020	EUR	843,36
<b>Capitalisation I (EUR)</b>	31.03.2022	EUR	7.694,27	<b>Distribution P (EUR)</b>	31.03.2022	EUR	798,00
	30.09.2021	EUR	8.132,66		30.09.2021	EUR	867,74
	30.09.2020	EUR	7.058,70		30.09.2020	EUR	781,80
<b>Capitalisation I (USD)</b>	31.03.2022	USD	75,94	<b>Distribution R (EUR)</b>	31.03.2022	EUR	237,42
	30.09.2021	USD	83,60		30.09.2021	EUR	257,15
	30.09.2020	USD	73,42		30.09.2020	EUR	229,92
<b>Capitalisation I Hedged (i) (CZK)</b>	31.03.2022	CZK	183.520,59	<b>Distribution X (M) (USD)</b>	31.03.2022	USD	209,27
	30.09.2021	CZK	190.540,91		30.09.2021	USD	236,34
	30.09.2020	CZK	164.954,78		30.09.2020	USD	217,56
<b>Capitalisation I Hedged (i) (PLN)</b>	31.03.2022	PLN	33.004,95	<b>Distribution Y (M) (USD)</b>	31.03.2022	USD	200,31
	30.09.2021	PLN	34.509,03		30.09.2021	USD	227,50
	30.09.2020	PLN	29.874,25		30.09.2020	USD	211,75
<b>Capitalisation N (EUR)</b>	31.03.2022	EUR	321,29	<b>Anzahl der Anteile</b>			
	30.09.2021	EUR	339,91		<b>Capitalisation I (EUR)</b>	31.03.2022	4.076
	30.09.2020	EUR	295,59		30.09.2021	4.052	
<b>Capitalisation N (USD)</b>	31.03.2022	USD	114,88	30.09.2020	6.310		
	30.09.2021	USD	126,60	<b>Capitalisation I (USD)</b>	31.03.2022	224.402	
	30.09.2020	USD	111,39	30.09.2021	242.074		
<b>Capitalisation P (EUR)</b>	31.03.2022	EUR	299,35	30.09.2020	270.854		
	30.09.2021	EUR	318,04	<b>Capitalisation I Hedged (i) (CZK)</b>	31.03.2022	1.158	
	30.09.2020	EUR	278,92	30.09.2021	1.158		
<b>Capitalisation P (USD)</b>	31.03.2022	USD	106,98	30.09.2020	1.158		
	30.09.2021	USD	118,40	<b>Capitalisation I Hedged (i) (PLN)</b>	31.03.2022	2.032	
	30.09.2020	USD	105,06	30.09.2021	2.308		
<b>Capitalisation R (EUR)</b>	31.03.2022	EUR	267,85	30.09.2020	1.637		
	30.09.2021	EUR	283,52	<b>Capitalisation N (EUR)</b>	31.03.2022	219.258	
	30.09.2020	EUR	246,79	30.09.2021	208.469		
<b>Capitalisation X (EUR)</b>	31.03.2022	EUR	1.114,32	30.09.2020	252.785		
	30.09.2021	EUR	1.186,87	<b>Capitalisation N (USD)</b>	31.03.2022	1.987	
	30.09.2020	EUR	1.046,13	30.09.2021	2.037		
<b>Capitalisation X (USD)</b>	31.03.2022	USD	58,96	30.09.2020	2.823		
	30.09.2021	USD	65,41	<b>Capitalisation P (EUR)</b>	31.03.2022	18.447	
	30.09.2020	USD	58,33	30.09.2021	19.661		
<b>Capitalisation X Hedged (i) (CZK)</b>	31.03.2022	CZK	1.224,45	30.09.2020	20.756		
	30.09.2021	CZK	1.284,45	<b>Capitalisation P (USD)</b>	31.03.2022	134.889	
	30.09.2020	CZK	1.129,00	30.09.2021	152.032		
<b>Capitalisation Y (USD)</b>	31.03.2022	USD	236,68	30.09.2020	173.640		
	30.09.2021	USD	263,89				
	30.09.2020	USD	237,70				

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

## NN (L) Emerging Markets High Dividend

(ausgedrückt in EUR)

### Statistische Angaben (Fortsetzung)

#### Anzahl der Anteile

Capitalisation R (EUR)	31.03.2022	92
	30.09.2021	92
	30.09.2020	184
Capitalisation X (EUR)	31.03.2022	1.069
	30.09.2021	1.328
	30.09.2020	669
Capitalisation X (USD)	31.03.2022	19.251
	30.09.2021	19.899
	30.09.2020	26.952
Capitalisation X Hedged (i) (CZK)	31.03.2022	79.010
	30.09.2021	83.129
	30.09.2020	106.188
Capitalisation Y (USD)	31.03.2022	5.814
	30.09.2021	7.383
	30.09.2020	680
Capitalisation Zz (EUR)	31.03.2022	724
	30.09.2021	743
	30.09.2020	2.967
Distribution N (EUR)	31.03.2022	1.599
	30.09.2021	1.625
	30.09.2020	1.412
Distribution P (EUR)	31.03.2022	5.432
	30.09.2021	4.874
	30.09.2020	3.672
Distribution R (EUR)	31.03.2022	144
	30.09.2021	173
	30.09.2020	330
Distribution X (M) (USD)	31.03.2022	200
	30.09.2021	531
	30.09.2020	263
Distribution Y (M) (USD)	31.03.2022	268
	30.09.2021	164
	30.09.2020	859
<b>Dividende</b>		
Distribution N (EUR)	14.12.2021 EUR	21,55
Distribution P (EUR)	14.12.2021 EUR	19,85
Distribution R (EUR)	14.12.2021 EUR	5,85
Distribution X (M) (USD)	02.03.2022 USD	0,68

Distribution X (M) (USD)	07.02.2022 USD	0,68
Distribution X (M) (USD)	04.01.2022 USD	0,68
Distribution X (M) (USD)	02.12.2021 USD	0,68
Distribution X (M) (USD)	02.11.2021 USD	0,68
Distribution X (M) (USD)	04.10.2021 USD	0,68
Distribution Y (M) (USD)	02.03.2022 USD	0,67
Distribution Y (M) (USD)	07.02.2022 USD	0,67
Distribution Y (M) (USD)	04.01.2022 USD	0,67
Distribution Y (M) (USD)	02.12.2021 USD	0,67
Distribution Y (M) (USD)	02.11.2021 USD	0,67
Distribution Y (M) (USD)	04.10.2021 USD	0,67
<b>Laufende Kosten in %*</b>		
Capitalisation I (EUR)	31.03.2022	0,86%
Capitalisation I (USD)	31.03.2022	0,86%
Capitalisation I Hedged (i) (CZK)	31.03.2022	0,88%
Capitalisation I Hedged (i) (PLN)	31.03.2022	0,88%
Capitalisation N (EUR)	31.03.2022	1,05%
Capitalisation N (USD)	31.03.2022	1,05%
Capitalisation P (EUR)	31.03.2022	1,90%
Capitalisation P (USD)	31.03.2022	1,90%
Capitalisation R (EUR)	31.03.2022	1,15%
Capitalisation X (EUR)	31.03.2022	2,40%
Capitalisation X (USD)	31.03.2022	2,40%
Capitalisation X Hedged (i) (CZK)	31.03.2022	2,42%
Capitalisation Y (USD)	31.03.2022	3,40%
Capitalisation Zz (EUR)	31.03.2022	0,01%
Distribution N (EUR)	31.03.2022	1,05%

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

## NN (L) Emerging Markets High Dividend

(ausgedrückt in EUR)

### Statistische Angaben (Fortsetzung)

Distribution P (EUR)	31.03.2022	1,90%
Distribution R (EUR)	31.03.2022	1,15%
Distribution X (M) (USD)	31.03.2022	2,40%
Distribution Y (M) (USD)	31.03.2022	3,39%
<b>Portfolioumsatz in %*</b>	31.03.2022	204,64%

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwasige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

## NN (L) Emerging Markets High Dividend

(ausgedrückt in EUR)

### Finanzabschlüsse

#### Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022

	Erläuterungen	
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	2	<b>176.038.113,65</b>
Aktien		176.035.151,29
Anleihen und andere Schuldtitel		2.962,36
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	2	<b>678.099,97</b>
Devisentermingeschäfte		678.099,97
<b>Bankguthaben</b>		<b>1.726.746,42</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte</b>	4	<b>1.734.683,86</b>
<b>Vermögenswerte Gesamt</b>		<b>180.177.643,90</b>
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>	4, 12	<b>(2.877.832,28)</b>
<b>Verbindlichkeiten Gesamt</b>		<b>(2.877.832,28)</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Berichtszeitraums</b>		<b>177.299.811,62</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Emerging Markets High Dividend

(ausgedrückt in EUR)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW	Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
<b>Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>									
<b>Aktien</b>									
<b>Kaimaninseln</b>									
50.168	ALIBABA GROUP HOLDING LTD ADR	USD	4.905.656,23	2,77	82.584	ASIAN PAINTS LTD	INR	3.017.355,79	1,70
6.900	BEIGENE LTD ADR	USD	1.169.586,12	0,66	49.900	AUROBINDO PHARMA LTD	INR	396.014,33	0,22
67.000	CHAILEASE HOLDING CO LTD	TWD	531.862,06	0,30	5.600	AVENUE SUPERMARTS LTD	INR	266.430,93	0,15
321.000	CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDINGS LTD	HKD	452.880,17	0,26	8.000	BAJAJ AUTO LTD	INR	346.908,69	0,20
140.400	CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS LTD	HKD	481.387,80	0,27	8.700	BAJAJ FINSERV LTD	INR	1.765.571,04	1,00
122.000	COUNTRY GARDEN SERVICES HOLDINGS CO LTD	HKD	466.621,64	0,26	19.800	BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	INR	502.034,24	0,28
338.000	DONGYUE GROUP LTD	HKD	416.656,38	0,24	205.500	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	INR	877.846,23	0,50
543.200	GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LTD	HKD	760.922,41	0,42	25.700	BRITANNIA INDUSTRIES LTD	INR	976.140,21	0,55
163.900	HAITIAN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	HKD	380.491,98	0,21	60.000	HAVELLS INDIA LTD	INR	821.078,49	0,46
9.000	INNOVENT BIOLOGICS INC	HKD	27.552,52	0,02	13.400	HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	INR	341.446,33	0,19
7.585	JD.COM INC - A	HKD	196.027,50	0,11	172.900	HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	INR	1.104.690,42	0,62
85.000	KE HOLDINGS INC	USD	944.996,18	0,53	7.100	HINDUSTAN UNILEVER LTD	INR	172.672,42	0,10
318.000	LEE & MAN PAPER MANUFACTURING LTD	HKD	149.018,40	0,08	5.000	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP LTD	INR	141.816,59	0,08
187.700	LI NING CO LTD	HKD	1.446.971,76	0,82	131.500	INDIAN OIL CORP LTD	INR	185.722,36	0,10
59.216	MEITUAN - B	HKD	1.037.738,18	0,59	9.200	IPCA LABORATORIES LTD	INR	116.416,42	0,07
38.200	NETEASE INC	HKD	610.347,25	0,34	17.200	MARUTI SUZUKI INDIA LTD	INR	1.543.124,06	0,87
23.100	NETEASE INC ADR	USD	1.862.076,12	1,05	28.200	MUTHOOT FINANCE LTD	INR	445.817,79	0,25
91.600	NIO INC ADR	USD	1.732.961,85	0,98	3.916	NESTLE INDIA LTD	INR	807.096,68	0,46
12.000	SILERGY CORP	TWD	1.289.625,37	0,73	60.400	RELIANCE INDUSTRIES LTD	INR	1.889.345,73	1,07
61.300	SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	HKD	881.603,27	0,50	17.200	SIEMENS LTD	INR	482.833,54	0,27
152.300	TENCENT HOLDINGS LTD	HKD	6.422.512,02	3,62	142.000	TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	INR	1.310.536,90	0,74
242.000	TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LTD	HKD	386.208,81	0,22	109.100	TATA STEEL LTD	INR	1.692.697,69	0,95
196.000	TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	HKD	147.324,95	0,08	67.600	TECH MAHINDRA LTD	INR	1.201.801,46	0,68
28.400	TRIP.COM GROUP LTD - ADR	USD	590.129,87	0,33	4.500	TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	INR	149.112,46	0,08
483.000	WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	HKD	401.010,67	0,23	58.700	UNITED SPIRITS LTD	INR	619.529,78	0,35
113.300	WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	HKD	841.068,24	0,47	242.600	WIPRO LTD	INR	1.704.688,26	0,96
142.000	ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS LTD	HKD	898.939,33	0,51				<b>22.878.728,84</b>	<b>12,90</b>
292.500	3S BIO INC	HKD	214.501,89	0,12					
			<b>29.646.678,97</b>	<b>16,72</b>					
<b>Taiwan</b>									
119.900	ACCTON TECHNOLOGY CORP	TWD	833.497,59	0,47	<b>Südkorea</b>				
653.000	AU OPTRONICS CORP	TWD	403.269,52	0,23	11.080	CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	KRW	534.885,69	0,30
121.988	CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL HOLDING CORP	TWD	35.147,77	0,02	3.300	CJ CORP	KRW	206.349,96	0,12
3.410.685	CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL HOLDING CORP	TWD	2.052.764,87	1,15	2.500	CJ ENM CO LTD	KRW	243.427,43	0,14
2.453.000	CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD	TWD	2.257.424,82	1,27	1.900	CJ LOGISTICS CORP	KRW	182.221,93	0,10
14.000	ECLAT TEXTILE CO LTD	TWD	209.511,57	0,12	13.200	COWAY CO LTD	KRW	669.223,40	0,38
63.000	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	TWD	186.187,38	0,11	11.000	GS HOLDINGS	KRW	357.838,24	0,20
75.650	HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	TWD	107.797,66	0,06	18.700	HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO LTD	KRW	465.189,68	0,26
143.800	HON HAI PRECISION INDUSTRY CO LTD	TWD	478.149,12	0,27	1.530	HANMI PHARM CO LTD	KRW	310.220,45	0,17
1.073.000	INNOLUX CORP	TWD	566.415,30	0,32	58.200	HMM CO LTD	KRW	1.257.678,19	0,71
19.900	MEDIATEK INC	TWD	564.884,24	0,32	4.100	HYUNDAI GLOVIS CO LTD	KRW	584.908,04	0,33
191.000	NAN YA PLASTICS CORP	TWD	557.981,15	0,31	1.552	KOREA ZINC CO LTD	KRW	672.852,66	0,38
135.000	NOVATEK MICROELECTRONICS CORP	TWD	1.805.083,88	1,02	14.300	NAVER CORP	KRW	3.596.427,94	2,03
344.000	POU CHEN CORP	TWD	340.222,26	0,19	5.800	ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	KRW	381.665,71	0,22
110.000	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	TWD	1.483.920,15	0,84	6.700	POSCO HOLDINGS INC	KRW	1.454.389,56	0,82
223.000	TAIWAN MOBILE CO LTD	TWD	733.955,03	0,41	7.700	SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO LTD	KRW	941.973,36	0,53
651.847	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING CO LTD	TWD	12.155.056,01	6,86	146.066	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	KRW	7.539.217,41	4,25
9.000	VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY CORP	TWD	411.833,41	0,23	38.832	SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	KRW	753.176,88	0,42
16.000	WAN HAI LINES LTD	TWD	79.933,46	0,05	150.900	SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES CO LTD	KRW	634.099,98	0,36
3.000	WIWYNN CORP	TWD	95.930,31	0,05	7.600	SAMSUNG SDS CO LTD	KRW	778.576,05	0,44
			<b>25.358.965,50</b>	<b>14,30</b>	15.700	SAMSUNG SECURITIES CO LTD	KRW	487.001,28	0,27
					8.700	SEEGENE INC	KRW	330.719,61	0,19
								<b>22.382.043,45</b>	<b>12,62</b>
					<b>China</b>				
					361.000	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD - H	HKD	1.662.131,92	0,94
					568.000	CHINA COMMUNICATIONS SERVICES CORP LTD - H	HKD	230.633,13	0,13
					3.698.500	CHINA CONSTRUCTION BANK CORP - H	HKD	2.492.088,96	1,40
					359.600	CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CORP LTD - H	HKD	718.514,88	0,41
					507.000	CHINA LIFE INSURANCE CO LTD - H	HKD	695.614,29	0,39
					1.221.000	CHINA MOLYBDENUM CO LTD - H	HKD	571.550,30	0,32

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Emerging Markets High Dividend

(ausgedrückt in EUR)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW	Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
602.000	CHINA RAILWAY GROUP LTD	HKD	302.024,52	0,17					
590.400	CHINA VANKE CO LTD - H	HKD	1.197.029,18	0,68					
387.000	CHONGQING RURAL COMMERCIAL BANK CO LTD - H	HKD	136.898,60	0,08					
256.480	COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD - H	HKD	400.358,57	0,23					
178.800	FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD - H	HKD	655.091,34	0,37					
23.800	HUADONG MEDICINE CO LTD	CNH	112.270,71	0,06					
6.516.369	INDUSTRIAL & COMMERCIAL BANK OF CHINA LTD - H	HKD	3.590.340,89	2,02				<b>5.825.533,03</b>	<b>3,29</b>
339.100	JIANGXI COPPER CO LTD - H	HKD	511.008,32	0,29					
277.500	NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD - H	HKD	694.385,50	0,39					
2.203.000	PEOPLE'S INSURANCE CO GROUP - H	HKD	648.284,60	0,37					
44.900	PHARMARON BEIJING CO LTD - H	HKD	486.854,25	0,27					
251.000	SHANDONG GOLD MINING CO LTD - H	HKD	451.865,36	0,25					
278.000	SINOPHARM GROUP CO LTD - H	HKD	568.303,81	0,32					
629.400	WEICHAI POWER CO LTD - H	HKD	889.565,90	0,50					
42.300	WUXI APPTec CO LTD - H	HKD	602.063,72	0,34					
153.000	ZHAOJIN MINING INDUSTRY CO LTD	HKD	121.669,59	0,07					
			<b>17.738.548,34</b>	<b>10,00</b>					
	<b>Brasilien</b>								
129.671	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES SA	BRL	626.863,91	0,35					
114.900	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	BRL	825.362,15	0,47					
258.300	CIA ENERGETICA DE MINAS GERAIS - PREF	BRL	743.058,80	0,42					
25.533	GETNET ADQUIRENCIA E SERVICOS PARA MEIOS DE PAGAMENTO SA	BRL	17.626,43	0,01					
92.400	HYPERA SA	BRL	676.495,18	0,38					
725.100	ITAU UNIBANCO HOLDING SA - PREF	BRL	3.768.636,02	2,13					
1.101.295	ITAUSA SA	BRL	2.239.142,29	1,25					
144.000	LOCALIZA RENT A CAR SA	BRL	1.664.076,41	0,94					
267.900	VIBRA ENERGIA SA	BRL	1.184.641,06	0,67					
			<b>11.745.902,25</b>	<b>6,62</b>					
	<b>Südafrika</b>								
15.700	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	ZAR	2.261.101,08	1,28					
98.200	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	ZAR	1.359.154,41	0,77					
42.200	MR PRICE GROUP LTD	ZAR	561.962,45	0,32					
37.700	TIGER BRANDS LTD	ZAR	375.409,35	0,21					
76.000	VODACOM GROUP LTD	ZAR	747.911,94	0,42					
240.500	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD/SOUTH AFRICA	ZAR	854.691,74	0,47					
			<b>6.160.230,97</b>	<b>3,47</b>					
	<b>Indonesien</b>								
760.200	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	IDR	313.108,50	0,18					
4.207.900	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	IDR	2.098.840,37	1,18					
5.318.000	KALBE FARMA TBK PT	IDR	535.868,60	0,30					
2.075.400	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	IDR	588.740,00	0,33					
7.530.300	TELKOM INDONESIA PERSERO TBK PT	IDR	2.155.623,15	1,22					
1.923.600	UNILEVER INDONESIA TBK PT	IDR	440.157,98	0,25					
			<b>6.132.338,60</b>	<b>3,46</b>					
	<b>Saudi-Arabien</b>								
30.387	ADVANCED PETROCHEMICAL CO	SAR	513.231,64	0,29					
42.477	AL RAJHI BANK	SAR	1.634.121,45	0,92					
6.800	JARIR MARKETING CO	SAR	320.930,96	0,18					
82.100	SAHARA INTERNATIONAL PETROCHEMICAL CO	SAR	1.056.218,86	0,60					
192.100	SAUDI ELECTRICITY CO	SAR	1.219.578,37	0,70					
53.100	SAUDI INDUSTRIAL INVESTMENT GROUP	SAR	445.244,99	0,25					
32.200	SAUDI TELECOM CO	SAR	831.593,54	0,47					
			<b>6.020.919,81</b>	<b>3,41</b>					
	<b>Vereinigte Arabische Emirate</b>								
607.600	ABU DHABI NATIONAL OIL CO FOR DISTRIBUTION PJSC	AED	624.426,95	0,35					
942.200	ALDAR PROPERTIES PJSC	AED	1.136.592,01	0,65					
456.322	DUBAI ISLAMIC BANK PJSC	AED	688.923,74	0,39					
584.552	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	AED	3.375.590,33	1,90					
			<b>5.825.533,03</b>	<b>3,29</b>					
	<b>Mexiko</b>								
453.700	ALFA SAB DE CV - A	MXN	309.167,11	0,17					
2.068.300	AMERICA MOVIL SAB DE CV	MXN	1.964.042,04	1,11					
160.900	FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB DE CV	MXN	1.197.515,20	0,68					
55.420	GRUPO AEROPORTUARIO DEL PACIFICO SAB DE CV - B	MXN	800.835,63	0,45					
113.200	WAL-MART DE MEXICO SAB DE CV	MXN	415.843,61	0,23					
			<b>4.687.403,59</b>	<b>2,64</b>					
	<b>Malaysia</b>								
404.500	HARTALEGA HOLDINGS BHD	MYR	419.299,74	0,24					
55.800	HONG LEONG BANK BHD	MYR	240.713,70	0,14					
322.600	KOSSAN RUBBER INDUSTRIES BHD	MYR	135.234,22	0,08					
393.800	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	MYR	808.109,65	0,46					
507.500	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDINGS	MYR	672.537,80	0,38					
289.000	SIME DARBY BHD	MYR	148.240,19	0,08					
1.296.500	TOP GLOVE CORP BHD	MYR	533.005,69	0,29					
			<b>2.957.140,99</b>	<b>1,67</b>					
	<b>Hongkong</b>								
260.000	CHINA MERCHANTS HOLDINGS INTERNATIONAL CO LTD	HKD	422.286,27	0,24					
299.500	CHINA RESOURCES PHARMACEUTICAL GROUP LTD	HKD	139.858,06	0,08					
626.000	CHINA TRADITIONAL CHINESE MEDICINE HOLDINGS CO LTD	HKD	293.736,76	0,17					
104.000	GUANGDONG INVESTMENT LTD	HKD	127.824,17	0,07					
1.658.000	LENOVO GROUP LTD	HKD	1.616.512,31	0,91					
132.900	SINOTRUK HONG KONG LTD	HKD	182.254,53	0,10					
			<b>2.782.472,10</b>	<b>1,57</b>					
	<b>Thailand</b>								
40.600	DELTA ELECTRONICS THAILAND PCL	THB	425.901,75	0,24					
2.045.000	LAND & HOUSES PCL	THB	525.157,80	0,30					
197.200	MUANGTHAI CAPITAL PCL	THB	280.092,25	0,16					
411.200	PTT OIL & RETAIL BUSINESS PCL	THB	277.583,67	0,16					
330.100	PTT PCL	THB	344.738,46	0,19					
378.500	PTT PCL-NVDR	THB	394.694,07	0,22					
243.100	SRI TRANG GLOVES THAILAND PCL	THB	165.896,68	0,09					
98.200	SRI SAWAD CORP PCL	THB	151.156,32	0,09					
			<b>2.565.221,00</b>	<b>1,45</b>					
	<b>Katar</b>								
345.600	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDING CO	QAR	248.197,85	0,15					
73.300	QATAR ISLAMIC BANK SAQ	QAR	431.262,33	0,24					
209.500	QATAR NATIONAL BANK QPSC	QAR	1.192.787,05	0,67					
			<b>1.872.247,23</b>	<b>1,06</b>					
	<b>Kuwait</b>								
126.600	AGILITY PUBLIC WAREHOUSING CO KSC	KWD	413.856,35	0,23					
227.745	NATIONAL BANK OF KUWAIT	KWD	740.457,58	0,42					
			<b>1.154.313,93</b>	<b>0,65</b>					
	<b>Polen</b>								
42.000	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN SA	PLN	688.603,14	0,39					

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Emerging Markets High Dividend

(ausgedrückt in EUR)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
253.300	POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I GAZOWNICTWO SA	PLN	339.030,53	0,19
			<b>1.027.633,67</b>	<b>0,58</b>
<b>Bermuda</b>				
846.000	BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE HOLDINGS LTD	HKD	708.753,54	0,40
672.000	CHINA RUYI HOLDINGS LTD	HKD	162.892,46	0,09
219.000	HUABAO INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	HKD	109.472,66	0,06
			<b>981.118,66</b>	<b>0,55</b>
<b>Ägypten</b>				
397.654	COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK EGYPT SAE	EGP	903.063,72	0,51
			<b>903.063,72</b>	<b>0,51</b>
<b>Ungarn</b>				
57.200	MOL HUNGARIAN OIL & GAS PLC	HUF	456.366,32	0,26
20.500	RICHTER GEDEON NYRT	HUF	391.869,00	0,22
			<b>848.235,32</b>	<b>0,48</b>
<b>Griechenland</b>				
12.900	JUMBO SA	EUR	174.150,00	0,10
28.000	OPAP SA	EUR	369.600,00	0,21
			<b>543.750,00</b>	<b>0,31</b>
<b>Türkei</b>				
69.400	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	TRY	359.968,35	0,20
12.000	TURKIYE PETROL RAFINERILERI AS	TRY	157.646,35	0,09
			<b>517.614,70</b>	<b>0,29</b>
<b>Peru</b>				
48.700	CIA DE MINAS BUENAVENTURA SAA	USD	440.757,65	0,25
			<b>440.757,65</b>	<b>0,25</b>
<b>Kolumbien</b>				
406.800	ECOPETROL SA	COP	344.603,74	0,19
			<b>344.603,74</b>	<b>0,19</b>
<b>Tschechische Republik</b>				
88.900	MONETA MONEY BANK AS	CZK	325.930,33	0,19
			<b>325.930,33</b>	<b>0,19</b>
<b>Chile</b>				
18.300	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	CLP	123.083,75	0,07
			<b>123.083,75</b>	<b>0,07</b>
<b>Luxemburg</b>				
300	GLOBANT SA	USD	70.661,03	0,04
			<b>70.661,03</b>	<b>0,04</b>
			<b>176.035.141,17</b>	<b>99,29</b>

### Anleihen und andere Schuldtitel

#### Indien

861.300	BRITANNIA INDUSTRIES LTD 5.500% 03/06/2024	INR	2.962,36	0,00
			<b>2.962,36</b>	<b>0,00</b>
			<b>2.962,36</b>	<b>0,00</b>

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
-----------------------	-------------	---------	---------------------	----------

### Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente

#### Aktien

##### Russland

307.090	GAZPROM PJSC	RUB	0,34	0,00
8.811.600	INTER RAO UES PJSC	RUB	9,62	0,00
43.000	LUKOIL PJSC	RUB	0,05	0,00
102.412	TATNEFT PJSC	RUB	0,11	0,00
			<b>10,12</b>	<b>0,00</b>
			<b>10,12</b>	<b>0,00</b>

### Wertpapierbestand Gesamt

**176.038.113,65 99,29**

### Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022

Zu erhalten	Zu zahlen	Fälligkeits- datum	Engagement in EUR	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR
-------------	-----------	-----------------------	----------------------	---

#### Devisentermingeschäfte

340.133.733,48	CZK	13.402.510,49	EUR	19/04/2022	13.402.510,49	492.407,27
77.586.834,53	PLN	16.395.856,92	EUR	19/04/2022	16.395.856,92	307.052,43
1.198.002,64	EUR	30.205.398,81	CZK	19/04/2022	1.198.002,64	(35.928,29)
2.680.511,49	EUR	12.848.106,41	PLN	19/04/2022	2.680.511,49	(85.431,44)
					<b>33.676.881,54</b>	<b>678.099,97</b>

### Derivative Finanzinstrumente Gesamt

**678.099,97**

### Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick

	Wertpapierbestand Gesamt	Derivative Finanzinstrumente Gesamt	Bankguthaben	Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	Nettovermögen Gesamt
	176.038.113,65	678.099,97	1.726.746,42	(1.143.148,42)	177.299.811,62
	<b>99,29</b>	<b>0,38</b>	<b>0,97</b>	<b>(0,64)</b>	<b>100,00</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.



## NN (L) Energy

(ausgedrückt in USD)

### Statistische Angaben

### Anzahl der Anteile

<b>Nettovermögen</b>	31.03.2022	USD	120.110.802,84	Capitalisation I (USD)	31.03.2022	14.960	
	30.09.2021	USD	138.971.377,51		30.09.2021	10.515	
	30.09.2020	USD	97.344.259,64		30.09.2020	9.986	
<b>Nettoinventarwert pro Anteil**</b>				Capitalisation P (EUR)	31.03.2022	20.095	
					30.09.2021	19.694	
					30.09.2020	22.945	
Capitalisation I (USD)	31.03.2022	USD	1.456,73	Capitalisation P (USD)	31.03.2022	12.447	
	30.09.2021	USD	1.082,07		30.09.2021	13.946	
	30.09.2020	USD	667,54		30.09.2020	17.479	
Capitalisation P (EUR)	31.03.2022	EUR	240,42	Capitalisation R (EUR)	31.03.2022	558	
	30.09.2021	EUR	172,30		30.09.2021	558	
	30.09.2020	EUR	106,10		30.09.2020	856	
Capitalisation P (USD)	31.03.2022	USD	1.235,59	Capitalisation R (USD)	31.03.2022	2.021	
	30.09.2021	USD	922,34		30.09.2021	2.522	
	30.09.2020	USD	574,66		30.09.2020	2.787	
Capitalisation R (EUR)	31.03.2022	EUR	285,87	Capitalisation X (EUR)	31.03.2022	8.916	
	30.09.2021	EUR	204,11		30.09.2021	13.025	
	30.09.2020	EUR	124,74		30.09.2020	14.921	
Capitalisation R (USD)	31.03.2022	USD	254,95	Capitalisation X (HUF)	31.03.2022	10.682	
	30.09.2021	USD	189,61		30.09.2021	8.727	
	30.09.2020	USD	117,25		30.09.2020	6.011	
Capitalisation X (EUR)	31.03.2022	EUR	829,42	Capitalisation X (USD)	31.03.2022	36.182	
	30.09.2021	EUR	595,85		30.09.2021	66.419	
	30.09.2020	EUR	368,73		30.09.2020	86.603	
Capitalisation X (HUF)	31.03.2022	HUF	66.656,03	Capitalisation X Hedged (i) (CZK)	31.03.2022	31.752	
	30.09.2021	HUF	46.840,80		30.09.2021	52.328	
	30.09.2020	HUF	29.308,45		30.09.2020	62.185	
Capitalisation X (USD)	31.03.2022	USD	1.113,06	Capitalisation Y (USD)	31.03.2022	52.862	
	30.09.2021	USD	832,89		30.09.2021	178.270	
	30.09.2020	USD	521,49		30.09.2020	123.918	
Capitalisation X Hedged (i) (CZK)	31.03.2022	CZK	5.728,85	Distribution P (USD)	31.03.2022	1.479	
	30.09.2021	CZK	4.257,44		30.09.2021	1.902	
	30.09.2020	CZK	2.698,68		30.09.2020	2.533	
Capitalisation Y (USD)	31.03.2022	USD	205,78	Distribution R (USD)	31.03.2022	1.761	
	30.09.2021	USD	154,76		30.09.2021	1.681	
	30.09.2020	USD	97,87		30.09.2020	2.015	
Distribution P (USD)	31.03.2022	USD	4.491,98	<b>Dividende</b>			
	30.09.2021	USD	3.409,84				
	30.09.2020	USD	2.181,62				
Distribution R (USD)	31.03.2022	USD	229,65	Distribution P (USD)	14.12.2021	USD	57,85
	30.09.2021	USD	174,81	Distribution R (USD)	14.12.2021	USD	4,10
	30.09.2020	USD	111,96				

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

## NN (L) Energy

(ausgedrückt in USD)

### Statistische Angaben (Fortsetzung)

#### Laufende Kosten in %\*

Capitalisation I (USD)	31.03.2022	0,81%
Capitalisation P (EUR)	31.03.2022	1,80%
Capitalisation P (USD)	31.03.2022	1,80%
Capitalisation R (EUR)	31.03.2022	1,05%
Capitalisation R (USD)	31.03.2022	1,05%
Capitalisation X (EUR)	31.03.2022	2,30%
Capitalisation X (HUF)	31.03.2022	2,30%
Capitalisation X (USD)	31.03.2022	2,30%
Capitalisation X Hedged (i) (CZK)	31.03.2022	2,32%
Capitalisation Y (USD)	31.03.2022	3,30%
Distribution P (USD)	31.03.2022	1,80%
Distribution R (USD)	31.03.2022	1,05%
<b>Portfolioumsatz in %*</b>	31.03.2022	(78,79%)

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwilige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

## NN (L) Energy

(ausgedrückt in USD)

### Finanzabschlüsse

#### Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022

	Erläuterungen	
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	2	<b>119.242.695,84</b>
Aktien		119.242.695,84
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	2	<b>296.940,61</b>
Devisentermingeschäfte		296.940,61
<b>Bankguthaben</b>		<b>1.118.393,62</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte</b>	4	<b>4.381.037,40</b>
<b>Vermögenswerte Gesamt</b>		<b>125.039.067,47</b>
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>	4, 12	<b>(4.928.264,63)</b>
<b>Verbindlichkeiten Gesamt</b>		<b>(4.928.264,63)</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Berichtszeitraums</b>		<b>120.110.802,84</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Energy

(ausgedrückt in USD)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW
<b>Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>				
<b>Aktien</b>				
<b>Vereinigte Staaten</b>				
6.800	ANTERO RESOURCES CORP	USD	207.604,00	0,17
22.600	BAKER HUGHES CO - A	USD	822.866,00	0,69
20.100	CALIFORNIA RESOURCES CORP	USD	899.073,00	0,75
16.700	CHENIERE ENERGY INC	USD	2.315.455,00	1,93
67.567	CHEVRON CORP	USD	11.001.934,61	9,16
31.356	CONOCOPHILLIPS	USD	3.135.600,00	2,61
44.600	DEVON ENERGY CORP	USD	2.637.198,00	2,20
13.200	DIAMONDBACK ENERGY INC	USD	1.809.456,00	1,51
26.513	EOG RESOURCES INC	USD	3.161.144,99	2,63
128.907	EXXON MOBIL CORP	USD	10.646.429,13	8,86
73.100	HALLIBURTON CO	USD	2.768.297,00	2,30
23.700	HESS CORP	USD	2.536.848,00	2,11
8.300	HF SINCLAIR CORP	USD	330.755,00	0,28
2.300	MAGNOLIA OIL & GAS CORP - A	USD	54.395,00	0,05
55.200	MARATHON PETROLEUM CORP	USD	4.719.600,00	3,93
44.700	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	USD	2.536.278,00	2,11
28.600	ONEOK INC	USD	2.020.018,00	1,68
47.819	PHILLIPS 66	USD	4.131.083,41	3,44
22.580	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	USD	5.645.677,40	4,70
16.600	TARGA RESOURCES CORP	USD	1.252.802,00	1,04
11.871	VALERO ENERGY CORP	USD	1.205.381,34	1,00
230.580	WILLIAMS COS INC	USD	7.703.677,80	6,41
			<b>71.541.573,68</b>	<b>59,56</b>
<b>Vereinigtes Königreich</b>				
955.778	BP PLC	GBP	4.723.498,45	3,93
359.758	SHELL PLC	EUR	9.989.105,47	8,32
			<b>14.712.603,92</b>	<b>12,25</b>
<b>Frankreich</b>				
128.879	TOTALENERGIES SE	EUR	6.600.573,89	5,50
			<b>6.600.573,89</b>	<b>5,50</b>
<b>Curacao</b>				
130.106	SCHLUMBERGER NV	USD	5.374.678,86	4,47
			<b>5.374.678,86</b>	<b>4,47</b>
<b>Kanada</b>				
54.200	ARC RESOURCES LTD	CAD	726.398,46	0,60
70.400	PARKLAND CORP	CAD	2.083.734,04	1,74
20.500	TOURMALINE OIL CORP	CAD	945.358,47	0,79
			<b>3.755.490,97</b>	<b>3,13</b>
<b>Australien</b>				
493.500	SANTOS LTD	AUD	2.868.396,09	2,39
30.100	WOODSIDE PETROLEUM LTD	AUD	725.575,37	0,60
			<b>3.593.971,46</b>	<b>2,99</b>
<b>Italien</b>				
242.300	ENI SPA	EUR	3.583.997,13	2,98
			<b>3.583.997,13</b>	<b>2,98</b>

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW
<b>Norwegen</b>				
92.600	EQUINOR ASA	NOK	3.507.447,39	2,92
			<b>3.507.447,39</b>	<b>2,92</b>
<b>Japan</b>				
243.000	INPEX CORP	JPY	2.882.966,01	2,40
			<b>2.882.966,01</b>	<b>2,40</b>
<b>Spanien</b>				
155.482	REPSOL SA	EUR	2.062.816,76	1,72
			<b>2.062.816,76</b>	<b>1,72</b>
<b>Österreich</b>				
23.500	OMV AG	EUR	1.134.530,24	0,95
			<b>1.134.530,24</b>	<b>0,95</b>
<b>Luxemburg</b>				
21.100	TENARIS SA	EUR	322.924,96	0,27
			<b>322.924,96</b>	<b>0,27</b>
<b>Portugal</b>				
13.200	GALP ENERGIA SGPS SA - B	EUR	169.120,57	0,14
			<b>169.120,57</b>	<b>0,14</b>
			<b>119.242.695,84</b>	<b>99,28</b>
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>			<b>119.242.695,84</b>	<b>99,28</b>

### Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022

Zu erhalten	Zu zahlen	Fälligkeits- datum	Engagement in USD	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in USD
<b>Devisentermingeschäfte</b>				
203.093.729,60	CZK	8.915.272,62 USD	19/04/2022	8.915.272,62
737.934,82	USD	16.735.229,11 CZK	19/04/2022	737.934,82
				(23.066,10)
			<b>9.653.207,44</b>	<b>296.940,61</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>				<b>296.940,61</b>

### Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick

	Marktwert in USD	% NIW
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	<b>119.242.695,84</b>	<b>99,28</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	<b>296.940,61</b>	<b>0,25</b>
<b>Bankguthaben</b>	<b>1.118.393,62</b>	<b>0,93</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>	<b>(547.227,23)</b>	<b>(0,46)</b>
<b>Nettovermögen Gesamt</b>	<b>120.110.802,84</b>	<b>100,00</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Euro Covered Bond

(ausgedrückt in EUR)

### Statistische Angaben

<b>Nettovermögen</b>	31.03.2022	EUR	18.206.444,99
	30.09.2021	EUR	19.230.415,10
	30.09.2020	EUR	25.469.910,57
<b>Nettoinventarwert pro Anteil**</b>			
Capitalisation I (EUR)	31.03.2022	EUR	5.967,20
	30.09.2021	EUR	6.313,62
	30.09.2020	EUR	6.409,46
Capitalisation Z (EUR)	31.03.2022	EUR	6.133,66
	30.09.2021	EUR	6.480,10
	30.09.2020	EUR	6.557,23
Capitalisation Zz (EUR)	31.03.2022	EUR	245.795,23
	30.09.2021	EUR	259.597,74
	30.09.2020	EUR	262.591,57
Distribution N (EUR)	31.03.2022	EUR	262,60
	30.09.2021	EUR	277,96
	30.09.2020	EUR	282,40
<b>Anzahl der Anteile</b>			
Capitalisation I (EUR)	31.03.2022		74
	30.09.2021		74
	30.09.2020		101
Capitalisation Z (EUR)	31.03.2022		0,31
	30.09.2021		0,31
	30.09.2020		6
Capitalisation Zz (EUR)	31.03.2022		70
	30.09.2021		70
	30.09.2020		92
Distribution N (EUR)	31.03.2022		1.699
	30.09.2021		1.698
	30.09.2020		1.796
<b>Laufende Kosten in %*</b>			
Capitalisation I (EUR)	31.03.2022		0,37%
Capitalisation Z (EUR)	31.03.2022		0,06%
Capitalisation Zz (EUR)	31.03.2022		0,01%
Distribution N (EUR)	31.03.2022		0,45%
<b>Portfolioumsatz in %*</b>	31.03.2022		39,00%

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

## NN (L) Euro Covered Bond

(ausgedrückt in EUR)

### Finanzabschlüsse

#### Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022

	Erläuterungen	
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	2	<b>17.919.794,29</b>
Organismen für gemeinsame Anlagen		14.358,34
Anleihen und andere Schuldtitel		17.905.435,95
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	2	<b>20.838,24</b>
Futures		20.838,24
<b>Bankguthaben</b>		<b>105.784,40</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte</b>	4	<b>266.941,81</b>
<b>Vermögenswerte Gesamt</b>		<b>18.313.358,74</b>
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>	4	<b>(106.913,75)</b>
<b>Verbindlichkeiten Gesamt</b>		<b>(106.913,75)</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Berichtszeitraums</b>		<b>18.206.444,99</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Euro Covered Bond

(ausgedrückt in EUR)

## Wertpapierbestand zum 31.03.2022

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW	Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
<b>Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>									
<b>Anleihen und andere Schuldtitel</b>									
<b>Frankreich</b>									
100.000	AXA BANK EUROPE SCF 0.010% 22/01/2027 EMTN	EUR	95.237,92	0,52	200.000	ABN AMRO BANK NV 1.375% 12/01/2037	EUR	198.578,17	1,10
200.000	AXA BANK EUROPE SCF 0.750% 06/03/2029 EMTN	EUR	194.799,48	1,07	100.000	ACHMEA BANK NV 0.010% 16/06/2025	EUR	97.225,40	0,53
400.000	AXA HOME LOAN SFH SA 0.050% 05/07/2027	EUR	379.563,60	2,09	100.000	AEGON BANK NV 0.010% 16/11/2025 EMTN	EUR	96.625,57	0,53
100.000	AXA HOME LOAN SFH SA 0.125% 25/06/2035	EUR	84.516,76	0,46	100.000	COOPERATIVE RABOBANK UA 0.010% 27/11/2040 EMTN	EUR	76.577,30	0,42
200.000	BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL SA 0.750% 08/06/2026 EMTN	EUR	195.934,30	1,08	100.000	COOPERATIVE RABOBANK UA 0.125% 01/12/2031 EMTN	EUR	89.766,26	0,49
100.000	BPCE SA 0.250% 14/01/2031	EUR	88.235,94	0,48	200.000	COOPERATIVE RABOBANK UA 0.875% 01/02/2029	EUR	196.932,11	1,08
100.000	BPCE SFH SA 0.010% 27/05/2030 EMTN	EUR	90.976,70	0,50	200.000	COOPERATIVE RABOBANK UA 1.250% 31/05/2032 EMTN	EUR	199.146,72	1,10
100.000	BPCE SFH SA 0.125% 03/12/2030	EUR	91.157,43	0,50	200.000	DE VOLKSBANK NV 0.500% 30/01/2026 EMTN	EUR	196.781,91	1,08
100.000	BPCE SFH SA 0.500% 23/01/2035	EUR	89.424,75	0,49	100.000	ING BANK NV 0.125% 08/12/2031 EMTN	EUR	89.809,03	0,49
100.000	BPCE SFH SA 0.625% 22/09/2027	EUR	97.770,37	0,54				<b>1.413.113,19</b>	<b>7,76</b>
200.000	BPCE SFH SA 0.625% 29/05/2031	EUR	189.344,86	1,04	<b>Norwegen</b>				
200.000	CAISSE DE REFINANCEMENT DE L'HABITAT SA 0.010% 08/10/2029	EUR	183.666,91	1,01	100.000	DNB BOLIGKREDITT AS 0.010% 08/10/2027	EUR	94.385,83	0,52
300.000	CAISSE DE REFINANCEMENT DE L'HABITAT SA 0.125% 30/04/2027 EMTN	EUR	286.755,20	1,58	233.000	DNB BOLIGKREDITT AS 0.010% 21/01/2031	EUR	209.646,92	1,15
100.000	CAISSE FRANCAISE DE FINANCEMENT LOCAL 0.625% 20/01/2042 EMTN	EUR	85.947,86	0,47	380.000	DNB BOLIGKREDITT AS 0.250% 18/04/2023 EMTN	EUR	381.297,34	2,09
200.000	CAISSE FRANCAISE DE FINANCEMENT LOCAL 1.250% 11/05/2032 EMTN	EUR	199.018,76	1,09	150.000	SPAREBANK 1 BOLIGKREDITT AS 0.010% 22/09/2027	EUR	141.681,62	0,78
100.000	CAISSE FRANCAISE DE FINANCEMENT LOCAL 1.500% 28/06/2038	EUR	100.854,65	0,55	200.000	SPAREBANK 1 BOLIGKREDITT AS 0.125% 05/11/2029 EMTN	EUR	184.688,26	1,01
250.000	CAISSE FRANCAISE DE FINANCEMENT LOCAL 5.375% 08/07/2024 EMTN	EUR	276.656,32	1,52	100.000	SR-BOLIGKREDITT AS 0.010% 10/03/2031 EMTN	EUR	89.557,21	0,49
200.000	CIE DE FINANCEMENT FONCIER SA 2.000% 07/05/2024 EMTN	EUR	205.938,49	1,13	300.000	SR-BOLIGKREDITT AS 0.750% 17/10/2025 EMTN	EUR	298.470,51	1,64
30.000	CIE DE FINANCEMENT FONCIER SA 3.875% 25/04/2055 EMTN	EUR	48.926,24	0,27				<b>1.399.727,69</b>	<b>7,68</b>
100.000	CREDIT AGRICOLE HOME LOAN SFH SA 0.375% 01/02/2033	EUR	90.257,17	0,50	<b>Deutschland</b>				
600.000	CREDIT AGRICOLE HOME LOAN SFH SA 0.750% 05/05/2027 EMTN	EUR	591.710,96	3,26	300.000	COMMERZBANK AG 0.500% 09/06/2026 EMTN	EUR	294.523,11	1,62
200.000	CREDIT AGRICOLE HOME LOAN SFH SA 1.375% 03/02/2032 EMTN	EUR	201.901,15	1,11	218.000	DZ HYP AG 0.010% 12/11/2027 EMTN	EUR	206.052,24	1,13
100.000	CREDIT MUTUEL - HOME LOAN SFH SA 1.000% 30/01/2029 EMTN	EUR	99.210,32	0,54	100.000	ING-DIBA AG 0.625% 25/02/2029 EMTN	EUR	96.756,36	0,53
300.000	CREDIT MUTUEL - HOME LOAN SFH SA 2.500% 11/09/2023 EMTN	EUR	309.883,05	1,70	100.000	SANTANDER CONSUMER BANK AG 0.050% 14/02/2030	EUR	91.781,11	0,50
200.000	LA BANQUE POSTALE HOME LOAN SFH SA 0.625% 23/06/2027 EMTN	EUR	195.938,51	1,08	540.000	UNICREDIT BANK AG 0.625% 20/11/2025 EMTN	EUR	535.296,50	2,95
100.000	SOCIETE GENERALE SFH SA 0.010% 29/10/2029 EMTN	EUR	91.751,59	0,50				<b>1.224.409,32</b>	<b>6,73</b>
100.000	SOCIETE GENERALE SFH SA 0.500% 02/06/2025 EMTN	EUR	98.971,96	0,54	<b>Österreich</b>				
200.000	SOCIETE GENERALE SFH SA 0.500% 30/01/2025	EUR	198.514,89	1,09	300.000	BAWAG PSK BANK FUER ARBEIT UND WIRTSCHAFT UND OESTERREICHISCHE POSTSPARKASSE AG 0.010% 21/01/2028 EMTN	EUR	281.811,01	1,54
			<b>4.862.866,14</b>	<b>26,71</b>	100.000	ERSTE GROUP BANK AG 0.100% 15/01/2030 EMTN	EUR	92.030,13	0,51
<b>Kanada</b>									
200.000	BANK OF MONTREAL 0.125% 26/01/2027 EMTN	EUR	191.231,94	1,05	300.000	ERSTE GROUP BANK AG 0.250% 26/06/2024 EMTN	EUR	297.548,76	1,63
200.000	BANK OF NOVA SCOTIA/THE 0.010% 18/03/2025	EUR	195.168,26	1,07	200.000	ERSTE GROUP BANK AG 16/11/2028 FRN EMTN	EUR	182.697,52	1,00
200.000	CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE 0.040% 09/07/2027 EMTN	EUR	189.330,35	1,04	100.000	UNICREDIT BANK AUSTRIA AG 0.625% 20/03/2029 EMTN	EUR	96.527,75	0,53
100.000	HSBC BANK CANADA 0.010% 14/09/2026	EUR	95.529,39	0,52	200.000	UNICREDIT BANK AUSTRIA AG 2.375% 22/01/2024 EMTN	EUR	206.878,10	1,14
150.000	NATIONAL BANK OF CANADA 0.010% 25/03/2028	EUR	140.320,60	0,77				<b>1.157.493,27</b>	<b>6,35</b>
200.000	ROYAL BANK OF CANADA 0.010% 21/01/2027 EMTN	EUR	190.168,88	1,04	<b>Spanien</b>				
300.000	ROYAL BANK OF CANADA 0.050% 19/06/2026 EMTN	EUR	288.037,65	1,59	400.000	AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FTA 4.250% 25/10/2023	EUR	423.803,42	2,33
200.000	TORONTO-DOMINION BANK/THE ZCP 09/02/2024	EUR	198.241,78	1,09	100.000	CAIXABANK SA 10/07/2026 FRN EMTN	EUR	97.572,08	0,54
			<b>1.488.028,85</b>	<b>8,17</b>	100.000	CAIXABANK SA 2.625% 21/03/2024	EUR	104.008,49	0,57
<b>Niederlande</b>									
100.000	ABN AMRO BANK NV 0.400% 17/09/2041 EMTN	EUR	82.369,54	0,45	100.000	CAIXABANK SA 4.125% 24/03/2036	EUR	133.194,00	0,73
100.000	ABN AMRO BANK NV 0.625% 24/01/2037 EMTN	EUR	89.301,18	0,49	100.000	DEUTSCHE BANK SA ESPANOLA 1.125% 20/01/2023 EMTN	EUR	100.948,22	0,55
					200.000	PROGRAMA CEDULAS TDA FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS 4.250% 28/03/2027	EUR	230.351,72	1,27
								<b>1.089.877,93</b>	<b>5,99</b>
					<b>Australien</b>				
					333.000	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA 0.875% 19/02/2029 EMTN	EUR	325.654,66	1,78
					150.000	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD 0.010% 06/01/2029	EUR	138.278,52	0,76
					100.000	WESTPAC BANKING CORP 0.010% 22/09/2028 EMTN	EUR	92.453,58	0,51
					200.000	WESTPAC BANKING CORP 0.500% 17/05/2024 GMTN	EUR	199.473,45	1,10

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Euro Covered Bond

(ausgedrückt in EUR)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
100.000	WESTPAC BANKING CORP 1.375% 17/05/2032 GMTN	EUR	100.031,30	0,55
			<b>855.891,51</b>	<b>4,70</b>
<b>Südkorea</b>				
200.000	HANA BANK 0.010% 26/01/2026	EUR	192.138,05	1,06
118.000	KOOKMIN BANK 0.052% 15/07/2025	EUR	114.462,73	0,63
200.000	KOREA HOUSING FINANCE CORP 0.010% 07/07/2025	EUR	193.779,89	1,06
200.000	KOREA HOUSING FINANCE CORP 0.100% 18/06/2024	EUR	197.266,17	1,08
			<b>697.646,84</b>	<b>3,83</b>
<b>Neuseeland</b>				
100.000	ANZ NEW ZEALAND INT'L LTD/LONDON 0.200% 23/09/2027 EMTN	EUR	93.279,31	0,51
100.000	ANZ NEW ZEALAND INT'L LTD/LONDON 0.895% 23/03/2027	EUR	98.833,90	0,54
100.000	ASB FINANCE LTD/LONDON 0.250% 21/05/2031 EMTN	EUR	90.483,71	0,50
200.000	BNZ INTERNATIONAL FUNDING LTD/LONDON 0.500% 03/07/2024	EUR	199.178,30	1,10
100.000	WESTPAC SECURITIES NZ LTD/LONDON 0.010% 08/06/2028 EMTN	EUR	92.828,31	0,51
			<b>574.603,53</b>	<b>3,16</b>
<b>Vereinigtes Königreich</b>				
200.000	NATWEST MARKETS PLC 0.125% 12/11/2025 EMTN	EUR	190.779,15	1,05
315.000	SANTANDER UK PLC 0.100% 12/05/2024 EMTN	EUR	311.558,78	1,71
			<b>502.337,93</b>	<b>2,76</b>
<b>Italien</b>				
100.000	BANCO BPM SPA 0.625% 08/06/2023 EMTN	EUR	100.526,97	0,55
200.000	CREDIT AGRICOLE ITALIA SPA 0.250% 30/09/2024 EMTN	EUR	197.516,32	1,09
100.000	MEDIOBANCA BANCA DI CREDITO FINANZIARIO SPA 1.125% 12/08/2024 EMTN	EUR	101.000,48	0,55
100.000	UNICREDIT SPA 0.325% 19/01/2026 EMTN	EUR	94.467,22	0,52
			<b>493.510,99</b>	<b>2,71</b>
<b>Japan</b>				
191.000	SUMITOMO MITSUI BANKING CORP 0.010% 10/09/2025 EMTN	EUR	184.334,31	1,01
200.000	SUMITOMO MITSUI TRUST BANK LTD 0.010% 15/10/2027 EMTN	EUR	186.387,09	1,03
100.000	SUMITOMO MITSUI TRUST BANK LTD 0.277% 25/10/2028 EMTN	EUR	93.278,39	0,51
			<b>463.999,79</b>	<b>2,55</b>
<b>Belgien</b>				
200.000	ARGENTA SPAARBANK NV 0.010% 11/02/2031 EMTN	EUR	179.301,42	0,98
100.000	BELFIUS BANK SA 0.010% 15/10/2025 EMTN	EUR	96.292,71	0,53
200.000	ING BELGIUM SA 0.010% 20/02/2030	EUR	182.513,79	1,01
			<b>458.107,92</b>	<b>2,52</b>
<b>Singapur</b>				
150.000	UNITED OVERSEAS BANK LTD 0.010% 01/12/2027	EUR	140.818,84	0,77
100.000	UNITED OVERSEAS BANK LTD 0.100% 25/05/2029 GMTN	EUR	92.513,17	0,51
200.000	UNITED OVERSEAS BANK LTD 0.387% 17/03/2025 EMTN	EUR	197.324,99	1,09
			<b>430.657,00</b>	<b>2,37</b>
<b>Schweden</b>				
100.000	STADSHYPOTEK AB 0.010% 30/09/2030 EMTN	EUR	90.277,96	0,50
135.000	STADSHYPOTEK AB 0.375% 06/12/2024	EUR	133.774,36	0,73
			<b>224.052,32</b>	<b>1,23</b>

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
<b>Vereinigte Staaten</b>				
200.000	GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE 30/04/2024 FRN EMTN	EUR	198.746,97	1,09
			<b>198.746,97</b>	<b>1,09</b>
<b>Schweiz</b>				
200.000	UBS AG/LONDON 0.500% 31/03/2031 EMTN	EUR	182.084,69	1,00
			<b>182.084,69</b>	<b>1,00</b>
<b>Dänemark</b>				
100.000	JYSKE REALKREDIT AS 0.010% 01/10/2027	EUR	94.364,54	0,52
			<b>94.364,54</b>	<b>0,52</b>
<b>Finnland</b>				
100.000	AKTIA BANK 0.125% 25/10/2028 EMTN	EUR	93.915,53	0,52
			<b>93.915,53</b>	<b>0,52</b>
			<b>17.905.435,95</b>	<b>98,35</b>
<b>Organismen für gemeinsame Anlagen</b>				
<b>Offene Fonds</b>				
<b>Luxemburg</b>				
15	NN (L) LIQUID EUR - Z CAP EUR	EUR	14.358,34	0,08
			<b>14.358,34</b>	<b>0,08</b>
			<b>14.358,34</b>	<b>0,08</b>
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>			<b>17.919.794,29</b>	<b>98,43</b>

### Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022

Stückzahl	Bezeichnung	Währung	Engagement in EUR	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR
<b>Zins-Futures</b>				
(9)	EURO-BOBL FUTURE 08/06/2022	EUR	1.159.740,00	34.420,00
(1)	EURO-BUND FUTURE 08/06/2022	EUR	158.660,00	9.118,24
1	EURO-BUXL 30Y BOND 08/06/2022	EUR	186.200,00	(16.400,00)
5	EURO-SCHATZ FUTURE 08/06/2022	EUR	553.675,00	(6.300,00)
			<b>2.058.275,00</b>	<b>20.838,24</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>				<b>20.838,24</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.



## NN (L) Euro Covered Bond

*(ausgedrückt in EUR)*

## Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick

		%
		NIW
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	17.919.794,29	98,43
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	20.838,24	0,11
<b>Bankguthaben</b>	105.784,40	0,58
<b>Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>	160.028,06	0,88
<b>Nettovermögen Gesamt</b>	18.206.444,99	100,00

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Euro Credit

(ausgedrückt in EUR)

### Statistische Angaben

<b>Nettovermögen</b>	31.03.2022	EUR	1.525.734.254,68	<b>Anzahl der Anteile</b>				
	30.09.2021	EUR	1.653.937.068,83					
	30.09.2020	EUR	1.409.318.660,36					
<b>Nettoinventarwert pro Anteil**</b>				Capitalisation Q (EUR)	31.03.2022		28.363	
					30.09.2021		28.922	
					30.09.2020		20.848	
Capitalisation I (EUR)	31.03.2022	EUR	2.112,58	Capitalisation R (EUR)	31.03.2022		4.100	
	30.09.2021	EUR	2.238,65		30.09.2021		4.369	
	30.09.2020	EUR	2.193,49		30.09.2020		5.434	
Capitalisation P (EUR)	31.03.2022	EUR	183,06	Capitalisation V (EUR)	31.03.2022		1.174	
	30.09.2021	EUR	194,42		30.09.2021		1.180	
	30.09.2020	EUR	191,37		30.09.2020		1.213	
Capitalisation Q (EUR)	31.03.2022	EUR	5.192,31	Capitalisation X (EUR)	31.03.2022		21.124	
	30.09.2021	EUR	5.499,14		30.09.2021		23.650	
	30.09.2020	EUR	5.382,31		30.09.2020		25.634	
Capitalisation R (EUR)	31.03.2022	EUR	186,15	Capitalisation Z (EUR)	31.03.2022		51.656	
	30.09.2021	EUR	197,32		30.09.2021		48.048	
	30.09.2020	EUR	193,47		30.09.2020		27.947	
Capitalisation V (EUR)	31.03.2022	EUR	150,59	Distribution I (EUR)	31.03.2022		61.651	
	30.09.2021	EUR	159,89		30.09.2021		63.132	
	30.09.2020	EUR	157,27		30.09.2020		74.239	
Capitalisation X (EUR)	31.03.2022	EUR	173,94	Distribution P (EUR)	31.03.2022		4.757	
	30.09.2021	EUR	184,97		30.09.2021		5.160	
	30.09.2020	EUR	182,53		30.09.2020		6.524	
Capitalisation Z (EUR)	31.03.2022	EUR	7.429,12	Distribution (HY) Z Hedged (i) (CZK)	31.03.2022		1.400	
	30.09.2021	EUR	7.858,32		30.09.2021		3.752	
	30.09.2020	EUR	7.672,16		30.09.2020		3.375	
Distribution I (EUR)	31.03.2022	EUR	5.171,51	<b>Dividende</b>				
	30.09.2021	EUR	5.480,32		Distribution I (EUR)	14.12.2021	EUR	0,20
	30.09.2020	EUR	5.380,56		Distribution (HY) Z Hedged (i) (CZK)	31.01.2022	CZK	246,53
Distribution P (EUR)	31.03.2022	EUR	1.584,01					
	30.09.2021	EUR	1.682,37					
	30.09.2020	EUR	1.656,00					
Distribution (HY) Z Hedged (i) (CZK)	31.03.2022	CZK	150.205,45					
	30.09.2021	CZK	156.623,13					
	30.09.2020	CZK	152.831,09					
<b>Anzahl der Anteile</b>								
Capitalisation I (EUR)	31.03.2022		304.026					
	30.09.2021		321.513					
	30.09.2020		285.815					
Capitalisation P (EUR)	31.03.2022		70.135					
	30.09.2021		73.441					
	30.09.2020		107.387					

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

## NN (L) Euro Credit

(ausgedrückt in EUR)

### Statistische Angaben (Fortsetzung)

**Laufende Kosten in %\***

Capitalisation I (EUR)	31.03.2022	0,49%
Capitalisation P (EUR)	31.03.2022	0,95%
Capitalisation Q (EUR)	31.03.2022	0,38%
Capitalisation R (EUR)	31.03.2022	0,56%
Capitalisation V (EUR)	31.03.2022	0,88%
Capitalisation X (EUR)	31.03.2022	1,20%
Capitalisation Z (EUR)	31.03.2022	0,13%
Distribution I (EUR)	31.03.2022	0,49%
Distribution P (EUR)	31.03.2022	0,95%
Distribution (HY) Z Hedged (i) (CZK)	31.03.2022	0,15%
<b>Portfolioumsatz in %*</b>	31.03.2022	92,07%

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

## NN (L) Euro Credit

(ausgedrückt in EUR)

### Finanzabschlüsse

#### Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022

	Erläuterungen	
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	2	<b>1.528.653.208,72</b>
Organismen für gemeinsame Anlagen		27.111.170,78
Anleihen und andere Schuldtitel		1.501.542.037,94
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	2	<b>671.907,18</b>
Credit Default Swaps		274.355,42
Devisentermingeschäfte		397.551,76
<b>Bankguthaben</b>		<b>571.137,03</b>
<b>Hinterlegte Sicherheiten</b>		<b>1.440.788,37</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte</b>	4, 12	<b>58.600.330,16</b>
<b>Vermögenswerte Gesamt</b>		<b>1.589.937.371,46</b>
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>	4, 12	<b>(59.952.341,49)</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	2	<b>(4.250.775,29)</b>
Zinsswaps		(4.089.883,57)
Futures		(160.891,72)
<b>Verbindlichkeiten Gesamt</b>		<b>(64.203.116,78)</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Berichtszeitraums</b>		<b>1.525.734.254,68</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Euro Credit

(ausgedrückt in EUR)

## Wertpapierbestand zum 31.03.2022

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW	Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
<b>Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>									
<b>Anleihen und andere Schuldtitel</b>									
<b>Niederlande</b>									
5.000.000	ABERTIS INFRASTRUCTURAS FINANCE BV FRN PERP	EUR	4.892.939,05	0,32	500.000	ING GROEP NV 09/06/2032 FRN EMTN	EUR	465.464,71	0,03
6.474.000	AGCO INTERNATIONAL HOLDINGS BV 0.800% 06/10/2028	EUR	5.834.593,84	0,38	1.300.000	ING GROEP NV 11/04/2028 FRN EMTN	EUR	1.329.229,90	0,09
1.146.000	AKELIUS RESIDENTIAL PROPERTY FINANCING BV 1.125% 11/01/2029 EMTN	EUR	1.036.047,16	0,07	1.500.000	ING GROEP NV 15/02/2029 FRN EMTN	EUR	1.528.445,48	0,10
9.600.000	ARGENTUM NETHERLANDS BV FOR GIVAUDAN SA 1.125% 17/09/2025	EUR	9.603.689,47	0,63	1.400.000	ING GROEP NV 16/02/2031 FRN	EUR	1.378.276,55	0,09
3.339.000	ASML HOLDING NV 0.250% 25/02/2030	EUR	3.064.767,73	0,20	3.700.000	ING GROEP NV 18/02/2029 FRN	EUR	3.378.433,00	0,22
3.738.000	ASML HOLDING NV 0.625% 07/05/2029	EUR	3.584.987,03	0,23	400.000	ING GROEP NV 22/03/2030 FRN	EUR	400.619,56	0,03
7.183.000	ATRADIUS FINANCE BV 23/09/2044 FRN	EUR	7.595.625,71	0,50	6.100.000	ING GROEP NV 26/05/2031 FRN EMTN	EUR	6.088.267,08	0,40
7.700.000	BRENNTAG FINANCE BV 0.500% 06/10/2029 EMTN	EUR	6.933.503,04	0,45	1.000.000	ING GROEP NV 29/11/2030 FRN EMTN	EUR	925.931,64	0,06
380.000	BRENNTAG FINANCE BV 1.125% 27/09/2025	EUR	377.831,25	0,02	2.120.000	KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV 1.750% 02/04/2027	EUR	2.154.567,81	0,14
200.000	CITYCON TREASURY BV 1.625% 12/03/2028 EMTN	EUR	170.152,78	0,01	2.000.000	KONINKLIJKE DSM NV 2.375% 03/04/2024 EMTN	EUR	2.066.141,04	0,14
2.000.000	COOPERATIEVE RABOBANK UA 10/04/2029 FRN EMTN	USD	1.804.469,17	0,12	8.100.000	KONINKLIJKE PHILIPS NV 0.500% 22/05/2026	EUR	7.880.125,58	0,52
372.000	CRH FUNDING BV 1.875% 09/01/2024 EMTN	EUR	378.983,75	0,02	2.800.000	KONINKLIJKE PHILIPS NV 0.750% 02/05/2024	EUR	2.806.416,31	0,18
1.364.000	CTP NV 0.500% 21/06/2025 EMTN	EUR	1.293.259,99	0,08	3.255.000	KONINKLIJKE PHILIPS NV 1.375% 02/05/2028	EUR	3.218.683,38	0,21
1.000.000	CTP NV 0.625% 27/11/2023 EMTN	EUR	988.682,80	0,06	1.200.000	LINDE FINANCE BV 0.550% 19/05/2032 EMTN	EUR	1.099.647,49	0,07
4.837.000	CTP NV 0.750% 18/02/2027 EMTN	EUR	4.354.812,63	0,29	1.000.000	NATURGY FINANCE BV 0.750% 28/11/2029 EMTN	EUR	944.450,53	0,06
2.586.000	CTP NV 0.875% 20/01/2026 EMTN	EUR	2.436.823,69	0,16	2.900.000	NATURGY FINANCE BV 0.875% 15/05/2025 EMTN	EUR	2.895.139,19	0,19
1.000.000	CTP NV 1.250% 21/06/2029 EMTN	EUR	876.419,11	0,06	4.400.000	NATURGY FINANCE BV 1.250% 15/01/2026 EMTN	EUR	4.403.265,50	0,29
2.767.000	CTP NV 1.500% 27/09/2031 EMTN	EUR	2.333.011,43	0,15	1.000.000	NATURGY FINANCE BV 1.250% 19/04/2026 EMTN	EUR	997.364,50	0,07
3.852.000	DANFOSS FINANCE I BV 0.375% 28/10/2028 EMTN	EUR	3.522.339,64	0,23	2.000.000	NATURGY FINANCE BV 1.375% 19/01/2027 EMTN	EUR	1.999.696,72	0,13
300.000	DE VOLKSBANK NV 0.010% 16/09/2024 EMTN	EUR	295.689,41	0,02	800.000	NIBC BANK NV 0.875% 08/07/2025 EMTN	EUR	785.690,84	0,05
2.100.000	DE VOLKSBANK NV 22/10/2030 FRN EMTN	EUR	2.069.460,96	0,14	1.200.000	NIBC BANK NV 0.875% 24/06/2027 EMTN	EUR	1.128.190,46	0,07
4.900.000	DEUTSCHE TELEKOM INTERNATIONAL FINANCE BV 0.875% 30/01/2024 EMTN	EUR	4.926.520,66	0,32	650.000	NIBC BANK NV 1.125% 19/04/2023 EMTN	EUR	653.394,73	0,04
4.800.000	DEUTSCHE TELEKOM INTERNATIONAL FINANCE BV 1.125% 22/05/2026 EMTN	EUR	4.819.497,12	0,32	3.500.000	PROSUS NV 2.085% 19/01/2030	EUR	3.009.832,11	0,20
923.000	DEUTSCHE TELEKOM INTERNATIONAL FINANCE BV 1.500% 03/04/2028 EMTN	EUR	935.368,88	0,06	8.946.000	REPSOL INTERNATIONAL FINANCE BV FRN PERP	EUR	8.485.875,64	0,56
1.255.000	DIGITAL DUTCH FINCO BV 1.500% 15/03/2030	EUR	1.154.894,27	0,08	2.000.000	REPSOL INTERNATIONAL FINANCE BV 0.250% 02/08/2027 EMTN	EUR	1.888.343,56	0,12
6.065.000	EDP FINANCE BV 1.125% 12/02/2024 EMTN	EUR	6.117.333,37	0,40	2.796.000	SAGAX EURO MTN NL BV 0.750% 26/01/2028 EMTN	EUR	2.455.595,81	0,16
4.428.000	EDP FINANCE BV 1.875% 13/10/2025 EMTN	EUR	4.541.839,89	0,30	3.271.000	SAGAX EURO MTN NL BV 1.625% 24/02/2026 EMTN	EUR	3.202.509,48	0,21
2.600.000	EDP FINANCE BV 1.875% 21/09/2029 EMTN	EUR	2.612.040,65	0,17	170.000	SIEMENS FINANCIERINGSMAATSCHAPPIJ NV 1.000% 06/09/2027 EMTN	EUR	169.733,26	0,01
5.018.000	ELM BV FOR FIRMENICH INTERNATIONAL SA FRN PERP	EUR	5.069.666,93	0,33	1.495.000	SIGNIFY NV 2.000% 11/05/2024	EUR	1.522.230,66	0,10
9.550.000	ELM BV FOR SWISS REINSURANCE CO LTD FRN PERP	EUR	9.555.282,77	0,63	2.170.000	SIGNIFY NV 2.375% 11/05/2027	EUR	2.217.149,02	0,15
3.500.000	ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV 0.500% 17/06/2030 EMTN	EUR	3.132.905,97	0,21	14.542.000	STELLANTIS NV 2.750% 01/04/2032 EMTN	EUR	14.643.151,68	0,97
3.849.000	ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV 0.875% 17/06/2036 EMTN	EUR	3.185.086,61	0,21	6.850.000	STELLANTIS NV 3.375% 07/07/2023	EUR	7.051.786,68	0,46
3.600.000	ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV 1.125% 16/09/2026 EMTN	EUR	3.577.246,42	0,23	3.200.000	TELEFONICA EUROPE BV FRN PERP	EUR	3.229.298,37	0,21
11.600.000	ENEXIS HOLDING NV 0.875% 28/04/2026 EMTN	EUR	11.513.672,68	0,76	7.700.000	TELEFONICA EUROPE BV FRN PERP	EUR	7.768.522,30	0,51
5.200.000	E.ON INTERNATIONAL FINANCE BV 5.750% 14/02/2033 EMTN	EUR	7.032.246,83	0,46	2.070.000	TENNET HOLDING BV FRN PERP	EUR	2.116.254,58	0,14
4.000.000	GLOBAL SWITCH FINANCE BV 1.375% 07/10/2030 EMTN	EUR	3.677.914,92	0,24	1.000.000	THERMO FISHER SCIENTIFIC FINANCE I BV 1.625% 18/10/2041	EUR	901.034,62	0,06
3.702.000	HEIMSTADEN BOSTAD TREASURY BV 0.625% 24/07/2025 EMTN	EUR	3.569.609,67	0,23	1.002.000	VESTEDA FINANCE BV 0.750% 18/10/2031 EMTN	EUR	893.007,25	0,06
1.776.000	HEIMSTADEN BOSTAD TREASURY BV 0.750% 06/09/2029 EMTN	EUR	1.515.308,28	0,10	4.857.000	VITERRA FINANCE BV 0.375% 24/09/2025 EMTN	EUR	4.565.642,02	0,30
861.000	HEIMSTADEN BOSTAD TREASURY BV 1.000% 13/04/2028 EMTN	EUR	777.118,57	0,05	2.137.000	VITERRA FINANCE BV 1.000% 24/09/2028 EMTN	EUR	1.898.851,97	0,12
554.000	HEIMSTADEN BOSTAD TREASURY BV 1.375% 24/07/2028 EMTN	EUR	508.802,63	0,03	3.700.000	VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV FRN PERP	EUR	3.862.677,38	0,25
3.911.000	HEIMSTADEN BOSTAD TREASURY BV 1.625% 13/10/2031 EMTN	EUR	3.440.635,68	0,23	7.500.000	VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV FRN PERP	EUR	7.557.553,28	0,50
3.400.000	HEINEKEN NV 1.000% 04/05/2026 EMTN	EUR	3.363.635,50	0,22	8.100.000	VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV FRN PERP	EUR	8.145.920,68	0,53
400.000	IBERDROLA INTERNATIONAL BV FRN PERP	EUR	378.122,05	0,02	8.400.000	VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV FRN PERP	EUR	8.525.371,09	0,56
					2.300.000	VONOVIA FINANCE BV 0.625% 07/10/2027 EMTN	EUR	2.146.939,49	0,14
					1.500.000	VONOVIA FINANCE BV 0.750% 15/01/2024	EUR	1.495.455,41	0,10
					3.800.000	VONOVIA FINANCE BV 1.000% 09/07/2030 EMTN	EUR	3.462.573,87	0,23
					700.000	VONOVIA FINANCE BV 2.250% 15/12/2023 EMTN	EUR	720.012,93	0,05
					600.000	WOLTERS KLUWER NV 2.500% 13/05/2024	EUR	618.801,40	0,04
					1.000.000	WOLTERS KLUWER NV 2.875% 21/03/2023	EUR	1.029.116,48	0,07
								<b>300.963.523,01</b>	<b>19,73</b>
					<b>Vereinigte Staaten</b>				
					2.649.000	AMERICAN TOWER CORP 0.400% 15/02/2027	EUR	2.472.023,81	0,16
					1.500.000	AMERICAN TOWER CORP 0.450% 15/01/2027	EUR	1.408.416,80	0,09
					3.000.000	AMERICAN TOWER CORP 0.875% 21/05/2029	EUR	2.742.294,72	0,18
					3.818.000	AMERICAN TOWER CORP 0.950% 05/10/2030	EUR	3.449.478,77	0,23

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

**NN (L) Euro Credit**

(ausgedrückt in EUR)

**Wertpapierbestand zum 31.03.2022 (Fortsetzung)**

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW	Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
						<b>Frankreich</b>			
2.515.000	APPLE INC ZCP 15/11/2025	EUR	2.452.312,37	0,16					
2.000.000	AT&T INC 1.050% 05/09/2023	EUR	2.022.851,50	0,13	1.600.000	ALSTOM SA ZCP 11/01/2029	EUR	1.401.382,46	0,09
9.795.000	AT&T INC 1.600% 19/05/2028	EUR	9.863.397,31	0,65	300.000	ARKEMA SA 3.125% 06/12/2023 EMTN	EUR	311.629,02	0,02
800.000	AT&T INC 1.950% 15/09/2023	EUR	816.770,50	0,05	7.600.000	BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL SA 0.010% 11/05/2026 EMTN	EUR	7.211.072,13	0,47
800.000	AT&T INC 2.050% 19/05/2032	EUR	814.282,81	0,05	1.600.000	BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL SA 0.100% 08/10/2027 EMTN	EUR	1.484.068,93	0,10
1.000.000	AT&T INC 2.350% 05/09/2029	EUR	1.045.378,25	0,07	2.200.000	BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL SA 0.250% 19/07/2028	EUR	2.008.880,61	0,13
1.200.000	AT&T INC 2.600% 17/12/2029	EUR	1.274.828,77	0,08	2.400.000	BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL SA 0.250% 29/06/2028 EMTN	EUR	2.219.145,43	0,15
2.500.000	AT&T INC 3.150% 04/09/2036	EUR	2.749.219,35	0,18	4.500.000	BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL SA 0.750% 08/06/2026 EMTN	EUR	4.408.521,66	0,29
1.000.000	AUTOLIV INC 0.750% 26/06/2023	EUR	1.002.495,33	0,07	5.300.000	BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL SA 0.750% 17/07/2025 EMTN	EUR	5.240.208,63	0,34
3.645.000	BANK OF AMERICA CORP 07/02/2025 FRN EMTN	EUR	3.676.661,27	0,24	2.600.000	BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL SA 1.125% 19/11/2031 EMTN	EUR	2.320.740,40	0,15
1.306.000	BANK OF AMERICA CORP 22/03/2031 FRN EMTN	EUR	1.190.190,75	0,08	300.000	BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL SA 2.375% 24/03/2026 EMTN	EUR	307.206,34	0,02
1.200.000	BANK OF AMERICA CORP 24/08/2028 FRN EMTN	EUR	1.129.239,06	0,07	2.100.000	BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL SA 2.500% 25/05/2028 EMTN	EUR	2.142.678,55	0,14
4.785.000	CELANESE US HOLDINGS LLC 1.250% 11/02/2025	EUR	4.687.510,51	0,31	500.000	BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL SA 3.000% 28/11/2023 EMTN	EUR	522.047,59	0,03
350.000	CHUBB INA HOLDINGS INC 0.300% 15/12/2024	EUR	344.345,86	0,02	2.100.000	BNP PARIBAS SA 04/06/2026 FRN	EUR	2.042.122,11	0,13
2.000.000	CITIGROUP INC 06/07/2026 FRN EMTN	EUR	1.992.790,40	0,13	818.000	BNP PARIBAS SA 1.000% 17/04/2024 EMTN	EUR	822.367,96	0,05
1.800.000	CITIGROUP INC 24/07/2026 FRN EMTN	EUR	1.806.757,54	0,12	2.000.000	BNP PARIBAS SA 11/07/2030 FRN EMTN	EUR	1.851.888,14	0,12
2.900.000	DIGITAL EURO FINCO LLC 1.125% 09/04/2028	EUR	2.710.052,49	0,18	6.100.000	BNP PARIBAS SA 13/04/2027 FRN EMTN	EUR	5.768.196,78	0,38
6.067.000	ELI LILLY & CO 1.125% 14/09/2051	EUR	4.938.319,41	0,32	1.000.000	BNP PARIBAS SA 14/10/2027 FRN EMTN	EUR	1.010.408,03	0,07
1.800.000	FORD MOTOR CREDIT CO LLC 1.514% 17/02/2023	EUR	1.802.520,97	0,12	8.100.000	BNP PARIBAS SA 15/01/2032 FRN EMTN	EUR	7.662.810,44	0,50
2.950.000	GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE 1.000% 18/03/2033 EMTN	EUR	2.615.099,89	0,17	600.000	BNP PARIBAS SA 19/01/2030 FRN EMTN	EUR	544.519,96	0,04
10.400.000	GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE 1.375% 15/05/2024 EMTN	EUR	10.506.747,58	0,69	4.200.000	BNP PARIBAS SA 19/02/2028 FRN EMTN	EUR	3.945.170,63	0,26
8.000.000	GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE 30/04/2024 FRN EMTN	EUR	7.949.878,96	0,52	1.200.000	BNP PARIBAS SA 20/11/2030 FRN EMTN	EUR	1.219.157,14	0,08
3.335.000	INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP 0.300% 11/02/2028	EUR	3.153.181,00	0,21	4.900.000	BNP PARIBAS SA 23/01/2027 FRN EMTN	EUR	5.001.354,15	0,33
2.000.000	INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP 1.250% 29/01/2027	EUR	2.010.471,92	0,13	1.600.000	BNP PARIBAS SA 31/03/2032 FRN EMTN	EUR	1.605.489,28	0,11
810.000	INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCES INC 1.800% 25/09/2026	EUR	811.646,88	0,05	1.400.000	BPCE SA 0.250% 14/01/2031	EUR	1.235.303,10	0,08
10.850.000	JPMORGAN CHASE & CO 11/03/2027 FRN EMTN	EUR	10.692.126,10	0,70	3.600.000	BPCE SA 0.625% 15/01/2030	EUR	3.329.539,56	0,22
3.500.000	JPMORGAN CHASE & CO 18/05/2028 FRN EMTN	EUR	3.497.772,85	0,23	1.900.000	BPCE SA 0.625% 28/04/2025	EUR	1.884.571,49	0,12
2.695.000	JPMORGAN CHASE & CO 24/02/2028 FRN EMTN	EUR	2.538.207,68	0,17	1.700.000	BPCE SA 30/11/2027 FRN EMTN	EUR	1.724.821,58	0,11
7.000.000	MCDONALD'S CORP 0.250% 04/10/2028 GMTN	EUR	6.414.934,96	0,42	800.000	CAPGEMINI SE 2.500% 01/07/2023	EUR	819.010,86	0,05
2.500.000	MMS USA HOLDINGS INC 0.625% 13/06/2025	EUR	2.456.605,55	0,16	3.000.000	CARREFOUR SA 1.875% 30/10/2026 EMTN	EUR	3.013.705,14	0,20
2.000.000	MORGAN STANLEY 1.750% 11/03/2024 GMTN	EUR	2.040.192,56	0,13	2.400.000	CREDIT AGRICOLE SA 05/06/2030 FRN EMTN	EUR	2.379.947,04	0,16
4.000.000	MORGAN STANLEY 1.750% 30/01/2025 GMTN	EUR	4.091.435,28	0,27	3.200.000	CREDIT AGRICOLE SA 2.000% 25/03/2029 EMTN	EUR	3.155.647,84	0,21
1.322.000	MORGAN STANLEY 23/10/2026 FRN EMTN	EUR	1.319.066,92	0,09	6.000.000	CREDIT AGRICOLE SA 22/04/2026 FRN EMTN	EUR	5.940.133,80	0,39
1.258.000	MORGAN STANLEY 29/04/2033 FRN	EUR	1.155.707,38	0,08	1.300.000	CREDIT AGRICOLE SA/LONDON 0.500% 24/06/2024 EMTN	EUR	1.293.230,46	0,08
7.900.000	MORGAN STANLEY 29/10/2027 FRN	EUR	7.486.523,24	0,49	1.400.000	CREDIT AGRICOLE SA/LONDON 1.000% 03/07/2029 EMTN	EUR	1.348.707,82	0,09
555.000	NASDAQ INC 0.875% 13/02/2030	EUR	508.924,87	0,03	1.000.000	CREDIT AGRICOLE SA/LONDON 1.250% 14/04/2026 EMTN	EUR	1.002.391,12	0,07
2.500.000	NETFLIX INC 3.625% 15/05/2027	EUR	2.667.231,25	0,17	1.900.000	CREDIT AGRICOLE SA/LONDON 1.375% 03/05/2027 EMTN	EUR	1.902.306,81	0,12
2.500.000	NETFLIX INC 3.625% 15/06/2030	EUR	2.644.107,48	0,17	2.000.000	CREDIT MUTUEL ARKEA SA 0.010% 28/01/2026 EMTN	EUR	1.913.946,22	0,13
6.000.000	NETFLIX INC 3.875% 15/11/2029	EUR	6.509.661,66	0,43	1.900.000	CREDIT MUTUEL ARKEA SA 0.875% 07/05/2027 EMTN	EUR	1.843.919,39	0,12
7.028.000	NEW YORK LIFE GLOBAL FUNDING 0.250% 23/01/2027 GMTN	EUR	6.657.588,49	0,44	600.000	CREDIT MUTUEL ARKEA SA 25/10/2029 FRN EMTN	EUR	598.066,06	0,04
11.745.000	PARKER-HANNIFIN CORP 1.125% 01/03/2025	EUR	11.699.777,76	0,77	4.100.000	ELO SACA 2.875% 29/01/2026 EMTN	EUR	4.114.349,30	0,27
12.860.000	PEPSICO INC 0.500% 06/05/2028 EMTN	EUR	12.330.780,91	0,81	5.300.000	ESSILORLUXOTTICA SA 0.125% 27/05/2025 EMTN	EUR	5.174.755,49	0,34
900.000	PROLOGIS EURO FINANCE LLC 0.250% 10/09/2027	EUR	838.631,67	0,05	900.000	EUTELSAT SA 1.500% 13/10/2028	EUR	866.411,01	0,06
472.000	PROLOGIS EURO FINANCE LLC 0.625% 10/09/2031	EUR	418.069,76	0,03	2.105.000	FIRMENICH PRODUCTIONS PARTICIPATIONS SAS 1.375% 30/10/2026	EUR	2.092.182,61	0,14
4.900.000	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC 1.500% 01/10/2039 EMTN	EUR	4.398.834,52	0,29	2.000.000	HOLDING D'INFRASTRUCTURES DE TRANSPORT SASU 0.625% 27/03/2023 EMTN	EUR	2.007.350,90	0,13
1.500.000	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC 1.950% 24/07/2029	EUR	1.537.462,31	0,10	2.900.000	HSBC CONTINENTAL EUROPE SA 0.100% 03/09/2027 EMTN	EUR	2.694.640,36	0,18
2.338.000	VERIZON COMMUNICATIONS INC 0.875% 08/04/2027	EUR	2.294.771,88	0,15	500.000	HSBC CONTINENTAL EUROPE SA 0.250% 17/05/2024 EMTN	EUR	495.173,84	0,03
3.887.000	VERIZON COMMUNICATIONS INC 1.125% 19/09/2035	EUR	3.511.204,33	0,23	1.600.000	ICADE SANTE SACA 1.375% 17/09/2030	EUR	1.512.151,81	0,10
2.500.000	VERIZON COMMUNICATIONS INC 1.250% 08/04/2030	EUR	2.440.909,33	0,16	5.000.000	IMERYS SA 1.500% 15/01/2027 EMTN	EUR	4.915.898,55	0,32
2.566.000	WELLS FARGO & CO 0.500% 26/04/2024 EMTN	EUR	2.548.876,70	0,17	4.500.000	JCDECAUX SA 1.625% 07/02/2030	EUR	4.265.641,44	0,28
1.200.000	ZF NORTH AMERICA CAPITAL INC 2.750% 27/04/2023	EUR	1.220.598,11	0,08	2.000.000	ORANGE SA ZCP 04/09/2026 EMTN	EUR	1.905.137,44	0,12
			<b>187.359.168,33</b>	<b>12,28</b>					

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Euro Credit

(ausgedrückt in EUR)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW	Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
2.700.000	ORANGE SA 0.625% 16/12/2033 EMTN	EUR	2.408.985,20	0,16	3.000.000	VOLKSWAGEN BANK GMBH 1.250% 15/12/2025 EMTN	EUR	2.952.514,23	0,19
5.200.000	ORANGE SA 1.625% 07/04/2032 EMTN	EUR	5.229.643,59	0,34	5.100.000	VOLKSWAGEN BANK GMBH 1.875% 31/01/2024 EMTN	EUR	5.192.282,72	0,34
2.000.000	PSA BANQUE FRANCE SA 0.625% 21/06/2024	EUR	1.984.785,06	0,13	7.700.000	VOLKSWAGEN BANK GMBH 2.500% 31/07/2026 EMTN	EUR	7.885.622,36	0,52
800.000	PSA BANQUE FRANCE SA 0.750% 19/04/2023 EMTN	EUR	803.643,38	0,05	11.230.000	VOLKSWAGEN FINANCIAL SERVICES AG 3.375% 06/04/2028 EMTN	EUR	12.009.520,68	0,79
2.470.000	RCI BANQUE SA 0.750% 10/04/2023 EMTN	EUR	2.471.149,37	0,16	2.800.000	VOLKSWAGEN LEASING GMBH 0.375% 20/07/2026 EMTN	EUR	2.633.834,90	0,17
2.319.000	RCI BANQUE SA 1.375% 08/03/2024 EMTN	EUR	2.316.865,69	0,15	15.000	VOLKSWAGEN LEASING GMBH 1.125% 04/04/2024 EMTN	EUR	15.035,15	0,00
5.730.000	RCI BANQUE SA 2.000% 11/07/2024 EMTN	EUR	5.760.559,81	0,38	4.396.000	VOLKSWAGEN LEASING GMBH 1.500% 19/06/2026 EMTN	EUR	4.347.892,11	0,28
2.300.000	SOCIETE GENERALE SA 02/12/2027 FRN	EUR	2.180.831,00	0,14	2.650.000	VOLKSWAGEN LEASING GMBH 1.625% 15/08/2025 EMTN	EUR	2.646.709,26	0,17
5.400.000	SOCIETE GENERALE SA 21/04/2026 FRN EMTN	EUR	5.350.591,08	0,35	200.000	VOLKSWAGEN LEASING GMBH 2.375% 06/09/2022 EMTN	EUR	202.042,83	0,01
2.500.000	TDF INFRASTRUCTURE SASU 1.750% 01/12/2029	EUR	2.283.673,18	0,15	3.200.000	VONOVIA SE 0.250% 01/09/2028 EMTN	EUR	2.867.682,66	0,19
1.600.000	TEREGA SASU 0.625% 27/02/2028	EUR	1.454.428,69	0,10	5.400.000	VONOVIA SE 0.625% 14/12/2029 EMTN	EUR	4.827.970,28	0,32
450.000	TOTALENERGIES SE FRN PERP EMTN	EUR	457.933,39	0,03	2.500.000	VONOVIA SE 0.750% 01/09/2032 EMTN	EUR	2.150.045,78	0,14
2.500.000	TOTALENERGIES SE FRN PERP EMTN	EUR	2.531.073,85	0,17	700.000	VONOVIA SE 1.000% 16/06/2033	EUR	605.222,49	0,04
3.000.000	TOTALENERGIES SE FRN PERP EMTN	EUR	3.010.330,62	0,20	500.000	VONOVIA SE 1.625% 01/09/2051 EMTN	EUR	390.120,14	0,03
4.400.000	TOTALENERGIES SE FRN PERP EMTN	EUR	4.416.500,00	0,29				<b>145.246.038,58</b>	<b>9,52</b>
6.910.000	TOTALENERGIES SE FRN PERP EMTN	EUR	6.879.449,23	0,45					
100.000	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD SE 2.250% 14/05/2038 EMTN	EUR	91.717,76	0,01					
4.600.000	VEOLIA ENVIRONNEMENT SA FRN PERP	EUR	4.474.216,08	0,29					
2.000.000	VEOLIA ENVIRONNEMENT SA 0.800% 15/01/2032 EMTN	EUR	1.805.722,50	0,12					
1.000.000	VEOLIA ENVIRONNEMENT SA 1.250% 15/04/2028 EMTN	EUR	987.512,62	0,06					
			<b>181.379.619,51</b>	<b>11,89</b>					
	<b>Deutschland</b>					<b>Luxemburg</b>			
1.065.000	ALBEMARLE NEW HOLDING GMBH 1.625% 25/11/2028	EUR	1.015.422,83	0,07	5.500.000	ARCELORMITTAL SA 1.750% 19/11/2025 EMTN	EUR	5.507.554,91	0,36
1.700.000	ALLIANZ SE FRN PERP EMTN	EUR	1.785.134,96	0,12	400.000	AROUNDTOWN SA 1.450% 09/07/2028 EMTN	EUR	373.021,90	0,02
866.000	COMMERZBANK AG 0.500% 04/12/2026 EMTN	EUR	833.592,91	0,05	500.000	AROUNDTOWN SA 1.625% 31/01/2028 EMTN	EUR	478.238,78	0,03
1.800.000	COMMERZBANK AG 1.000% 04/03/2026 EMTN	EUR	1.779.509,41	0,12	300.000	CBRE GLOBAL INVESTORS OPEN-ENDED FUND SCA SICAV-SIF PAN EUROPEAN CORE FUND 0.500% 27/01/2028	EUR	270.345,60	0,02
2.199.000	COVESTRO AG 0.875% 03/02/2026 EMTN	EUR	2.169.997,61	0,14	1.000.000	CBRE GLOBAL INVESTORS OPEN-ENDED FUND SCA SICAV-SIF PAN EUROPEAN CORE FUND 0.900% 12/10/2029	EUR	902.600,52	0,06
988.000	DEUTSCHE BANK AG 10/06/2026 FRN EMTN	EUR	994.374,70	0,07	2.000.000	CNH INDUSTRIAL FINANCE EUROPE SA 1.625% 03/07/2029 EMTN	EUR	1.953.806,72	0,13
2.700.000	DEUTSCHE BANK AG 1.625% 20/01/2027 EMTN	EUR	2.627.826,87	0,17	1.410.000	CNH INDUSTRIAL FINANCE EUROPE SA 1.750% 25/03/2027 EMTN	EUR	1.409.340,47	0,09
1.400.000	DEUTSCHE BANK AG 17/02/2032 FRN	EUR	1.253.875,85	0,08	2.800.000	CNH INDUSTRIAL FINANCE EUROPE SA 1.875% 19/01/2026 EMTN	EUR	2.840.010,96	0,19
600.000	DEUTSCHE BANK AG 19/11/2030 FRN EMTN	EUR	561.726,18	0,04	6.495.000	DH EUROPE FINANCE II SARL 0.750% 18/09/2031	EUR	5.953.882,84	0,39
1.415.000	E.ON SE 1.000% 07/10/2025 EMTN	EUR	1.409.496,88	0,09	1.700.000	GRAND CITY PROPERTIES SA FRN PERP EMTN	EUR	1.507.916,80	0,10
3.052.000	E.ON SE 1.625% 29/03/2031 EMTN	EUR	3.058.305,28	0,20	600.000	GRAND CITY PROPERTIES SA 0.125% 11/01/2028 EMTN	EUR	525.192,31	0,03
3.400.000	EUROGRID GMBH 1.500% 18/04/2028 EMTN	EUR	3.393.298,57	0,22	2.400.000	HANNOVER FINANCE LUXEMBOURG SA 30/06/2043 FRN	EUR	2.523.928,78	0,17
2.400.000	EUROGRID GMBH 1.875% 10/06/2025 EMTN	EUR	2.451.878,26	0,16	1.250.000	HEIDELBERGCEMENT FINANCE LUXEMBOURG SA 1.750% 24/04/2028 EMTN	EUR	1.242.431,48	0,08
1.000.000	EVONIK INDUSTRIES AG 02/09/2081 FRN	EUR	917.052,00	0,06	7.175.000	HIGHLAND HOLDINGS SARL 0.318% 15/12/2026	EUR	6.762.579,78	0,44
3.300.000	HANNOVER RUECK SE 08/10/2040 FRN	EUR	3.056.986,15	0,20	5.540.000	HOLCIM FINANCE LUXEMBOURG SA FRN PERP	EUR	5.554.907,53	0,36
1.200.000	HANNOVER RUECK SE 09/10/2039 FRN	EUR	1.077.429,36	0,07	1.976.000	HOLCIM FINANCE LUXEMBOURG SA 0.500% 23/04/2031	EUR	1.708.924,41	0,11
3.260.000	HEIDELBERGCEMENT AG 1.500% 07/02/2025 EMTN	EUR	3.286.599,48	0,22	2.660.000	HOLCIM FINANCE LUXEMBOURG SA 0.500% 29/11/2026 EMTN	EUR	2.534.045,04	0,17
1.200.000	INFINEON TECHNOLOGIES AG 0.625% 17/02/2025	EUR	1.188.855,52	0,08	927.000	HOLCIM FINANCE LUXEMBOURG SA 0.625% 19/01/2033 EMTN	EUR	767.455,19	0,05
5.800.000	LANXESS AG 1.750% 22/03/2028 EMTN	EUR	5.736.472,02	0,38	500.000	HOLCIM FINANCE LUXEMBOURG SA 1.750% 29/08/2029 EMTN	EUR	492.728,50	0,03
2.800.000	LEG IMMOBILIEN SE 1.000% 19/11/2032	EUR	2.430.588,44	0,16	1.456.000	JOHN DEERE CASH MANAGEMENT SARL 2.200% 02/04/2032 EMTN	EUR	1.544.494,56	0,10
21.414.000	MAHLE GMBH 2.375% 20/05/2022 EMTN	EUR	21.431.486,89	1,39	2.334.000	LOGICOR FINANCING SARL 0.875% 14/01/2031 EMTN	EUR	1.971.753,72	0,13
300.000	MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS-GESELLSCHAFT AG IN MUENCHEN 26/05/2041 FRN	EUR	267.940,81	0,02	7.302.000	LOGICOR FINANCING SARL 1.625% 15/07/2027 EMTN	EUR	7.022.037,16	0,46
2.700.000	MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS-GESELLSCHAFT AG IN MUENCHEN 26/05/2042 FRN EMTN	EUR	2.723.680,27	0,18	2.265.000	LOGICOR FINANCING SARL 1.625% 17/01/2030 EMTN	EUR	2.090.993,14	0,14
5.500.000	MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS-GESELLSCHAFT AG IN MUENCHEN 26/05/2042 FRN EMTN	GBP	6.552.482,23	0,43	200.000	LOGICOR FINANCING SARL 2.250% 13/05/2025 EMTN	EUR	202.448,29	0,01
9.300.000	MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS-GESELLSCHAFT AG IN MUENCHEN 26/05/2049 FRN	EUR	9.625.107,91	0,63	800.000	LOGICOR FINANCING SARL 3.250% 13/11/2028 EMTN	EUR	825.281,01	0,05
3.800.000	O2 TELEFONICA DEUTSCHLAND FINANZIERUNGS GMBH 1.750% 05/07/2025	EUR	3.861.937,04	0,25	7.630.000	MEDTRONIC GLOBAL HOLDINGS SCA 0.375% 15/10/2028	EUR	7.168.988,69	0,48
4.100.000	SCHAEFFLER AG 2.750% 12/10/2025 EMTN	EUR	4.115.836,95	0,27	1.875.000	MEDTRONIC GLOBAL HOLDINGS SCA 0.750% 15/10/2032	EUR	1.717.528,48	0,11
2.565.000	SYMRISE AG 1.250% 29/11/2025	EUR	2.534.650,95	0,17	3.974.000	MEDTRONIC GLOBAL HOLDINGS SCA 2.250% 07/03/2039	EUR	4.061.898,00	0,27
1.533.000	SYMRISE AG 1.375% 01/07/2027	EUR	1.493.365,56	0,10	5.625.000	NESTLE FINANCE INTERNATIONAL LTD 1.500% 29/03/2035 EMTN	EUR	5.662.129,11	0,37
3.000.000	VANTAGE TOWERS AG ZCP 31/03/2025 EMTN	EUR	2.884.631,10	0,19					

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Euro Credit

(ausgedrückt in EUR)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW	Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
200.000	PROLOGIS INTERNATIONAL FUNDING II SA 0.875% 09/07/2029 EMTN	EUR	185.970,28	0,01					
268.000	PROLOGIS INTERNATIONAL FUNDING II SA 1.625% 17/06/2032 EMTN	EUR	252.735,42	0,02					
3.438.000	P3 GROUP SARL 1.625% 26/01/2029 EMTN	EUR	3.147.007,10	0,21					
5.600.000	REPSOL EUROPE FINANCE SARL 0.875% 06/07/2033 EMTN	EUR	4.938.539,82	0,32					
400.000	SEGRE CAPITAL SARL 0.500% 22/09/2031	EUR	350.673,13	0,02					
945.000	SELP FINANCE SARL 1.500% 20/12/2026	EUR	925.651,10	0,06					
3.200.000	SES SA FRN PERP	EUR	3.317.364,38	0,22					
5.067.000	SES SA 1.625% 22/03/2026 EMTN	EUR	5.019.005,83	0,33					
2.000.000	TRATON FINANCE LUXEMBOURG SA 0.125% 24/03/2025 EMTN	EUR	1.929.719,24	0,13					
			<b>95.643.130,98</b>	<b>6,27</b>					
	<b>Vereinigtes Königreich</b>								
820.000	ANGLO AMERICAN CAPITAL PLC 1.625% 11/03/2026 EMTN	EUR	810.708,62	0,05					
1.430.000	AVIVA PLC 03/07/2044 FRN EMTN	EUR	1.495.926,59	0,10					
2.870.000	AVIVA PLC 04/12/2045 FRN EMTN	EUR	2.988.600,40	0,20					
1.200.000	BARCLAYS PLC 07/02/2028 FRN EMTN	EUR	1.206.860,35	0,08					
2.450.000	BARCLAYS PLC 09/06/2025 FRN EMTN	EUR	2.424.461,86	0,16					
1.200.000	BARCLAYS PLC 09/08/2029 FRN	EUR	1.091.734,04	0,07					
3.000.000	BP CAPITAL MARKETS PLC 1.104% 15/11/2034	EUR	2.658.218,58	0,17					
2.195.000	BP CAPITAL MARKETS PLC 1.231% 08/05/2031 EMTN	EUR	2.073.827,04	0,14					
1.000.000	BP CAPITAL MARKETS PLC 1.953% 03/03/2025 EMTN	EUR	1.026.216,53	0,07					
1.700.000	BP CAPITAL MARKETS PLC 2.822% 07/04/2032	EUR	1.835.455,20	0,12					
594.000	BRITISH TELECOMMUNICATIONS PLC 1.125% 12/09/2029 EMTN	EUR	567.448,97	0,04					
1.344.000	BRITISH TELECOMMUNICATIONS PLC 1.500% 23/06/2027 EMTN	EUR	1.339.341,76	0,09					
4.600.000	COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC 1.500% 08/11/2027	EUR	4.607.896,08	0,30					
1.600.000	COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC 1.750% 27/03/2026	EUR	1.631.433,78	0,11					
1.003.000	DIAGEO FINANCE PLC 1.000% 22/04/2025 EMTN	EUR	1.007.012,92	0,07					
7.450.000	FCE BANK PLC 1.615% 11/05/2023 EMTN	EUR	7.487.409,13	0,48					
2.150.000	FCE BANK PLC 2.727% 03/06/2022 EMTN	GBP	2.547.622,42	0,17					
3.263.000	HSBC HOLDINGS PLC 24/09/2029 FRN	EUR	3.008.597,99	0,20					
616.000	LLOYDS BANK CORPORATE MARKETS PLC 0.375% 28/01/2025 EMTN	EUR	605.376,96	0,04					
2.200.000	LLOYDS BANK CORPORATE MARKETS PLC 2.375% 09/04/2026 EMTN	EUR	2.287.627,19	0,15					
600.000	LLOYDS BANKING GROUP PLC 01/04/2026 FRN EMTN	EUR	635.095,81	0,04					
500.000	LLOYDS BANKING GROUP PLC 15/01/2024 FRN EMTN	EUR	502.446,22	0,03					
1.900.000	NATIONWIDE BUILDING SOCIETY 25/07/2029 FRN EMTN	EUR	1.912.821,49	0,13					
400.000	NATWEST GROUP PLC 02/03/2026 FRN EMTN	EUR	402.418,04	0,03					
1.757.000	NATWEST GROUP PLC 04/03/2025 FRN EMTN	EUR	1.785.775,92	0,12					
1.500.000	NATWEST GROUP PLC 14/09/2029 FRN	EUR	1.374.232,17	0,09					
1.745.000	NATWEST GROUP PLC 14/09/2032 FRN EMTN	EUR	1.601.126,84	0,10					
2.019.000	NATWEST GROUP PLC 26/02/2030 FRN EMTN	EUR	1.861.520,04	0,12					
1.700.000	NATWEST MARKETS PLC 0.125% 12/11/2025 EMTN	EUR	1.621.622,81	0,11					
3.110.000	NATWEST MARKETS PLC 0.125% 18/06/2026 EMTN	EUR	2.924.696,12	0,19					
1.900.000	NATWEST MARKETS PLC 2.750% 02/04/2025 EMTN	EUR	1.985.838,28	0,13					
4.000.000	RENTOKIL INITIAL PLC 0.500% 14/10/2028 EMTN	EUR	3.617.699,52	0,24					
900.000	SANTANDER UK GROUP HOLDINGS PLC 1.125% 08/09/2023	EUR	908.870,70	0,06					
5.663.000	SANTANDER UK GROUP HOLDINGS PLC 13/09/2029 FRN EMTN	EUR	5.150.618,44	0,33					
800.000	STANDARD CHARTERED PLC 09/09/2030 FRN	EUR	798.606,55	0,05					
7.695.000	TESCO CORPORATE TREASURY SERVICES PLC 0.875% 29/05/2026 EMTN	EUR	7.458.834,37	0,48					
			<b>77.243.999,73</b>	<b>5,06</b>					
						<b>Japan</b>			
5.600.000	ASAHİ GROUP HOLDINGS LTD 0.155% 23/10/2024	EUR	5.491.736,99	0,36					
9.103.000	ASAHİ GROUP HOLDINGS LTD 0.336% 19/04/2027	EUR	8.555.762,87	0,56					
4.000.000	ASAHİ GROUP HOLDINGS LTD 0.541% 23/10/2028	EUR	3.699.770,04	0,24					
2.800.000	MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP INC 0.339% 19/07/2024	EUR	2.766.567,66	0,18					
512.000	NTT FINANCE CORP 0.399% 13/12/2028 EMTN	EUR	479.039,28	0,03					
5.000.000	SOFTBANK GROUP CORP 3.375% 06/07/2029	EUR	4.224.543,00	0,28					
1.000.000	SUMITOMO MITSUI FINANCIAL GROUP INC 0.632% 23/10/2029 EMTN	EUR	914.768,56	0,06					
6.922.000	TAKEDA PHARMACEUTICAL CO LTD 0.750% 09/07/2027	EUR	6.676.397,13	0,44					
3.000.000	TAKEDA PHARMACEUTICAL CO LTD 1.000% 09/07/2029	EUR	2.851.807,35	0,19					
1.243.000	TAKEDA PHARMACEUTICAL CO LTD 1.375% 09/07/2032	EUR	1.180.782,93	0,08					
1.700.000	TAKEDA PHARMACEUTICAL CO LTD 2.000% 09/07/2040	EUR	1.616.319,15	0,11					
13.075.000	TAKEDA PHARMACEUTICAL CO LTD 2.250% 21/11/2026	EUR	13.572.171,25	0,88					
3.200.000	TAKEDA PHARMACEUTICAL CO LTD 3.000% 21/11/2030	EUR	3.482.124,80	0,23					
			<b>55.511.791,01</b>	<b>3,64</b>					
						<b>Italien</b>			
11.535.000	AUTOSTRADE PER L'ITALIA SPA 1.625% 25/01/2028 EMTN	EUR	11.077.846,03	0,72					
3.538.000	A2A SPA 1.500% 16/03/2028 EMTN	EUR	3.476.260,56	0,23					
4.000.000	ENEL SPA FRN PERP	EUR	4.060.676,48	0,27					
1.300.000	ENEL SPA 24/05/2080 FRN	EUR	1.331.309,95	0,09					
3.000.000	ENEL SPA 24/11/2078 FRN PERP	EUR	3.044.989,23	0,20					
844.000	FCA BANK SPA/IRELAND 0.250% 28/02/2023 EMTN	EUR	845.584,21	0,06					
2.130.000	FCA BANK SPA/IRELAND 0.500% 18/09/2023 EMTN	EUR	2.130.571,78	0,14					
4.700.000	INTESA SANPAOLO SPA 04/03/2029 FRN EMTN	EUR	5.010.055,71	0,32					
1.197.000	INTESA SANPAOLO SPA 0.750% 04/12/2024 EMTN	EUR	1.190.231,62	0,08					
1.100.000	INTESA SANPAOLO SPA 0.750% 16/03/2028 EMTN	EUR	1.027.002,02	0,07					
1.000.000	INTESA SANPAOLO SPA 1.000% 04/07/2024 EMTN	EUR	1.001.784,50	0,07					
3.600.000	INTESA SANPAOLO SPA 1.000% 19/11/2026 EMTN	EUR	3.484.680,26	0,23					
2.870.000	INTESA SANPAOLO SPA 1.750% 04/07/2029 EMTN	EUR	2.812.801,45	0,18					
750.000	INTESA SANPAOLO SPA 4.000% 23/09/2029	USD	653.600,37	0,04					
350.000	MEDIOBANCA BANCA DI CREDITO FINANZIARIO SPA 1.000% 08/09/2027 EMTN	EUR	333.628,87	0,02					
2.717.000	UNICREDIT SPA 05/07/2029 FRN EMTN	EUR	2.473.448,50	0,16					
2.500.000	UNICREDIT SPA 0.850% 19/01/2031 EMTN	EUR	2.168.094,85	0,14					
1.813.000	UNICREDIT SPA 16/06/2026 FRN EMTN	EUR	1.780.487,13	0,12					
650.000	UNICREDIT SPA 22/07/2027 FRN EMTN	EUR	645.056,95	0,04					
3.045.000	UNICREDIT SPA 25/06/2025 FRN EMTN	EUR	3.041.461,04	0,20					
			<b>51.589.571,51</b>	<b>3,38</b>					
						<b>Spanien</b>			
1.300.000	ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA 0.625% 15/07/2025 EMTN	EUR	1.283.949,12	0,08					
4.400.000	ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA 1.000% 27/02/2027	EUR	4.318.308,50	0,28					
600.000	ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA 2.375% 27/09/2027 EMTN	EUR	626.216,43	0,04					
800.000	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA 16/01/2030 FRN GMTN	EUR	776.854,69	0,05					
1.200.000	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA 24/03/2027 FRN GMTN	EUR	1.139.947,06	0,07					
200.000	BANCO DE SABADELL SA 0.875% 22/07/2025 EMTN	EUR	194.916,03	0,01					
2.300.000	BANCO DE SABADELL SA 1.625% 07/03/2024 EMTN	EUR	2.321.930,87	0,15					
1.900.000	BANCO SANTANDER SA 0.200% 11/02/2028 EMTN	EUR	1.752.943,34	0,11					
1.600.000	BANCO SANTANDER SA 0.250% 19/06/2024 EMTN	EUR	1.584.263,09	0,10					

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.



## NN (L) Euro Credit

(ausgedrückt in EUR)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW	Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
1.700.000	CAIXABANK SA 0.750% 09/07/2026	EUR	1.643.664,91	0,11	1.533.000	BALDER FINLAND OYJ 2.000% 18/01/2031	EUR	1.392.681,21	0,09
300.000	CAIXABANK SA 09/02/2029 FRN EMTN	EUR	274.051,84	0,02	2.880.000	ELENIA VERKKO OYJ 0.375% 06/02/2027 EMTN	EUR	2.687.072,43	0,18
3.900.000	CAIXABANK SA 10/07/2026 FRN EMTN	EUR	3.805.311,00	0,25	6.500.000	FINGRID OYJ 3.500% 03/04/2024 EMTN	EUR	6.876.391,80	0,44
5.100.000	CAIXABANK SA 1.125% 17/05/2024 EMTN	EUR	5.122.164,35	0,35	1.500.000	KOJAMO OYJ 1.625% 07/03/2025	EUR	1.497.675,24	0,10
4.500.000	CAIXABANK SA 1.125% 27/03/2026 EMTN	EUR	4.443.454,89	0,29	1.630.000	METSO OUTOTEC OYJ 0.875% 26/05/2028 EMTN	EUR	1.508.377,01	0,10
2.200.000	CAIXABANK SA 14/07/2028 FRN EMTN	EUR	2.235.046,92	0,15	1.300.000	OP CORPORATE BANK PLC 0.100% 16/11/2027 EMTN	EUR	1.204.643,00	0,08
700.000	CAIXABANK SA 1.750% 24/10/2023 EMTN	EUR	713.963,07	0,05	4.000.000	OP CORPORATE BANK PLC 0.125% 01/07/2024 EMTN	EUR	3.956.477,52	0,26
2.000.000	CAIXABANK SA 18/06/2031 FRN EMTN	EUR	1.887.280,16	0,12	5.318.000	OP CORPORATE BANK PLC 09/06/2030 FRN	EUR	5.222.399,01	0,34
7.300.000	CELLNEX FINANCE CO SA 2.250% 12/04/2026	EUR	7.246.134,76	0,48	450.000	SAMPO OYJ 03/09/2052 FRN EMTN	EUR	421.995,29	0,03
2.100.000	IBERDROLA FINANZAS SA FRN PERP	EUR	1.938.142,23	0,13	1.150.000	SAMPO OYJ 23/05/2049 FRN	EUR	1.183.143,13	0,08
500.000	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA 1.875% 04/12/2034	EUR	424.989,87	0,03	1.200.000	SATO OYJ 1.375% 24/02/2028	EUR	1.114.773,01	0,07
100.000	RED ELECTRICA FINANCIACIONES SAU 0.375% 24/07/2028 EMTN	EUR	95.642,47	0,01	639.000	STORA ENSO OYJ 0.625% 02/12/2030 EMTN	EUR	563.541,28	0,04
500.000	RED ELECTRICA FINANCIACIONES SAU 1.250% 13/03/2027 EMTN	EUR	504.788,07	0,03	6.500.000	TEOLLISUUDEEN VOIMA OYJ 2.625% 31/03/2027 EMTN	EUR	6.488.494,48	0,42
600.000	SANTANDER CONSUMER FINANCE SA 0.375% 27/06/2024 EMTN	EUR	594.091,79	0,04	4.555.000	UPM-KYMMENE OYJ 0.125% 19/11/2028 EMTN	EUR	4.095.150,34	0,27
1.600.000	SANTANDER CONSUMER FINANCE SA 0.500% 14/11/2026 EMTN	EUR	1.536.640,88	0,10				<b>40.590.000,67</b>	<b>2,66</b>
			<b>46.464.696,34</b>	<b>3,05</b>					
	<b>Irland</b>					<b>Schweden</b>			
1.380.000	AIB GROUP PLC 04/04/2028 FRN EMTN	EUR	1.385.821,25	0,09	5.886.000	ALFA LAVAL TREASURY INTERNATIONAL AB 0.875% 18/02/2026	EUR	5.779.096,53	0,37
1.200.000	AIB GROUP PLC 1.250% 28/05/2024 EMTN	EUR	1.203.755,75	0,08	5.839.000	ALFA LAVAL TREASURY INTERNATIONAL AB 1.375% 18/02/2029	EUR	5.722.869,06	0,38
1.076.000	AIB GROUP PLC 17/11/2027 FRN EMTN	EUR	1.004.915,78	0,07	1.000.000	FASTIGHETS AB BALDER 1.125% 29/01/2027 EMTN	EUR	945.483,10	0,06
750.000	ATLAS COPCO FINANCE DAC 0.750% 08/02/2032 EMTN	EUR	694.324,43	0,05	300.000	FASTIGHETS AB BALDER 1.250% 28/01/2028 EMTN	EUR	274.931,18	0,02
447.000	BANK OF IRELAND GROUP PLC 08/07/2024 FRN EMTN	EUR	447.095,28	0,03	1.100.000	HEIMSTADEN BOSTAD AB FRN PERP	EUR	928.872,73	0,06
1.634.000	BANK OF IRELAND GROUP PLC 10/05/2027 FRN EMTN	EUR	1.520.491,62	0,10	3.850.000	SCANIA CV AB 2.250% 03/06/2025 EMTN	EUR	3.951.342,66	0,26
1.362.000	BANK OF IRELAND GROUP PLC 1.375% 29/08/2023 EMTN	EUR	1.377.787,11	0,09	1.500.000	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB 0.050% 01/07/2024 EMTN	EUR	1.479.455,55	0,10
400.000	CRH FINANCE DAC 3.125% 03/04/2023	EUR	411.894,12	0,03	1.412.000	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB 03/11/2031 FRN GMTN	EUR	1.323.323,52	0,09
2.800.000	CRH SMW FINANCE DAC 1.250% 05/11/2026 EMTN	EUR	2.770.913,29	0,18	500.000	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB 31/10/2028 FRN GMTN	EUR	502.094,66	0,03
728.000	HAMMERSON IRELAND FINANCE DAC 1.750% 03/06/2027	EUR	673.295,92	0,04	819.000	SVENSKA HANDELSBANKEN AB 0.125% 03/11/2026 EMTN	EUR	779.640,74	0,05
2.255.000	KERRY GROUP FINANCIAL SERVICES UNLTD CO 0.625% 20/09/2029	EUR	2.063.843,56	0,14	1.700.000	SVENSKA HANDELSBANKEN AB 0.125% 18/06/2024 EMTN	EUR	1.680.870,07	0,11
7.000.000	KERRY GROUP FINANCIAL SERVICES UNLTD CO 2.375% 10/09/2025	EUR	7.271.337,78	0,47	5.300.000	SVENSKA HANDELSBANKEN AB 02/03/2028 FRN EMTN	EUR	5.321.333,72	0,35
14.727.000	PARTNERRE IRELAND FINANCE DAC 1.250% 15/09/2026	EUR	14.520.022,77	0,94	600.000	SVENSKA HANDELSBANKEN AB 05/03/2029 FRN EMTN	EUR	601.306,18	0,04
5.795.000	SMURFIT KAPPA ACQUISITIONS ULC 2.875% 15/01/2026	EUR	6.054.512,79	0,40	1.958.000	SVENSKA HANDELSBANKEN AB 1.000% 15/04/2025 EMTN	EUR	1.962.359,68	0,13
1.700.000	SMURFIT KAPPA TREASURY ULC 1.500% 15/09/2027	EUR	1.673.037,66	0,11	2.373.000	TELEFONAKTIEBOLAGET LM ERICSSON 1.000% 26/05/2029 EMTN	EUR	2.057.953,35	0,13
			<b>43.073.049,11</b>	<b>2,82</b>				<b>33.310.932,73</b>	<b>2,18</b>
	<b>Schweiz</b>					<b>Belgien</b>			
1.400.000	CREDIT SUISSE AG/LONDON 0.250% 01/09/2028 EMTN	EUR	1.259.597,53	0,08	3.200.000	ALIXIS FINANCE SA 0.875% 08/11/2028	EUR	2.878.982,05	0,19
2.900.000	CREDIT SUISSE AG/LONDON 1.500% 10/04/2026 EMTN	EUR	2.898.008,48	0,19	1.405.000	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV 1.150% 22/01/2027 EMTN	EUR	1.405.311,80	0,09
5.713.000	CREDIT SUISSE GROUP AG 02/04/2026 FRN EMTN	EUR	5.889.917,84	0,39	500.000	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV 2.750% 17/03/2036 EMTN	EUR	538.521,35	0,04
300.000	CREDIT SUISSE GROUP AG 0.650% 10/09/2029 EMTN	EUR	264.476,13	0,02	7.070.000	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV 2.875% 02/04/2032 EMTN	EUR	7.815.284,90	0,52
4.150.000	CREDIT SUISSE GROUP AG 13/10/2026 FRN	EUR	4.120.629,54	0,27	2.500.000	BELFIUS BANK SA 0.010% 15/10/2025 EMTN	EUR	2.407.317,78	0,16
1.500.000	CREDIT SUISSE GROUP AG 17/07/2025 FRN EMTN	EUR	1.478.357,21	0,10	2.200.000	KBC GROUP NV 01/03/2027 FRN EMTN	EUR	2.098.487,27	0,14
2.000.000	CREDIT SUISSE GROUP AG 24/06/2027 FRN EMTN	EUR	1.890.663,86	0,12	1.000.000	KBC GROUP NV 03/12/2029 FRN EMTN	EUR	960.336,83	0,06
5.000.000	UBS AG/LONDON 0.010% 29/06/2026 EMTN	EUR	4.751.465,15	0,31	5.000.000	KBC GROUP NV 07/12/2031 FRN EMTN	EUR	4.615.754,95	0,30
6.941.000	UBS AG/LONDON 0.010% 31/03/2026 EMTN	EUR	6.621.989,21	0,43	3.600.000	KBC GROUP NV 18/09/2029 FRN EMTN	EUR	3.579.007,18	0,23
6.500.000	UBS AG/LONDON 0.500% 31/03/2031 EMTN	EUR	5.917.752,36	0,39	2.000.000	KBC GROUP NV 29/03/2026 FRN EMTN	EUR	2.008.625,76	0,13
1.000.000	UBS GROUP AG 03/11/2026 FRN	EUR	955.756,11	0,06	1.700.000	SOLVAY SA FRN PERP	EUR	1.727.341,73	0,11
600.000	UBS GROUP AG 0.875% 03/11/2031	EUR	551.943,42	0,04	1.700.000	VGP NV 2.250% 17/01/2030	EUR	1.526.856,73	0,10
4.304.000	UBS GROUP AG 21/03/2025 FRN EMTN	EUR	4.302.945,13	0,28				<b>31.561.828,33</b>	<b>2,07</b>
			<b>40.903.501,97</b>	<b>2,68</b>		<b>Neuseeland</b>			
	<b>Finnland</b>				1.341.000	ANZ NEW ZEALAND INT'L LTD/LONDON 0.200% 23/09/2027 EMTN	EUR	1.250.875,53	0,08
2.700.000	BALDER FINLAND OYJ 1.000% 20/01/2029 EMTN	EUR	2.377.185,92	0,16	1.900.000	ANZ NEW ZEALAND INT'L LTD/LONDON 1.125% 20/03/2025 EMTN	EUR	1.902.203,68	0,12

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Euro Credit

(ausgedrückt in EUR)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW	Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
10.000.000	ASB FINANCE LTD 0.250% 08/09/2028 EMTN	EUR	9.008.730,00	0,60					
2.805.000	BNZ INTERNATIONAL FUNDING LTD/LONDON 0.375% 14/09/2024 GMTN	EUR	2.774.356,33	0,18					
1.405.000	BNZ INTERNATIONAL FUNDING LTD/LONDON 0.500% 13/05/2023 GMTN	EUR	1.410.294,03	0,09					
2.791.000	WESTPAC SECURITIES NZ LTD/LONDON 0.100% 13/07/2027	EUR	2.587.296,21	0,17					
5.654.000	WESTPAC SECURITIES NZ LTD/LONDON 0.427% 14/12/2026 EMTN	EUR	5.394.758,90	0,35					
700.000	WESTPAC SECURITIES NZ LTD/LONDON 1.099% 24/03/2026 EMTN	EUR	694.349,45	0,05					
			<b>25.022.864,13</b>	<b>1,64</b>					
<b>Österreich</b>									
3.500.000	ERSTE GROUP BANK AG 0.375% 16/04/2024 EMTN	EUR	3.460.561,37	0,24					
1.000.000	ERSTE GROUP BANK AG 08/09/2031 FRN EMTN	EUR	958.023,25	0,06					
1.000.000	ERSTE GROUP BANK AG 0.875% 13/05/2027 EMTN	EUR	969.392,12	0,06					
4.400.000	ERSTE GROUP BANK AG 10/06/2030 FRN EMTN	EUR	4.190.795,00	0,28					
1.000.000	ERSTE GROUP BANK AG 1.500% 07/04/2026 EMTN	EUR	1.005.048,78	0,07					
2.200.000	ERSTE GROUP BANK AG 15/11/2032 FRN EMTN	EUR	1.986.064,28	0,13					
2.900.000	ERSTE GROUP BANK AG 16/11/2028 FRN EMTN	EUR	2.649.114,04	0,17					
2.100.000	RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG 0.250% 22/01/2025 EMTN	EUR	2.044.195,25	0,13					
1.300.000	RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG 0.375% 25/09/2026 EMTN	EUR	1.234.840,82	0,08					
400.000	RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG 18/06/2032 FRN	EUR	373.175,26	0,02					
			<b>18.871.210,17</b>	<b>1,24</b>					
<b>Bermuda</b>									
17.947.000	BACARDI LTD 2.750% 03/07/2023	EUR	18.382.712,06	1,20					
			<b>18.382.712,06</b>	<b>1,20</b>					
<b>Norwegen</b>									
2.320.000	DNB BANK ASA 0.250% 09/04/2024	EUR	2.305.317,79	0,15					
5.000.000	DNB BANK ASA 20/03/2028 FRN	EUR	5.004.440,90	0,33					
6.060.000	SPAREBANK 1 SR-BANK ASA 0.250% 09/11/2026 EMTN	EUR	5.757.849,37	0,38					
4.021.000	SPAREBANK 1 SR-BANK ASA 15/07/2027 FRN EMTN	EUR	3.829.707,80	0,25					
			<b>16.897.315,86</b>	<b>1,11</b>					
<b>Jersey</b>									
8.600.000	HASTINGS GROUP FINANCE PLC 3.000% 24/05/2025	GBP	10.352.957,30	0,68					
552.000	HEATHROW FUNDING LTD 1.875% 12/07/2032 EMTN	EUR	520.677,81	0,03					
3.100.000	HEATHROW FUNDING LTD 1.875% 14/03/2034 EMTN	EUR	2.855.883,96	0,19					
			<b>13.729.519,07</b>	<b>0,90</b>					
<b>Portugal</b>									
1.500.000	BRISA CONCESSAO RODOVIARIA SA 1.875% 30/04/2025 EMTN	EUR	1.520.177,24	0,10					
500.000	BRISA-CONCESSAO RODOVIARIA SA 2.000% 22/03/2023 EMTN	EUR	508.707,68	0,03					
4.900.000	BRISA-CONCESSAO RODOVIARIA SA 2.375% 10/05/2027 EMTN	EUR	5.095.986,92	0,33					
1.000.000	EDP - ENERGIAS DE PORTUGAL SA 1.625% 15/04/2027 EMTN	EUR	1.006.320,11	0,07					
5.300.000	GALP ENERGIA SGPS SA 2.000% 15/01/2026 EMTN	EUR	5.350.387,26	0,35					
			<b>13.481.579,21</b>	<b>0,88</b>					
<b>Singapur</b>									
1.000.000	DBS BANK LTD 0.375% 23/01/2024	EUR	998.085,72	0,07					
10.240.000	DBS GROUP HOLDINGS LTD 11/04/2028 FRN GMTN	EUR	10.309.715,46	0,67					
			<b>11.307.801,18</b>	<b>0,74</b>					
						<b>Island</b>			
					700.000	ARION BANKI HF 0.625% 27/05/2024 EMTN	EUR	685.796,11	0,04
					3.400.000	ISLANDSBANKI HF 19/01/2024 FRN GMTN	EUR	3.409.959,96	0,22
					5.200.000	LANDSBANKINN HF 0.500% 20/05/2024 EMTN	EUR	5.086.576,25	0,34
					2.000.000	LANDSBANKINN HF 1.000% 30/05/2023 EMTN	EUR	2.002.017,50	0,13
								<b>11.184.349,82</b>	<b>0,73</b>
						<b>Kaimaninseln</b>			
					9.404.000	XLIT LTD 29/06/2047 FRN	EUR	9.662.447,59	0,63
								<b>9.662.447,59</b>	<b>0,63</b>
						<b>Tschechische Republik</b>			
					5.094.000	CEZ AS 2.375% 06/04/2027 EMTN	EUR	5.130.195,11	0,33
					1.500.000	EP INFRASTRUCTURE AS 1.659% 26/04/2024	EUR	1.323.280,26	0,09
								<b>6.453.475,37</b>	<b>0,42</b>
						<b>Australien</b>			
					1.000.000	AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP LTD 0.625% 21/02/2023 EMTN	EUR	1.006.208,62	0,07
					1.981.000	TELSTRA CORP LTD 1.000% 23/04/2030	EUR	1.915.905,59	0,13
					196.000	WESTPAC BANKING CORP 0.875% 17/04/2027 EMTN	EUR	191.204,17	0,01
					3.153.000	WESTPAC BANKING CORP 13/05/2031 FRN	EUR	2.964.819,75	0,19
								<b>6.078.138,13</b>	<b>0,40</b>
						<b>Kanada</b>			
					3.889.000	FAIRFAX FINANCIAL HOLDINGS LTD 2.750% 29/03/2028	EUR	3.911.219,41	0,25
					1.750.000	GREAT-WEST LIFECO INC 1.750% 07/12/2026	EUR	1.765.547,61	0,12
								<b>5.676.767,02</b>	<b>0,37</b>
						<b>Dänemark</b>			
					1.742.000	CARLSBERG BREWERIES AS 0.375% 30/06/2027	EUR	1.630.024,90	0,11
					3.000.000	CARLSBERG BREWERIES AS 0.875% 01/07/2029 EMTN	EUR	2.793.097,41	0,18
					1.000.000	JYSKE REALKREDIT A/S 0.375% 01/07/2024 EMTN	EUR	994.512,96	0,07
								<b>5.417.635,27</b>	<b>0,36</b>
						<b>Ungarn</b>			
					3.624.000	MOL HUNGARIAN OIL & GAS PLC 2.625% 28/04/2023	EUR	3.660.501,94	0,24
								<b>3.660.501,94</b>	<b>0,24</b>
						<b>Mexiko</b>			
					3.000.000	AMERICA MOVIL SAB DE CV 06/09/2073 FRN	EUR	3.187.119,93	0,21
								<b>3.187.119,93</b>	<b>0,21</b>
						<b>Südkorea</b>			
					1.700.000	KOREA HOUSING FINANCE CORP 0.723% 22/03/2025	EUR	1.687.749,38	0,11
								<b>1.687.749,38</b>	<b>0,11</b>
								<b>1.501.542.037,94</b>	<b>98,41</b>
						<b>Organismen für gemeinsame Anlagen</b>			
						<b>Offene Fonds</b>			
						<b>Luxemburg</b>			
					27.449	NN (L) LIQUID EUR - Z CAP EUR	EUR	27.111.170,78	1,78
								<b>27.111.170,78</b>	<b>1,78</b>
								<b>27.111.170,78</b>	<b>1,78</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Euro Credit

(ausgedrückt in EUR)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>			<b>1.528.653.208,72</b>	<b>100,19</b>

### Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022

Bezeichnung	Verkauf / Kauf	Zinssatz (%)	Fälligkeits- datum	Währung	Nennwert	Swap-Wert in EUR
<b>Credit Default Swaps</b>						
CDS RENAULT SA 1.000% 20/12/2025	Kauf	1,000	20/12/2025	EUR	4.200.000,00	204.877,60
CDS GLENCORE INTERNATIONAL AG 5.000% 20/06/2022	Verkauf	5,000	20/06/2022	EUR	5.000.000,00	50.520,65
CDS HANNOVER RUECK SE 1.000% 20/06/2026	Verkauf	1,000	20/06/2026	EUR	4.800.000,00	26.288,93
CDS HANNOVER RUECK SE 1.000% 20/06/2026	Verkauf	1,000	20/06/2026	EUR	4.200.000,00	23.002,81
CDS MICHELIN LUXEMBOURG SCS 2.7500% 20/06/2019	Verkauf	1,000	20/12/2023	EUR	870.000,00	11.909,12
CDS HANNOVER RUECK SE 1.000% 20/06/2026	Verkauf	1,000	20/06/2026	EUR	2.100.000,00	11.501,41
CDS ANGLO AMERICAN PLC 5.000% 20/06/2022	Kauf	5,000	20/06/2022	EUR	5.000.000,00	(53.745,10)
						<b>274.355,42</b>

Zu erhalten (%)	Zu zahlen (%)	Fälligkeits- datum	Währung	Nennwert	Swap-Wert in EUR
<b>Zinsswaps</b>					
0,897	Floating	13/10/2027	EUR	5.500.000,00	(32.854,74)
Floating	4,190	19/06/2026	EUR	3.000.000,00	(406.378,35)
-0,215	Floating	17/11/2024	EUR	25.000.000,00	(612.869,75)
-0,148	Floating	16/11/2024	EUR	33.000.000,00	(751.313,64)
0,852	Floating	25/02/2032	EUR	33.500.000,00	(1.033.379,19)
0,837	Floating	16/02/2032	EUR	38.800.000,00	(1.253.087,90)
					<b>(4.089.883,57)</b>

Zu erhalten	Zu zahlen	Fälligkeits- datum	Engagement in EUR	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR		
<b>Devisentermingeschäfte</b>						
220.739.414,31	CZK	8.687.791,81	EUR	19/04/2022	8.687.791,81	329.708,38
20.520.725,89	EUR	17.370.022,89	GBP	30/06/2022	20.520.725,89	44.355,74
5.819.969,15	EUR	6.457.745,81	USD	30/06/2022	5.819.969,15	36.614,54
3.668.675,96	USD	3.286.909,12	EUR	30/06/2022	3.286.909,12	(1.357,99)

Zu erhalten	Zu zahlen	Fälligkeits- datum	Engagement in EUR	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR		
400.167,74	EUR	10.083.798,56	CZK	19/04/2022	400.167,74	(11.768,91)
			<b>38.715.563,71</b>	<b>397.551,76</b>		

Stückzahl	Bezeichnung	Währung	Engagement in EUR	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR
<b>Zins-Futures</b>				
(498)	EURO-BOBL FUTURE 08/06/2022	EUR	64.172.280,00	1.496.436,44
111	EURO-BUXL 30Y BOND 08/06/2022	EUR	20.668.200,00	(1.773.320,00)
(21)	EURO-SCHATZ FUTURE 08/06/2022	EUR	2.325.435,00	25.287,44
(23)	LONG GILT FUTURE 28/06/2022	GBP	3.299.511,80	49.534,86
(3)	US LONG BOND (CBT) 21/06/2022	USD	404.608,37	11.679,14
(12)	US 2YR NOTE (CBT) 30/06/2022	USD	2.285.590,72	29.490,40
			<b>93.155.625,89</b>	<b>(160.891,72)</b>

**Derivative Finanzinstrumente Gesamt** **(3.578.868,11)**

### Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick

		% NIW
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	<b>1.528.653.208,72</b>	<b>100,19</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	<b>(3.578.868,11)</b>	<b>(0,23)</b>
<b>Bankguthaben</b>	<b>571.137,03</b>	<b>0,04</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>	<b>88.777,04</b>	<b>0,00</b>
<b>Nettovermögen Gesamt</b>	<b>1.525.734.254,68</b>	<b>100,00</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) EURO Equity

(ausgedrückt in EUR)

### Statistische Angaben

<b>Nettovermögen</b>	31.03.2022	EUR	245.924.464,35	<b>Anzahl der Anteile</b>				
	30.09.2021	EUR	355.011.920,22					
	30.09.2020	EUR	288.818.746,58					
<b>Nettoinventarwert pro Anteil**</b>				Capitalisation V (EUR)	31.03.2022		268.225	
					30.09.2021		520.117	
					30.09.2020		447.118	
Capitalisation I (EUR)	31.03.2022	EUR	218,37	Capitalisation X (EUR)	31.03.2022		6.287	
	30.09.2021	EUR	227,82		30.09.2021		6.542	
	30.09.2020	EUR	173,93		30.09.2020		6.626	
Capitalisation I Hedged (i) (CZK)	31.03.2022	CZK	177.151,44	Distribution P (EUR)	31.03.2022		28.797	
	30.09.2021	CZK	182.668,93		30.09.2021		30.633	
	30.09.2020	CZK	139.186,97		30.09.2020		37.285	
Capitalisation P (EUR)	31.03.2022	EUR	184,55	Distribution R (EUR)	31.03.2022		1.250	
	30.09.2021	EUR	193,41		30.09.2021		1.250	
	30.09.2020	EUR	149,01		30.09.2020		1.293	
Capitalisation R (EUR)	31.03.2022	EUR	280,95	<b>Dividende</b>				
	30.09.2021	EUR	293,49		Distribution P (EUR)	14.12.2021	EUR	1,45
	30.09.2020	EUR	224,65		Distribution R (EUR)	14.12.2021	EUR	4,85
Capitalisation V (EUR)	31.03.2022	EUR	299,08	<b>Laufende Kosten in %*</b>				
	30.09.2021	EUR	313,30		Capitalisation I (EUR)	31.03.2022		0,69%
	30.09.2020	EUR	241,16		Capitalisation I Hedged (i) (CZK)	31.03.2022		0,71%
Capitalisation X (EUR)	31.03.2022	EUR	165,71	Capitalisation P (EUR)	31.03.2022		1,60%	
	30.09.2021	EUR	174,11	Capitalisation R (EUR)	31.03.2022		0,95%	
	30.09.2020	EUR	134,81	Capitalisation V (EUR)	31.03.2022		1,51%	
Distribution P (EUR)	31.03.2022	EUR	119,25	Capitalisation X (EUR)	31.03.2022		2,10%	
	30.09.2021	EUR	126,39	Distribution P (EUR)	31.03.2022		1,60%	
	30.09.2020	EUR	98,17	Distribution R (EUR)	31.03.2022		0,95%	
Distribution R (EUR)	31.03.2022	EUR	259,00	<b>Portfolioumsatz in %*</b>				
	30.09.2021	EUR	275,29		31.03.2022		128,88%	
	30.09.2020	EUR	213,76					
<b>Anzahl der Anteile</b>								
Capitalisation I (EUR)	31.03.2022		445.145					
	30.09.2021		524.229					
	30.09.2020		692.162					
Capitalisation I Hedged (i) (CZK)	31.03.2022		4.722					
	30.09.2021		4.808					
	30.09.2020		4.895					
Capitalisation P (EUR)	31.03.2022		158.605					
	30.09.2021		167.478					
	30.09.2020		203.356					
Capitalisation R (EUR)	31.03.2022		643					
	30.09.2021		778					
	30.09.2020		1.402					

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

## NN (L) EURO Equity

(ausgedrückt in EUR)

### Finanzabschlüsse

#### Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022

	Erläuterungen	
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	2	<b>242.578.611,03</b>
Aktien		242.578.611,03
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	2	<b>1.153.141,63</b>
Devisentermingeschäfte		1.153.141,63
<b>Bankguthaben</b>		<b>2.648.740,35</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte</b>	4	<b>1.118.284,41</b>
<b>Vermögenswerte Gesamt</b>		<b>247.498.777,42</b>
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>	4, 12	<b>(1.574.313,07)</b>
<b>Verbindlichkeiten Gesamt</b>		<b>(1.574.313,07)</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Berichtszeitraums</b>		<b>245.924.464,35</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) EURO Equity

(ausgedrückt in EUR)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
<b>Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>				
<b>Aktien</b>				
<b>Frankreich</b>				
43.066	AIR LIQUIDE SA	EUR	6.844.048,72	2,78
77.934	AMUNDI SA	EUR	4.847.494,80	1,97
86.867	BNP PARIBAS SA	EUR	4.511.003,31	1,83
32.842	CAPGEMINI SE	EUR	6.650.505,00	2,70
16.031	CIE GENERALE DES ETABLISSEMENTS MICHELIN SCA	EUR	1.971.011,45	0,80
128.386	COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	EUR	6.967.508,22	2,83
62.425	EIFFAGE SA	EUR	5.820.507,00	2,37
215.826	ENGIE SA	EUR	2.575.667,48	1,06
12.590	KERING SA	EUR	7.248.063,00	2,95
18.599	L'OREAL SA	EUR	6.767.246,15	2,75
26.185	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	EUR	17.004.539,00	6,91
84.881	PUBLICIS GROUPE SA	EUR	4.690.524,06	1,91
164.928	REXEL SA	EUR	3.204.551,04	1,30
123.500	SANOFI	EUR	11.424.985,00	4,65
141.779	TOTALENERGIES SE	EUR	6.526.087,37	2,65
96.923	VEOLIA ENVIRONNEMENT SA	EUR	2.819.490,07	1,15
			<b>99.873.231,67</b>	<b>40,61</b>
<b>Deutschland</b>				
43.841	ALLIANZ SE - REG	EUR	9.493.768,55	3,86
89.001	COVESTRO AG	EUR	4.079.805,84	1,66
65.612	DAIMLER TRUCK HOLDING AG	EUR	1.655.390,76	0,67
162.139	DEUTSCHE POST AG - REG	EUR	7.061.153,45	2,87
212.272	DEUTSCHE TELEKOM AG - REG	EUR	3.594.189,50	1,46
62.454	INFINEON TECHNOLOGIES AG	EUR	1.935.137,19	0,79
15.216	LEG IMMOBILIEN SE	EUR	1.571.052,00	0,64
61.998	MERCEDES-BENZ GROUP AG	EUR	3.956.092,38	1,61
110.991	SAP SE	EUR	11.223.409,92	4,56
74.017	SIEMENS AG - REG	EUR	9.300.976,22	3,78
66.441	SIEMENS HEALTHINEERS AG	EUR	3.736.641,84	1,52
			<b>57.607.617,65</b>	<b>23,42</b>
<b>Niederlande</b>				
1.170.278	AEGON NV	EUR	5.619.674,96	2,29
38.479	AIRBUS SE	EUR	4.246.542,44	1,73
35.433	ASML HOLDING NV	EUR	21.614.130,00	8,79
29.372	ASR NEDERLAND NV	EUR	1.240.379,56	0,50
281.494	ING GROEP NV	EUR	2.677.289,43	1,09
268.990	KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	EUR	7.831.643,85	3,18
247.378	STELLANTIS NV	EUR	3.660.699,64	1,49
			<b>46.890.359,88</b>	<b>19,07</b>
<b>Italien</b>				
589.778	ENI SPA	EUR	7.840.508,73	3,19
1.915.394	INTESA SANPAOLO SPA	EUR	3.990.723,40	1,62
			<b>11.831.232,13</b>	<b>4,81</b>
<b>Spanien</b>				
1.889.327	BANCO SANTANDER SA	EUR	5.856.913,70	2,38
145.888	IBERDROLA SA	EUR	1.447.208,96	0,59
59.963	INDUSTRIA DE DISEÑO TEXTIL SA	EUR	1.186.068,14	0,48
			<b>8.490.190,80</b>	<b>3,45</b>

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
<b>Irland</b>				
124.552	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	EUR	5.038.128,40	2,05
			<b>5.038.128,40</b>	<b>2,05</b>
<b>Luxemburg</b>				
55.884	APERAM SA	EUR	2.247.095,64	0,91
202.648	TENARIS SA	EUR	2.787.423,24	1,14
			<b>5.034.518,88</b>	<b>2,05</b>
<b>Österreich</b>				
51.518	ERSTE GROUP BANK AG	EUR	1.704.730,62	0,70
26.641	OMV AG	EUR	1.155.952,99	0,47
34.318	WIENERBERGER AG	EUR	940.313,20	0,38
			<b>3.800.996,81</b>	<b>1,55</b>
<b>Finnland</b>				
53.144	KESKO OYJ - B	EUR	1.329.131,44	0,54
76.438	STORA ENSO OYJ - R	EUR	1.361.742,97	0,55
			<b>2.690.874,41</b>	<b>1,09</b>
<b>Belgien</b>				
4.002	SOFINA SA	EUR	1.321.460,40	0,54
			<b>1.321.460,40</b>	<b>0,54</b>
			<b>242.578.611,03</b>	<b>98,64</b>

### Wertpapierbestand Gesamt

**242.578.611,03 98,64**

### Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022

Zu erhalten	Zu zahlen	Fälligkeits- datum	Engagement in EUR	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR	
<b>Devisentermingeschäfte</b>					
951.312.743,37	CZK	37.524.224,78	EUR 19/04/2022	37.524.224,78	1.338.172,66
3.523.409,65	EUR	90.778.930,41	CZK 19/04/2022	3.523.409,65	(185.031,03)
				<b>41.047.634,43</b>	<b>1.153.141,63</b>

### Derivative Finanzinstrumente Gesamt

**1.153.141,63**

### Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick

		% NIW
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	<b>242.578.611,03</b>	<b>98,64</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	<b>1.153.141,63</b>	<b>0,47</b>
<b>Bankguthaben</b>	<b>2.648.740,35</b>	<b>1,08</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>	<b>(456.028,66)</b>	<b>(0,19)</b>
<b>Nettovermögen Gesamt</b>	<b>245.924.464,35</b>	<b>100,00</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Euro Fixed Income

(ausgedrückt in EUR)

### Statistische Angaben

<b>Nettovermögen</b>	31.03.2022	EUR	1.168.051.344,11	<b>Anzahl der Anteile</b>		
	30.09.2021	EUR	1.243.629.109,61			
	30.09.2020	EUR	1.212.390.936,42			
<b>Nettoinventarwert pro Anteil**</b>				Capitalisation O (EUR)	31.03.2022	2.372
					30.09.2021	2.452
					30.09.2020	2.489
Capitalisation I (EUR)	31.03.2022	EUR	576,15	Capitalisation P (EUR)	31.03.2022	120.670
	30.09.2021	EUR	623,78		30.09.2021	119.430
	30.09.2020	EUR	630,50		30.09.2020	107.663
Capitalisation N (EUR)	31.03.2022	EUR	549,19	Capitalisation V (EUR)	31.03.2022	1.123.262
	30.09.2021	EUR	594,75		30.09.2021	1.533.085
	30.09.2020	EUR	601,49		30.09.2020	1.553.084
Capitalisation O (EUR)	31.03.2022	EUR	552,62	Capitalisation X (EUR)	31.03.2022	18.477
	30.09.2021	EUR	598,02		30.09.2021	21.253
	30.09.2020	EUR	603,89		30.09.2020	22.496
Capitalisation P (EUR)	31.03.2022	EUR	535,39	Capitalisation Z (EUR)	31.03.2022	26.415
	30.09.2021	EUR	580,68		30.09.2021	25.006
	30.09.2020	EUR	589,04		30.09.2020	24.708
Capitalisation V (EUR)	31.03.2022	EUR	148,56	Distribution O (EUR)	31.03.2022	1.162
	30.09.2021	EUR	161,07		30.09.2021	1.279
	30.09.2020	EUR	163,28		30.09.2020	1.659
Capitalisation X (EUR)	31.03.2022	EUR	525,42	Distribution P (EUR)	31.03.2022	13.034
	30.09.2021	EUR	570,14		30.09.2021	14.256
	30.09.2020	EUR	578,92		30.09.2020	17.345
Capitalisation Z (EUR)	31.03.2022	EUR	6.720,30	Distribution R (EUR)	31.03.2022	208.708
	30.09.2021	EUR	7.262,75		30.09.2021	222.163
	30.09.2020	EUR	7.314,63		30.09.2020	249.521
Distribution O (EUR)	31.03.2022	EUR	1.202,25			
	30.09.2021	EUR	1.301,01			
	30.09.2020	EUR	1.313,78			
Distribution P (EUR)	31.03.2022	EUR	1.182,39			
	30.09.2021	EUR	1.282,40			
	30.09.2020	EUR	1.300,83			
Distribution R (EUR)	31.03.2022	EUR	30,22			
	30.09.2021	EUR	32,73			
	30.09.2020	EUR	33,10			
<b>Anzahl der Anteile</b>						
Capitalisation I (EUR)	31.03.2022		1.251.484			
	30.09.2021		1.122.162			
	30.09.2020		1.049.409			
Capitalisation N (EUR)	31.03.2022		7.068			
	30.09.2021		8.334			
	30.09.2020		9.114			

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

## NN (L) Euro Fixed Income

(ausgedrückt in EUR)

### Statistische Angaben (Fortsetzung)

Laufende Kosten in %*		
Capitalisation I (EUR)	31.03.2022	0,49%
Capitalisation N (EUR)	31.03.2022	0,55%
Capitalisation O (EUR)	31.03.2022	0,40%
Capitalisation P (EUR)	31.03.2022	0,85%
Capitalisation V (EUR)	31.03.2022	0,78%
Capitalisation X (EUR)	31.03.2022	0,95%
Capitalisation Z (EUR)	31.03.2022	0,13%
Distribution O (EUR)	31.03.2022	0,40%
Distribution P (EUR)	31.03.2022	0,85%
Distribution R (EUR)	31.03.2022	0,56%
Portfolioumsatz in %*		
	31.03.2022	1,39%

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.



## NN (L) Euro Fixed Income

(ausgedrückt in EUR)

### Finanzabschlüsse

#### Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022

	Erläuterungen	
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	2	<b>1.137.390.927,60</b>
Organismen für gemeinsame Anlagen		87.891.035,80
Anleihen und andere Schuldtitel		1.049.499.891,80
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	2	<b>13.472.241,34</b>
Futures		13.472.241,34
<b>Sonstige Vermögenswerte</b>	4, 12	<b>96.843.957,14</b>
<b>Vermögenswerte Gesamt</b>		<b>1.247.707.126,08</b>
<b>Bankverbindlichkeiten</b>		<b>(623.220,91)</b>
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>	4, 12	<b>(50.739.879,03)</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	2	<b>(28.292.682,03)</b>
Credit Default Swaps		(4.086.562,39)
Inflationsswap		(2.508.439,86)
Zinsswaps		(17.592.088,72)
Total Return Swaps		(4.105.591,06)
<b>Verbindlichkeiten Gesamt</b>		<b>(79.655.781,97)</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Berichtszeitraums</b>		<b>1.168.051.344,11</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Euro Fixed Income

(ausgedrückt in EUR)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW	Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
<b>Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>									
<b>Anleihen und andere Schuldtitel</b>									
<b>Frankreich</b>									
300.000	AGENCE FRANCAISE DE DEVELOPPEMENT EPIC 3.125% 04/01/2024 EMTN	EUR	315.443,69	0,03	700.000	CIE DE SAINT-GOBAIN 2.375% 04/10/2027	EUR	732.670,55	0,06
500.000	APRR SA 1.250% 06/01/2027 EMTN	EUR	500.077,62	0,04	100.000	CREDIT AGRICOLE ASSURANCES SA 27/09/2048 FRN	EUR	110.199,43	0,01
600.000	AXA BANK EUROPE SCF 0.750% 06/03/2029 EMTN	EUR	584.398,44	0,05	400.000	CREDIT AGRICOLE HOME LOAN SFH SA 0.500% 03/04/2025 EMTN	EUR	396.308,34	0,03
1.000.000	BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL SA 0.010% 07/03/2025 EMTN	EUR	972.163,46	0,08	1.000.000	CREDIT AGRICOLE HOME LOAN SFH SA 0.500% 19/02/2026 EMTN	EUR	983.456,10	0,08
1.300.000	BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL SA 0.010% 11/05/2026 EMTN	EUR	1.233.472,86	0,11	1.200.000	CREDIT AGRICOLE HOME LOAN SFH SA 0.875% 11/08/2028 EMTN	EUR	1.184.434,76	0,10
300.000	BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL SA 0.250% 19/07/2028	EUR	273.938,27	0,02	400.000	CREDIT AGRICOLE SA 05/06/2030 FRN EMTN	EUR	396.657,84	0,03
500.000	BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL SA 0.250% 29/06/2028 EMTN	EUR	462.321,97	0,04	800.000	CREDIT AGRICOLE SA 2.000% 25/03/2029 EMTN	EUR	788.911,96	0,07
300.000	BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL SA 0.750% 08/06/2026 EMTN	EUR	293.901,44	0,03	600.000	CREDIT AGRICOLE SA 22/04/2026 FRN EMTN	EUR	594.013,38	0,05
1.500.000	BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL SA 0.750% 17/07/2025 EMTN	EUR	1.483.077,92	0,13	300.000	CREDIT AGRICOLE SA/LONDON 1.250%	EUR	300.717,34	0,03
300.000	BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL SA 1.125% 19/11/2031 EMTN	EUR	267.777,74	0,02	900.000	CREDIT AGRICOLE SA/LONDON 1.375% 03/05/2027 EMTN	EUR	901.092,70	0,08
100.000	BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL SA 2.375% 24/03/2026 EMTN	EUR	102.402,11	0,01	1.100.000	CREDIT MUTUEL - HOME LOAN SFH SA 0.625% 02/02/2026 EMTN	EUR	1.087.782,87	0,09
300.000	BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL SA 2.500% 25/05/2028 EMTN	EUR	306.096,94	0,03	500.000	CREDIT MUTUEL - HOME LOAN SFH SA 1.000% 30/01/2029 EMTN	EUR	496.051,61	0,04
500.000	BNP PARIBAS SA 04/06/2026 FRN	EUR	486.219,55	0,04	300.000	CREDIT MUTUEL - HOME LOAN SFH SA 2.500% 11/09/2023 EMTN	EUR	309.883,05	0,03
600.000	BNP PARIBAS SA 13/04/2027 FRN EMTN	EUR	567.363,62	0,05	200.000	CREDIT MUTUEL ARKEA SA 0.875% 07/05/2027 EMTN	EUR	194.096,78	0,02
1.100.000	BNP PARIBAS SA 15/01/2032 FRN EMTN	EUR	1.040.628,58	0,09	100.000	CREDIT MUTUEL ARKEA SA 25/10/2029 FRN EMTN	EUR	99.677,68	0,01
600.000	BNP PARIBAS SA 19/02/2028 FRN EMTN	EUR	563.595,80	0,05	800.000	DANONE SA 0.709% 03/11/2024 EMTN	EUR	802.348,41	0,07
900.000	BNP PARIBAS SA 23/01/2027 FRN EMTN	EUR	918.616,07	0,08	1.600.000	ESSILORLUXOTTICA SA 0.125% 27/05/2025 EMTN	EUR	1.562.190,34	0,13
300.000	BNP PARIBAS SA 31/03/2032 FRN EMTN	EUR	301.029,24	0,03	200.000	EUTELSAT SA 1.500% 13/10/2028	EUR	192.535,78	0,02
807.135	BPCE HOME LOANS FCT 2018 2018-1 A 31/10/2053 FRN	EUR	808.743,03	0,07	1.300.000	FCT CREDIT AGRICOLE HABITAT 2020 2020-1 A 27/07/2055 FRN	EUR	1.316.366,58	0,11
798.059	BPCE HOME LOANS FCT 2020 2020-1 A 31/10/2054 FRN	EUR	805.819,50	0,07	3.580.000	FRANCE GOVERNMENT BOND OAT ZCP 25/11/2029	EUR	3.377.478,61	0,29
500.000	BPCE SA 0.250% 14/01/2031	EUR	441.179,68	0,04	3.520.000	FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 0.250% 25/11/2026	EUR	3.475.557,22	0,30
1.600.000	BPCE SA 0.625% 15/01/2030	EUR	1.479.795,36	0,13	4.000.000	FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 0.500% 25/05/2025	EUR	4.021.813,88	0,34
500.000	BPCE SFH SA 0.010% 08/11/2026 EMTN	EUR	478.525,93	0,04	18.066.836	FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 0.500% 25/05/2027	EUR	11.539.842,62	0,99
300.000	BPCE SFH SA 0.010% 21/01/2027	EUR	286.118,42	0,02	4.140.000	FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 0.750% 25/05/2028	EUR	4.167.495,89	0,36
500.000	BPCE SFH SA 0.375% 18/03/2041	EUR	414.928,75	0,04	2.690.000	FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 0.750% 25/05/2052	EUR	2.267.873,15	0,19
500.000	BPCE SFH SA 0.625% 29/05/2031	EUR	473.362,16	0,04	1.110.000	FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 0.750% 25/05/2053	EUR	920.410,22	0,08
1.500.000	BPCE SFH SA 1.750% 27/06/2024 EMTN	EUR	1.537.931,01	0,13	4.000.000	FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 0.750% 25/11/2028	EUR	4.018.993,60	0,34
300.000	BPIFRANCE SACA 0.500% 25/05/2025 EMTN	EUR	298.698,85	0,03	7.230.000	FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 1.000% 25/05/2027	EUR	7.383.434,55	0,63
3.500.000	CAISSE D'AMORTISSEMENT DE LA DETTE SOCIALE ZCP 25/11/2030	EUR	3.181.355,49	0,27	18.283.000	FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 1.000% 25/11/2025	EUR	18.682.236,00	1,60
3.400.000	CAISSE D'AMORTISSEMENT DE LA DETTE SOCIALE 4.125% 25/04/2023 EMTN	EUR	3.551.373,37	0,30	2.080.000	FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 1.250% 25/05/2034	EUR	2.122.593,97	0,18
700.000	CAISSE DE REFINANCEMENT DE L'HABITAT SA 0.010% 08/10/2029	EUR	642.834,19	0,06	1.365.367	FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 1.500% 25/05/2031	EUR	1.444.315,56	0,12
1.000.000	CAISSE DE REFINANCEMENT DE L'HABITAT SA 0.010% 27/11/2026	EUR	955.720,50	0,08	2.930.000	FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 1.500% 25/05/2050	EUR	3.027.242,54	0,26
1.500.000	CAISSE DE REFINANCEMENT DE L'HABITAT SA 3.600% 08/03/2024 EMTN	EUR	1.589.499,26	0,14	2.240.000	FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 1.750% 25/05/2023	EUR	2.294.971,46	0,20
600.000	CAISSE FRANCAISE DE FINANCEMENT LOCAL 1.250% 11/05/2032 EMTN	EUR	597.056,27	0,05	10.799.448	FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 1.750% 25/05/2066	EUR	11.745.591,53	1,01
400.000	CAISSE FRANCAISE DE FINANCEMENT LOCAL 1.500% 28/06/2038	EUR	403.418,61	0,03	10.980.000	FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 1.750% 25/11/2024	EUR	11.431.027,33	0,98
1.500.000	CAISSE FRANCAISE DE FINANCEMENT LOCAL 5.375% 08/07/2024 EMTN	EUR	1.659.937,89	0,14	61.314.000	FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 2.000% 25/05/2048	EUR	70.296.443,36	6,02
1.500.000	CAPGEMINI SE 2.500% 01/07/2023	EUR	1.535.645,36	0,13	2.400.000	FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 3.250% 25/05/2045	EUR	3.327.066,74	0,28
600.000	CIE DE FINANCEMENT FONCIER SA 0.200% 16/09/2022 EMTN	EUR	601.617,76	0,05	3.700.000	FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 3.500% 25/04/2026	EUR	4.159.603,46	0,36
800.000	CIE DE FINANCEMENT FONCIER SA 0.375% 11/12/2024	EUR	792.494,93	0,07	1.770.000	FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 4.000% 25/04/2055	EUR	2.983.855,13	0,26
1.000.000	CIE DE FINANCEMENT FONCIER SA 0.875% 11/09/2028	EUR	985.203,57	0,08	1.470.000	FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 4.000% 25/04/2060	EUR	2.570.049,07	0,22
300.000	CIE DE FINANCEMENT FONCIER SA 2.000% 07/05/2024 EMTN	EUR	308.907,74	0,03	9.140.000	FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 4.000% 25/10/2038	EUR	13.091.795,72	1,12
100.000	CIE DE FINANCEMENT FONCIER SA 3.875% 25/04/2055 EMTN	EUR	163.087,47	0,01	1.300.000	FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 4.250% 25/10/2023	EUR	1.390.032,15	0,12
					1.000.000	FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 4.500% 25/04/2041	EUR	1.549.115,98	0,13
					5.850.000	FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 4.750% 25/04/2035	EUR	8.491.648,82	0,73
					6.679.061	FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 5.750% 25/10/2032	EUR	9.912.726,85	0,85

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.



## NN (L) Euro Fixed Income

(ausgedrückt in EUR)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW	Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
800.000	RED ELECTRICA FINANCIACIONES SAU 0.375% 24/07/2028 EMTN	EUR	765.139,73	0,07	900.000	HANNOVER RUECK SE 08/10/2040 FRN	EUR	833.723,50	0,07
500.000	SANTANDER CONSUMER FINANCE SA 0.500% 14/11/2026 EMTN	EUR	480.200,28	0,04	500.000	INFINEON TECHNOLOGIES AG 0.625% 17/02/2025	EUR	495.356,47	0,04
300.000	SANTANDER CONSUMER FINANCE SA 0.875% 30/05/2023 EMTN	EUR	302.369,20	0,03	1.500.000	ING-DIBA AG 0.625% 25/02/2029 EMTN	EUR	1.451.345,45	0,12
4.150.000	SPAIN GOVERNMENT BOND 0.100% 30/04/2031	EUR	3.733.101,71	0,32	500.000	LAND BADEN-WUERTEMBERG 0.625% 09/02/2027	EUR	494.951,14	0,04
7.100.000	SPAIN GOVERNMENT BOND 1.400% 30/04/2028	EUR	7.294.620,23	0,62	165.000	LANXESS AG 1.000% 07/10/2026 EMTN	EUR	161.705,76	0,01
19.753.000	SPAIN GOVERNMENT BOND 1.450% 30/04/2029	EUR	20.315.055,02	1,75	500.000	MERCK FINANCIAL SERVICES GMBH 0.875% 05/07/2031 EMTN	EUR	472.859,37	0,04
3.390.000	SPAIN GOVERNMENT BOND 1.450% 31/10/2027	EUR	3.491.477,04	0,30	1.500.000	MERCK KGAA 09/09/2080 FRN	EUR	1.462.823,79	0,13
7.001.000	SPAIN GOVERNMENT BOND 1.600% 30/04/2025	EUR	7.257.851,92	0,62	1.000.000	MERCK KGAA 12/12/2074 FRN	EUR	1.049.043,89	0,09
6.565.000	SPAIN GOVERNMENT BOND 1.850% 30/07/2035	EUR	6.785.182,62	0,58	900.000	MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS-GESELLSCHAFT AG IN MUENCHEN 26/05/2049 FRN	EUR	931.462,06	0,08
8.832.000	SPAIN GOVERNMENT BOND 1.950% 30/04/2026	EUR	9.271.517,59	0,79	500.000	SANTANDER CONSUMER BANK AG 0.750% 17/10/2022 EMTN	EUR	502.360,44	0,04
3.200.000	SPAIN GOVERNMENT BOND 2.150% 31/10/2025	EUR	3.375.638,50	0,29	250.000	STATE OF NORTH RHINE-WESTPHALIA GERMANY 1.875% 15/03/2024 EMTN	EUR	257.415,47	0,02
3.510.000	SPAIN GOVERNMENT BOND 2.350% 30/07/2033	EUR	3.838.412,66	0,33	250.000	STATE OF NORTH RHINE-WESTPHALIA GERMANY 4.375% 29/04/2022	EUR	250.857,28	0,02
4.000.000	SPAIN GOVERNMENT BOND 2.750% 31/10/2024	EUR	4.257.160,28	0,36	955.000	SYMRISE AG 1.250% 29/11/2025	EUR	943.700,45	0,08
3.073.000	SPAIN GOVERNMENT BOND 2.900% 31/10/2046	EUR	3.702.310,21	0,32	108.000	SYMRISE AG 1.375% 01/07/2027	EUR	105.207,75	0,01
1.598.000	SPAIN GOVERNMENT BOND 3.450% 30/07/2066	EUR	2.094.582,32	0,18	430.000	UNICREDIT BANK AG 0.250% 15/01/2032	EUR	390.722,87	0,03
6.400.000	SPAIN GOVERNMENT BOND 4.650% 30/07/2025	EUR	7.254.031,36	0,62	985.000	UNICREDIT BANK AG 0.625% 20/11/2025 EMTN	EUR	976.420,46	0,08
3.581.000	SPAIN GOVERNMENT BOND 4.700% 30/07/2041	EUR	5.327.436,01	0,46	600.000	VANTAGE TOWERS AG 0.375% 31/03/2027 EMTN	EUR	562.036,64	0,05
4.776.000	SPAIN GOVERNMENT BOND 4.800% 31/01/2024	EUR	5.186.978,86	0,44	300.000	VOLKSWAGEN BANK GMBH 1.250% 01/08/2022 EMTN	EUR	301.177,83	0,03
1.232.000	SPAIN GOVERNMENT BOND 5.150% 31/10/2044	EUR	1.999.407,48	0,17	1.600.000	VOLKSWAGEN BANK GMBH 1.250% 10/06/2024 EMTN	EUR	1.606.569,84	0,14
6.951.000	SPAIN GOVERNMENT BOND 5.750% 30/07/2032	EUR	9.903.998,68	0,85	1.000.000	VOLKSWAGEN BANK GMBH 1.875% 31/01/2024 EMTN	EUR	1.018.094,65	0,09
900.000	WIZINK MASTER CREDIT CARDS FT 2019-2 A 28/03/2033 FRN	EUR	899.295,55	0,08	200.000	VOLKSWAGEN BANK GMBH 2.500% 31/07/2026 EMTN	EUR	204.821,36	0,02
			<b>121.572.075,68</b>	<b>10,41</b>	284.000	VOLKSWAGEN FINANCIAL SERVICES AG 0.125% 12/02/2027 EMTN	EUR	261.003,42	0,02
	<b>Deutschland</b>				404.000	VOLKSWAGEN FINANCIAL SERVICES AG 0.625% 01/04/2022 EMTN	EUR	404.000,00	0,03
200.000	ADIDAS AG 0.625% 10/09/2035	EUR	175.329,51	0,02	1.000.000	VOLKSWAGEN FINANCIAL SERVICES AG 1.500% 01/10/2024 EMTN	EUR	1.005.990,50	0,09
200.000	ALBEMARLE NEW HOLDING GMBH 1.625% 25/11/2028	EUR	190.689,73	0,02	101.000	VOLKSWAGEN FINANCIAL SERVICES AG 2.250% 16/10/2026 EMTN	EUR	102.748,65	0,01
1.000.000	BAYER AG 0.750% 06/01/2027	EUR	959.419,98	0,08	110.000	VOLKSWAGEN FINANCIAL SERVICES AG 3.375% 06/04/2028 EMTN	EUR	117.635,55	0,01
500.000	BAYERISCHE LANDESBODENKREDITANSTALT 1.875% 25/01/2023	EUR	508.462,88	0,04	150.000	VOLKSWAGEN LEASING GMBH ZCP 19/07/2024 EMTN	EUR	146.172,81	0,01
25.756.529	BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE 0.250% 15/02/2027	EUR	25.660.374,47	2,20	950.000	VOLKSWAGEN LEASING GMBH 0.500% 20/06/2022 EMTN	EUR	951.446,46	0,08
8.100.000	BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE 0.250% 15/02/2029	EUR	8.007.140,22	0,69	763.000	VOLKSWAGEN LEASING GMBH 0.625% 19/07/2029 EMTN	EUR	683.517,57	0,06
5.400.000	BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE 0.500% 15/02/2026	EUR	5.451.766,02	0,47	667.000	VOLKSWAGEN LEASING GMBH 1.000% 16/02/2023 EMTN	EUR	671.801,28	0,06
6.591.000	BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE 0.500% 15/02/2028	EUR	6.630.280,71	0,57	700.000	VONOVIA SE 0.250% 01/09/2028 EMTN	EUR	627.305,58	0,05
4.040.000	BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE 0.500% 15/08/2027	EUR	4.065.069,13	0,35	300.000	VONOVIA SE 0.625% 14/12/2029 EMTN	EUR	268.220,57	0,02
9.141.000	BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE 4.000% 04/01/2037	EUR	13.594.849,60	1,16	900.000	VONOVIA SE 0.750% 01/09/2032 EMTN	EUR	774.016,48	0,07
4.903.000	BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE 4.750% 04/07/2034	EUR	7.372.958,77	0,63	200.000	VONOVIA SE 1.625% 01/09/2051 EMTN	EUR	156.048,05	0,01
5.450.000	BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE 5.500% 04/01/2031	EUR	7.816.201,21	0,67				<b>110.887.835,22</b>	<b>9,49</b>
1.000.000	COMMERZBANK AG 0.125% 09/01/2024 EMTN	EUR	995.254,68	0,09		<b>Niederlande</b>			
450.000	COMMERZBANK AG 0.500% 09/06/2026 EMTN	EUR	441.784,67	0,04	1.500.000	ABN AMRO BANK NV 1.125% 23/04/2039	EUR	1.421.734,28	0,12
500.000	COMMERZBANK AG 1.000% 04/03/2026 EMTN	EUR	494.308,17	0,04	500.000	AGCO INTERNATIONAL HOLDINGS BV 0.800% 06/10/2028	EUR	450.617,38	0,04
208.000	COMMERZBANK AG 1.500% 28/08/2028 EMTN	EUR	208.021,65	0,02	110.000	AKELIUS RESIDENTIAL PROPERTY FINANCING BV 1.125% 11/01/2029 EMTN	EUR	99.446,06	0,01
308.000	CONTINENTAL AG ZCP 12/09/2023	EUR	305.921,31	0,03	270.000	ALLIANDER NV FRN PERP	EUR	267.253,43	0,02
508.000	COVESTRO AG 0.875% 03/02/2026 EMTN	EUR	501.300,04	0,04	800.000	ARGENTUM NETHERLANDS BV FOR GIVAUDAN SA 1.125% 17/09/2025	EUR	800.307,46	0,07
508.000	COVESTRO AG 1.375% 12/06/2030 EMTN	EUR	489.101,85	0,04	170.000	ASR NEDERLAND NV 02/05/2049 FRN	EUR	172.243,82	0,01
400.000	DEUTSCHE BAHN FINANCE GMBH 2.500% 12/09/2023 EMTN	EUR	413.445,13	0,04	1.530.000	ATRADIS FINANCE BV 23/09/2044 FRN	EUR	1.617.890,48	0,14
400.000	DEUTSCHE BAHN FINANCE GMBH 3.000% 08/03/2024 EMTN	EUR	422.044,30	0,04	1.425.000	BMW FINANCE NV 0.625% 06/10/2023 EMTN	EUR	1.430.698,40	0,12
222.000	DEUTSCHE BANK AG 10/06/2026 FRN EMTN	EUR	223.432,37	0,02	210.000	BMW FINANCE NV 1.250% 05/09/2022 EMTN	EUR	211.410,00	0,02
200.000	DEUTSCHE BANK AG 1.625% 20/01/2027 EMTN	EUR	194.653,84	0,02	130.000	BRENTTAG FINANCE BV 1.125% 27/09/2025	EUR	129.258,06	0,01
300.000	DEUTSCHE BANK AG 17/02/2032 FRN	EUR	268.687,68	0,02	1.289.790	BUMPER NL 2020-1 BV -2020-NL1 A 24/06/2031 FRN	EUR	1.299.599,71	0,11
500.000	DEUTSCHE TELEKOM AG 1.750% 25/03/2031 EMTN	EUR	509.671,11	0,04	490.992	CANDIDE FINANCING 2021-1 BV 2021-1 A 20/11/2060 FRN	EUR	499.806,38	0,04
1.400.000	ENBW ENERGIE BADEN-WUERTEMBERG AG 31/08/2081 FRN	EUR	1.207.257,88	0,10	1.500.000	COCA-COLA HBC FINANCE BV 0.625% 21/11/2029	EUR	1.332.682,80	0,11
405.000	E.ON SE 1.625% 29/03/2031 EMTN	EUR	405.836,71	0,03					
700.000	EUROGRID GMBH 1.500% 18/04/2028 EMTN	EUR	698.620,29	0,06					
2.000.000	EUROGRID GMBH 1.625% 03/11/2023 EMTN	EUR	2.033.387,92	0,17					

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Euro Fixed Income

(ausgedrückt in EUR)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW	Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
800.000	COOPERATIEVE RABOBANK UA 0.125% 01/12/2031 EMTN	EUR	718.130,10	0,06	1.100.000	ING GROEP NV 26/05/2031 FRN EMTN	EUR	1.097.884,23	0,09
800.000	COOPERATIEVE RABOBANK UA 0.625% 26/04/2026 EMTN	EUR	790.243,06	0,07	400.000	ING GROEP NV 29/11/2030 FRN EMTN	EUR	370.372,66	0,03
700.000	COOPERATIEVE RABOBANK UA 0.875% 01/02/2029	EUR	689.262,39	0,06	410.000	KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV 0.250% 26/06/2025	EUR	397.821,75	0,03
200.000	CTP NV 0.625% 27/11/2023 EMTN	EUR	197.736,56	0,02	470.000	KONINKLIJKE DSM NV 0.625% 23/06/2032 EMTN	EUR	421.447,77	0,04
995.000	CTP NV 0.750% 18/02/2027 EMTN	EUR	895.811,16	0,08	1.200.000	KONINKLIJKE PHILIPS NV 1.375% 02/05/2028	EUR	1.186.611,38	0,10
517.000	CTP NV 0.875% 20/01/2026 EMTN	EUR	487.176,28	0,04	1.800.000	LINDE FINANCE BV 0.550% 19/05/2032 EMTN	EUR	1.649.471,24	0,14
400.000	CTP NV 1.500% 27/09/2031 EMTN	EUR	337.262,22	0,03	748.000	LYB INTERNATIONAL FINANCE II BV 0.875% 17/09/2026	EUR	718.894,57	0,06
531.000	DANFOSS FINANCE I BV 0.375% 28/10/2028 EMTN	EUR	485.556,17	0,04	600.000	MONDELEZ INTERNATIONAL HOLDINGS NETHERLANDS BV 0.625% 09/09/2032	EUR	535.595,90	0,05
399.000	DANFOSS FINANCE II BV 0.750% 28/04/2031 EMTN	EUR	357.008,05	0,03	200.000	NATURGY FINANCE BV 1.250% 19/04/2026 EMTN	EUR	199.472,90	0,02
200.000	DE VOLKSBANK NV 0.010% 16/09/2024 EMTN	EUR	197.126,27	0,02	1.000.000	NATURGY FINANCE BV 1.375% 19/01/2027 EMTN	EUR	999.848,36	0,09
700.000	DE VOLKSBANK NV 0.375% 16/09/2041 EMTN	EUR	578.010,41	0,05	200.000	NEDERLANDSE WATERSCHAPSBANK NV 0.500% 29/04/2030 EMTN	EUR	191.106,46	0,02
400.000	DE VOLKSBANK NV 0.500% 30/01/2026 EMTN	EUR	393.563,82	0,03	200.000	NEDERLANDSE WATERSCHAPSBANK NV 1.250% 27/05/2036 EMTN	EUR	196.926,36	0,02
200.000	DE VOLKSBANK NV 0.750% 24/10/2031 EMTN	EUR	191.257,80	0,02	2.610.000	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND ZCP 15/01/2029	EUR	2.504.663,85	0,21
1.000.000	DE VOLKSBANK NV 22/10/2030 FRN EMTN	EUR	985.457,60	0,08	4.817.000	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND ZCP 15/07/2030	EUR	4.568.259,46	0,39
507.362	DELFT 2020 BV 2020-1 A 17/10/2042 FRN	EUR	507.723,62	0,04	800.000	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 0.250% 15/07/2025	EUR	799.742,31	0,07
700.000	DEUTSCHE TELEKOM INTERNATIONAL FINANCE BV 0.875% 30/01/2024 EMTN	EUR	703.788,67	0,06	6.778.000	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 0.500% 15/07/2026	EUR	6.816.484,94	0,58
500.000	DEUTSCHE TELEKOM INTERNATIONAL FINANCE BV 1.500% 03/04/2028 EMTN	EUR	506.700,37	0,04	5.900.000	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 1.750% 15/07/2023	EUR	6.060.642,43	0,52
480.000	DIGITAL DUTCH FINCO BV 1.500% 15/03/2030	EUR	441.712,55	0,04	500.000	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 2.250% 15/07/2022	EUR	504.091,46	0,04
655.004	DUTCH PROPERTY FINANCE 2017-1 BV 2017-1 A 28/01/2048 FRN	EUR	655.107,04	0,06	1.164.511	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 2.500% 15/01/2033	EUR	1.370.387,48	0,12
551.547	DUTCH PROPERTY FINANCE 2018-1 BV 2018-1 A 28/04/2051 FRN	EUR	551.475,69	0,05	2.364.000	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 2.750% 15/01/2047	EUR	3.407.475,32	0,29
331.674	DUTCH PROPERTY FINANCE 2019-1 BV 2019-1 A 28/10/2052 FRN	EUR	331.685,79	0,03	750.000	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 3.750% 15/01/2023	EUR	775.574,03	0,07
473.930	DUTCH PROPERTY FINANCE 2020-1 BV 2020-1 A 28/07/2054 FRN	EUR	473.178,51	0,04	1.232.000	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 3.750% 15/01/2042	EUR	1.887.720,16	0,16
500.000	DUTCH PROPERTY FINANCE 2022-CMBS1 BV 2022-CMBS A 28/04/2050 FRN	EUR	496.999,00	0,04	3.333.000	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 4.000% 15/01/2037	EUR	4.787.879,90	0,41
260.748	DUTCH RESIDENTIAL MORTGAGE PORTFOLIO II BV -2 A 26/09/2048 FRN	EUR	260.953,40	0,02	200.000	NIBC BANK NV 0.875% 08/07/2025 EMTN	EUR	196.422,71	0,02
969.000	EDP FINANCE BV 0.375% 16/09/2026 EMTN	EUR	928.854,40	0,08	400.000	NIBC BANK NV 1.000% 11/09/2028 EMTN	EUR	395.109,69	0,03
335.000	EDP FINANCE BV 1.875% 13/10/2025 EMTN	EUR	343.612,55	0,03	250.000	NIBC BANK NV 1.125% 19/04/2023 EMTN	EUR	251.305,67	0,02
1.850.000	ELM BV FOR SWISS REINSURANCE CO LTD FRN PERP	EUR	1.851.023,36	0,16	800.000	REN FINANCE BV 2.500% 12/02/2025 EMTN	EUR	830.801,39	0,07
1.255.000	ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV 0.500% 17/06/2030 EMTN	EUR	1.123.370,57	0,10	700.000	REPSOL INTERNATIONAL FINANCE BV 0.250% 02/08/2027 EMTN	EUR	660.920,25	0,06
500.000	ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV 0.875% 17/06/2036 EMTN	EUR	413.755,08	0,04	500.000	REPSOL INTERNATIONAL FINANCE BV 2.250% 10/12/2026 EMTN	EUR	526.509,37	0,05
370.000	ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV 1.000% 16/09/2024 EMTN	EUR	371.440,71	0,03	1.094.875	SACEURE 16 BV -16 A 30/10/2091 FRN	EUR	1.097.755,04	0,09
200.000	ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV 1.125% 16/09/2026 EMTN	EUR	198.735,91	0,02	155.000	SAGAX EURO MTN NL BV 0.750% 26/01/2028 EMTN	EUR	136.129,24	0,01
1.300.000	E.ON INTERNATIONAL FINANCE BV 5.750% 14/02/2033 EMTN	EUR	1.758.061,71	0,15	355.000	SAGAX EURO MTN NL BV 1.625% 24/02/2026 EMTN	EUR	347.566,76	0,03
577.148	GREEN APPLE 2017-I NHG 2017-1 A 17/03/2056 FRN	EUR	579.043,72	0,05	1.290.000	SHELL INTERNATIONAL FINANCE BV 1.500% 07/04/2028 EMTN	EUR	1.307.628,51	0,11
898.586	GREEN APPLE 2018-1 NHG BV 2018-1 A 17/01/2057 FRN	EUR	901.551,77	0,08	600.000	SIEMENS FINANCIERINGSMAATSCHAPPIJ NV 1.250% 25/02/2035 EMTN	EUR	583.351,79	0,05
1.678.248	GREEN APPLE 2021-I BV 2021-1 A 17/01/2060 FRN	EUR	1.706.102,60	0,15	1.900.000	SILVER ARROW ATHLON NL 2021-1 BV 2021-1 A 26/04/2031 FRN	EUR	1.905.918,56	0,16
1.100.000	GREEN STORM 2018 BV 2018-GRN A 22/05/2065 FRN	EUR	1.104.941,35	0,09	901.000	STELLANTIS NV 2.750% 01/04/2032 EMTN	EUR	907.267,20	0,08
600.000	GREEN STORM 2021 BV 2021-GRN A 22/02/2068 FRN	EUR	613.211,62	0,05	2.100.000	STORM 2017-II BV 2017-2 A 22/05/2064 FRN	EUR	2.101.285,85	0,18
287.000	HEIMSTADEN BOSTAD TREASURY BV 0.750% 06/09/2029 EMTN	EUR	244.872,45	0,02	1.300.000	STORM 2019-I BV 2019-1 A 22/03/2066 FRN	EUR	1.310.742,68	0,11
126.000	HEIMSTADEN BOSTAD TREASURY BV 1.000% 13/04/2028 EMTN	EUR	113.724,67	0,01	560.000	TENNET HOLDING BV 0.500% 30/11/2040 EMTN	EUR	431.133,88	0,04
569.000	HEIMSTADEN BOSTAD TREASURY BV 1.625% 13/10/2031 EMTN	EUR	500.568,07	0,04	843.333	TULIP MORTGAGE FUNDING 2019-1 BV 2019-1 A 18/10/2056 FRN	EUR	844.962,75	0,07
500.000	IBERDROLA INTERNATIONAL BV FRN PERP	EUR	454.364,53	0,04	200.000	VAN LANSCHOT KEMPEN NV 0.375% 31/03/2023	EUR	200.850,61	0,02
600.000	IBERDROLA INTERNATIONAL BV FRN PERP	EUR	567.183,07	0,05	255.000	VESTEDA FINANCE BV 0.750% 18/10/2031 EMTN	EUR	227.262,32	0,02
600.000	IBERDROLA INTERNATIONAL BV FRN PERP	EUR	604.751,60	0,05	300.000	VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV FRN PERP	EUR	312.727,85	0,03
900.000	IBERDROLA INTERNATIONAL BV FRN PERP	EUR	845.787,74	0,07	400.000	VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV FRN PERP	EUR	399.571,27	0,03
1.700.000	ING BANK NV 0.125% 08/12/2031 EMTN	EUR	1.526.753,48	0,13	400.000	VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV FRN PERP	EUR	402.267,69	0,03
500.000	ING BANK NV 0.750% 18/02/2029 EMTN	EUR	488.161,45	0,04	1.800.000	VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV FRN PERP	EUR	1.811.128,68	0,16
300.000	ING GROEP NV 15/02/2029 FRN EMTN	EUR	305.689,10	0,03	200.000	VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV FRN PERP	EUR	216.066,06	0,02
500.000	ING GROEP NV 18/02/2029 FRN	EUR	456.545,00	0,04	700.000	VONOVIA FINANCE BV 1.000% 09/07/2030 EMTN	EUR	637.842,56	0,05
200.000	ING GROEP NV 22/03/2030 FRN	EUR	200.309,78	0,02					

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.



## NN (L) Euro Fixed Income

(ausgedrückt in EUR)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW	Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
200.000	VONOVIA FINANCE BV 1.125% 14/09/2034 EMTN	EUR	169.272,53	0,01	580.000	INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCES INC 1.800% 25/09/2026	EUR	581.179,24	0,05
200.000	VONOVIA FINANCE BV 2.250% 15/12/2023 EMTN	EUR	205.717,98	0,02	2.300.000	JPMORGAN CHASE & CO 11/03/2027 FRN EMTN	EUR	2.266.533,64	0,19
			<b>100.034.184,89</b>	<b>8,56</b>	300.000	JPMORGAN CHASE & CO 24/02/2028 FRN EMTN	EUR	282.546,31	0,02
	<b>Belgien</b>				1.080.000	LINDE INC/CT 1.625% 01/12/2025	EUR	1.106.629,85	0,09
900.000	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV 2.750% 17/03/2036 EMTN	EUR	969.338,43	0,08	1.700.000	METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING I 0.375% 09/04/2024	EUR	1.687.208,81	0,14
200.000	BELFIUS BANK SA 0.010% 15/10/2025 EMTN	EUR	192.585,42	0,02	600.000	METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING I 0.550% 23/01/2027 EMTN	EUR	569.805,14	0,05
700.000	BELFIUS BANK SA 0.375% 24/10/2023 EMTN	EUR	700.804,62	0,06	910.000	MORGAN STANLEY 1.750% 30/01/2025 GMTN	EUR	930.801,53	0,08
1.719.000	BELGIUM GOVERNMENT BOND 0.800% 22/06/2025	EUR	1.746.811,99	0,15	247.000	MORGAN STANLEY 23/10/2026 FRN EMTN	EUR	246.451,99	0,02
500.000	BELGIUM GOVERNMENT BOND 1.000% 22/06/2026	EUR	511.352,16	0,04	387.000	MORGAN STANLEY 29/04/2033 FRN	EUR	355.531,60	0,03
2.999.000	BELGIUM GOVERNMENT BOND 2.150% 22/06/2026	EUR	3.551.100,10	0,30	1.400.000	MORGAN STANLEY 29/10/2027 FRN	EUR	1.326.725,64	0,11
6.280.000	BELGIUM GOVERNMENT BOND 2.250% 22/06/2023	EUR	6.480.608,95	0,56	125.000	NASDAQ INC 0.875% 13/02/2030	EUR	114.622,72	0,01
1.080.000	BELGIUM GOVERNMENT BOND 3.750% 22/06/2045	EUR	1.581.902,47	0,14	909.000	NEW YORK LIFE GLOBAL FUNDING 0.250% 23/01/2027 GMTN	EUR	861.091,06	0,07
3.902.000	BELGIUM GOVERNMENT BOND 4.000% 28/03/2032	EUR	5.049.960,67	0,43	2.010.000	PARKER-HANNIFIN CORP 1.125% 01/03/2025	EUR	2.002.260,82	0,17
676.000	BELGIUM GOVERNMENT BOND 4.250% 28/09/2022	EUR	692.268,52	0,06	485.000	PEPSICO INC 0.400% 09/10/2032	EUR	428.263,08	0,04
1.402.000	BELGIUM GOVERNMENT BOND 4.500% 28/03/2026	EUR	1.631.247,57	0,14	265.000	PEPSICO INC 0.875% 16/10/2039	EUR	223.675,37	0,02
5.830.000	BELGIUM GOVERNMENT BOND 5.000% 28/03/2035	EUR	8.545.755,61	0,73	1.379.000	VERIZON COMMUNICATIONS INC 0.375% 22/03/2029	EUR	1.279.697,18	0,11
5.791.428	BELGIUM GOVERNMENT BOND 5.500% 28/03/2028	EUR	7.494.169,63	0,64	583.000	VERIZON COMMUNICATIONS INC 1.125% 19/09/2035	EUR	526.635,48	0,05
700.000	BNP PARIBAS FORTIS SA ZCP 24/10/2023 EMTN	EUR	696.713,16	0,06	200.000	VERIZON COMMUNICATIONS INC 1.250% 08/04/2030	EUR	195.272,75	0,02
400.000	BNP PARIBAS FORTIS SA 0.500% 23/09/2024 EMTN	EUR	398.225,06	0,03	700.000	WELLS FARGO & CO 0.500% 26/04/2024 EMTN	EUR	695.328,80	0,06
1.000.000	BUMPER BE NV/SA 2021-BE1 A 23/10/2031 FRN	EUR	1.003.227,22	0,09	200.000	WELLS FARGO & CO 2.625% 16/08/2022 EMTN	EUR	202.160,39	0,02
900.000	KBC GROUP NV 01/03/2027 FRN EMTN	EUR	858.472,07	0,07				<b>36.740.161,78</b>	<b>3,15</b>
900.000	KBC GROUP NV 07/12/2031 FRN EMTN	EUR	830.835,89	0,07		<b>Irland</b>			
300.000	KBC GROUP NV 18/09/2029 FRN EMTN	EUR	298.250,60	0,03	1.200.000	ACCUNIA EUROPEAN CLO III DAC -3X A 20/01/2031 FRN	EUR	1.195.349,76	0,10
500.000	MINISTERIES VAN DE VLAAMSE GEMEENSCHAP 1.341% 12/06/2025 EMTN	EUR	512.515,37	0,04	240.000	AIB GROUP PLC 04/04/2028 FRN EMTN	EUR	241.012,39	0,02
200.000	MINISTERIES VAN DE VLAAMSE GEMEENSCHAP 1.875% 02/06/2042 EMTN	EUR	212.163,95	0,02	400.000	AIB GROUP PLC 1.250% 28/05/2024 EMTN	EUR	401.251,92	0,03
			<b>43.958.309,46</b>	<b>3,76</b>	444.000	AIB GROUP PLC 17/11/2027 FRN EMTN	EUR	414.667,85	0,04
	<b>Vereinigte Staaten</b>				650.000	ATLAS COPCO FINANCE DAC 0.750% 08/02/2032 EMTN	EUR	601.747,84	0,05
728.000	AMERICAN TOWER CORP 0.400% 15/02/2027	EUR	679.363,28	0,06	279.467	AURIUM CLO III DAC -3X AR 16/04/2030 FRN	EUR	278.055,22	0,02
2.620.000	AT&T INC 1.600% 19/05/2028	EUR	2.638.295,15	0,23	139.733	AURIUM CLO III DAC -3X ARE 16/04/2030 FRN	EUR	139.027,61	0,01
785.000	AT&T INC 1.800% 05/09/2026	EUR	803.752,84	0,07	128.000	BANK OF IRELAND GROUP PLC 08/07/2024 FRN EMTN	EUR	128.027,28	0,01
415.000	AT&T INC 3.150% 04/09/2036	EUR	456.370,41	0,04	266.000	BANK OF IRELAND GROUP PLC 10/05/2027 FRN EMTN	EUR	247.521,89	0,02
400.000	BANK OF AMERICA CORP 07/02/2025 FRN EMTN	EUR	403.474,49	0,03	500.000	BANK OF IRELAND GROUP PLC 1.375% 29/08/2023 EMTN	EUR	505.795,56	0,04
500.000	BANK OF AMERICA CORP 0.750% 26/07/2023 EMTN	EUR	503.584,97	0,04	1.099.000	BLACKROCK EUROPEAN CLO 1 DAC 15/03/2031 FRN	EUR	1.090.280,64	0,09
374.000	BANK OF AMERICA CORP 22/03/2031 FRN EMTN	EUR	340.835,64	0,03	47.533	BLUESTEP MORTGAGE SECURITIES NO 4 DAC -4 A 10/08/2066 FRN	EUR	47.537,27	0,00
300.000	BMW US CAPITAL LLC 1.000% 20/04/2027 EMTN	EUR	295.302,15	0,03	45.918	CITIZEN IRISH AUTO RECEIVABLES TRUST 2018-1 A 15/12/2027 FRN	EUR	45.929,93	0,00
1.161.000	CELANESE US HOLDINGS LLC 1.250% 11/02/2025	EUR	1.137.345,81	0,10	341.598	CITIZEN IRISH AUTO RECEIVABLES TRUST 2020-1 A 15/12/2029 FRN	EUR	342.111,87	0,03
200.000	CELANESE US HOLDINGS LLC 2.125% 01/03/2027	EUR	195.098,44	0,02	599.619	CONTEGO CLO IV DAC -4X ARE 23/01/2030 FRN	EUR	595.108,91	0,05
420.000	CITIGROUP INC 06/07/2026 FRN EMTN	EUR	418.485,98	0,04	765.000	CVC CORDATUS LOAN FUND III DAC -3X A1RR 15/08/2032 FRN	EUR	759.022,37	0,06
200.000	CITIGROUP INC 24/07/2026 FRN EMTN	EUR	200.750,84	0,02	403.132	DILOSK RMBS NO 3 DAC -3 A 20/10/2057 FRN	EUR	403.192,70	0,03
3.265.000	COCA-COLA CO/THE 1.125% 09/03/2027	EUR	3.283.493,81	0,28	683.878	DILOSK RMBS NO 5 DAC -5 A 20/12/2060 FRN	EUR	682.394,95	0,06
1.500.000	COMCAST CORP 0.750% 20/02/2032	EUR	1.380.021,74	0,12	269.634	EOS EUROPEAN LOAN CONDUIT NO 35 DAC -35X A 23/04/2029 FRN	EUR	270.061,04	0,02
1.096.000	EMERSON ELECTRIC CO 1.250% 15/10/2025 EMTN	EUR	1.102.903,45	0,09	151.008	FASTNET SECURITIES 13 DAC -13 A 18/04/2057 FRN	EUR	150.976,16	0,01
1.351.000	EMERSON ELECTRIC CO 2.000% 15/10/2029 EMTN	EUR	1.393.722,44	0,12	559.456	FINANCE IRELAND RMBS NO 1 DAC -1 A 24/06/2058 FRN	EUR	559.580,84	0,05
1.109.000	EQUINIX INC 1.000% 15/03/2033	EUR	933.417,80	0,08	865.440	FINANCE IRELAND RMBS NO 2 DAC -2 A 24/09/2060 FRN	EUR	866.248,47	0,07
797.000	EQUITABLE FINANCIAL LIFE GLOBAL FUNDING 0.600% 16/06/2028 EMTN	EUR	739.365,78	0,06	887.580	FINANCE IRELAND RMBS NO 3 DAC 3 A 24/06/2061 FRN	EUR	890.205,21	0,08
1.700.000	GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE 1.375% 15/05/2024 EMTN	EUR	1.717.449,12	0,15	747.100	FINGAL SECURITIES RMBS DAC -1 A 28/07/2055 FRN	EUR	748.934,66	0,06
800.000	GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE 30/04/2024 FRN EMTN	EUR	794.987,90	0,07	344.681	FORTUNA CONSUMER LOAN ABS 2021 DAC 2021 A 15/10/2030 FRN	EUR	344.959,00	0,03
675.000	INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP 0.300% 11/02/2028	EUR	638.200,05	0,05	317.268	FROSIN-2018 DAC 2018-1 A1 21/05/2028 FRN	EUR	311.485,70	0,03
800.000	INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP 0.950% 23/05/2025	EUR	801.518,29	0,07	1.438.900	GLENBEIGH 2 ISSUER DAC -1X A 24/03/2046 FRN	EUR	1.428.221,78	0,12

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Euro Fixed Income

(ausgedrückt in EUR)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW	Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
123.000	HAMMERSON IRELAND FINANCE DAC 1.750% 03/06/2027	EUR	113.757,41	0,01	200.000	RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG 0.250% 22/01/2025 EMTN	EUR	194.685,26	0,02
1.988.379	IRELAND GOVERNMENT BOND 1.300% 15/05/2033	EUR	2.030.384,24	0,18	100.000	RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG 0.375% 25/09/2026 EMTN	EUR	94.987,76	0,01
880.000	IRELAND GOVERNMENT BOND 1.500% 15/05/2050	EUR	895.288,98	0,08	700.000	TELEKOM FINANZMANAGEMENT GMBH 1.500% 07/12/2026	EUR	709.776,77	0,06
774.000	IRELAND GOVERNMENT BOND 2.000% 18/02/2045	EUR	876.750,44	0,08	400.000	UNICREDIT BANK AUSTRIA AG 0.625% 20/03/2029 EMTN	EUR	386.111,02	0,03
3.365.000	IRELAND GOVERNMENT BOND 2.400% 15/05/2030	EUR	3.788.373,70	0,33				<b>35.033.645,51</b>	<b>3,00</b>
600.000	IRELAND GOVERNMENT BOND 3.400% 18/03/2024	EUR	640.147,29	0,05		<b>Luxemburg</b>			
3.900.000	IRELAND GOVERNMENT BOND 5.400% 13/03/2025	EUR	4.479.390,51	0,39	100.000	AROUNDTOWN SA 1.450% 09/07/2028 EMTN	EUR	93.255,47	0,01
1.200.000	JUBILEE CLO 2015-XV DAC 12/07/2028 FRN	EUR	1.194.568,44	0,10	100.000	AROUNDTOWN SA 1.625% 31/01/2028 EMTN	EUR	95.647,76	0,01
547.086	KANAAL CMBBS FINANCE 2019 DAC 2019-1 A 22/08/2028 FRN	EUR	546.731,27	0,05	478.920	CARTESIAN RESIDENTIAL MORTGAGES BLUE SA BLUE A 18/07/2044 FRN	EUR	479.364,85	0,04
520.000	KERRY GROUP FINANCIAL SERVICES UNLTD CO 0.625% 20/09/2029	EUR	475.919,58	0,04	724.165	CARTESIAN RESIDENTIAL MORTGAGES 4 SA -4 A 25/11/2054 FRN	EUR	724.607,15	0,06
2.000.000	KERRY GROUP FINANCIAL SERVICES UNLTD CO 2.375% 10/09/2025	EUR	2.077.525,08	0,19	250.000	CBRE GLOBAL INVESTORS OPEN-ENDED FUND SCA SICAV-SIF PAN EUROPEAN CORE FUND 0.900% 12/10/2029	EUR	225.650,13	0,02
700.000	LT AUTORAHOITUS II DAC -2 A 18/06/2031 FRN	EUR	704.486,55	0,06	180.000	CNH INDUSTRIAL FINANCE EUROPE SA 1.750% 25/03/2027 EMTN	EUR	179.915,81	0,02
775.071	MULCAIR SECURITIES DAC -1 A 24/04/2071 FRN	EUR	775.163,32	0,07	1.945.000	CNH INDUSTRIAL FINANCE EUROPE SA 1.875% 19/01/2026 EMTN	EUR	1.972.793,33	0,17
243.308	ORANJE EUROPEAN LOAN CONDUIT NO 32 DAC - 32 A 22/11/2028 FRN	EUR	242.733,58	0,02	1.298.000	DH EUROPE FINANCE II SARL 0.750% 18/09/2031	EUR	1.189.859,88	0,10
1.650.000	PARTNERRE IRELAND FINANCE DAC 1.250% 15/09/2026	EUR	1.626.810,45	0,15	2.800.000	EUROPEAN FINANCIAL STABILITY FACILITY 3.375% 03/04/2037 EMTN	EUR	3.603.256,36	0,30
831.029	PRIMROSE RESIDENTIAL 2021-1 DAC 2021-1 A 24/03/2061 FRN	EUR	826.735,69	0,07	657.439	FACT MASTER SA 2021-1 A 20/07/2028 FRN	EUR	659.817,73	0,06
248.000	SMURFIT KAPPA ACQUISITIONS ULC 2.875% 15/01/2026	EUR	259.105,98	0,02	400.000	GRAND CITY PROPERTIES SA FRN PERP EMTN	EUR	354.803,95	0,03
194.000	SMURFIT KAPPA TREASURY ULC 0.500% 22/09/2029	EUR	174.358,98	0,01	200.000	GRAND CITY PROPERTIES SA 0.125% 11/01/2028 EMTN	EUR	175.064,10	0,01
555.572	TAURUS 2019-1 FR DAC 2019-1FR A 02/02/2031 FRN	EUR	555.031,49	0,05	700.000	HANNOVER FINANCE LUXEMBOURG SA 30/06/2043 FRN	EUR	736.145,89	0,06
128.619	TAURUS 2019-4 FIN DAC 2019-FIN4 A 18/11/2031 FRN	EUR	128.739,03	0,01	400.000	HEIDELBERGEMENT FINANCE LUXEMBOURG SA 1.625% 07/04/2026 EMTN	EUR	402.192,78	0,03
441.786	TAURUS 2020-1 NL DAC 2020-NL1X A 20/02/2030 FRN	EUR	438.500,06	0,04	349.000	HIGHLAND HOLDINGS SARL 0.318% 15/12/2026	EUR	328.939,42	0,03
			<b>36.539.210,89</b>	<b>3,13</b>	117.000	HOLCIM FINANCE LUXEMBOURG SA 0.500% 23/04/2031	EUR	101.186,31	0,01
	<b>Österreich</b>				555.000	HOLCIM FINANCE LUXEMBOURG SA 0.500% 29/11/2026 EMTN	EUR	528.719,92	0,05
2.540.000	AUSTRIA GOVERNMENT BOND ZCP 20/02/2031	EUR	2.348.815,83	0,20	727.000	HOLCIM FINANCE LUXEMBOURG SA 0.625% 19/01/2033 EMTN	EUR	601.876,94	0,05
500.000	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 0.750% 20/10/2026	EUR	505.937,20	0,04	517.000	JOHN DEERE CASH MANAGEMENT SARL 2.200% 02/04/2032 EMTN	EUR	548.422,86	0,05
1.000.000	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 1.500% 20/02/2047	EUR	1.087.339,63	0,09	427.000	LOGICOR FINANCING SARL 0.875% 14/01/2031 EMTN	EUR	360.727,87	0,03
2.020.000	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 1.750% 20/10/2023	EUR	2.081.130,11	0,18	683.000	LOGICOR FINANCING SARL 1.625% 15/07/2027 EMTN	EUR	656.813,39	0,06
100.000	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 2.400% 23/05/2034	EUR	116.145,62	0,01	300.000	LOGICOR FINANCING SARL 1.625% 17/01/2030 EMTN	EUR	276.952,73	0,02
880.000	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 3.150% 20/06/2044	EUR	1.249.480,11	0,11	100.000	LOGICOR FINANCING SARL 2.250% 13/05/2025 EMTN	EUR	101.224,15	0,01
250.000	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 3.400% 22/11/2022	EUR	256.305,50	0,02	200.000	LOGICOR FINANCING SARL 3.250% 13/11/2028 EMTN	EUR	206.320,25	0,02
5.410.000	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 3.650% 20/04/2022	EUR	5.420.798,85	0,47	660.000	MEDTRONIC GLOBAL HOLDINGS SCA 0.375% 15/10/2028	EUR	620.122,22	0,05
1.547.000	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 3.800% 26/01/2062	EUR	2.780.471,12	0,24	1.500.000	MEDTRONIC GLOBAL HOLDINGS SCA 0.750% 15/10/2032	EUR	1.374.022,79	0,12
2.008.000	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 4.150% 15/03/2037	EUR	2.878.756,43	0,25	530.000	MEDTRONIC GLOBAL HOLDINGS SCA 1.000% 02/07/2031	EUR	504.888,79	0,04
3.234.000	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 4.850% 15/03/2026	EUR	3.813.336,08	0,33	1.000.000	MEDTRONIC GLOBAL HOLDINGS SCA 2.250% 07/03/2039	EUR	1.022.118,27	0,09
3.845.000	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 6.250% 15/07/2027	EUR	5.021.402,40	0,43	378.526	MIRAVET SARL - COMPARTMENT 2020-1 2020-1 A 26/05/2065 FRN	EUR	378.448,88	0,03
900.000	AUSTRIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.500% 10/01/2024	DEM	508.683,61	0,04	977.361	MIRAVET SARL 2019-1 A 26/05/2065 FRN	EUR	973.977,63	0,08
400.000	ERSTE GROUP BANK AG 0.100% 15/01/2030 EMTN	EUR	368.120,52	0,03	1.125.000	NESTLE FINANCE INTERNATIONAL LTD 1.500% 29/03/2035 EMTN	EUR	1.132.425,82	0,10
1.100.000	ERSTE GROUP BANK AG 0.250% 26/06/2024 EMTN	EUR	1.091.012,13	0,09	500.000	NESTLE FINANCE INTERNATIONAL LTD 1.750% 12/09/2022 EMTN	EUR	504.701,22	0,04
600.000	ERSTE GROUP BANK AG 0.375% 16/04/2024 EMTN	EUR	593.239,09	0,05	500.000	PBD GERMANY AUTO LEASE MASTER SA 2021- GE2 A 26/11/2030 FRN	EUR	502.247,95	0,04
1.000.000	ERSTE GROUP BANK AG 0.625% 18/01/2027 EMTN	EUR	981.700,50	0,08	129.000	PROLOGIS INTERNATIONAL FUNDING II SA 1.625% 17/06/2032 EMTN	EUR	121.652,50	0,01
700.000	ERSTE GROUP BANK AG 10/06/2030 FRN EMTN	EUR	666.717,39	0,06	710.000	P3 GROUP SARL 1.625% 26/01/2029 EMTN	EUR	649.905,48	0,06
600.000	ERSTE GROUP BANK AG 1.500% 07/04/2026 EMTN	EUR	603.029,27	0,05	1.914.014	SC GERMANY SA COMPARTMENT CONSUMER 2020-1 2020-1 A 14/11/2031 FRN	EUR	1.926.592,95	0,16
300.000	ERSTE GROUP BANK AG 15/11/2032 FRN EMTN	EUR	270.826,95	0,02	100.000	SEGO CAPITAL SARL 0.500% 22/09/2031	EUR	87.668,28	0,01
1.100.000	ERSTE GROUP BANK AG 16/11/2028 FRN EMTN	EUR	1.004.836,36	0,09	225.000	SELP FINANCE SARL 1.500% 20/12/2026	EUR	220.393,12	0,02
					400.000	TRATON FINANCE LUXEMBOURG SA 1.250% 24/03/2033 EMTN	EUR	349.349,22	0,03

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Euro Fixed Income

(ausgedrückt in EUR)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW	Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
612.000	TYCO ELECTRONICS GROUP SA ZCP 16/02/2029	EUR	548.712,26	0,05	275.000	LLOYDS BANK CORPORATE MARKETS PLC 2.375% 09/04/2026 EMTN	EUR	285.953,40	0,02
			<b>25.520.786,41</b>	<b>2,18</b>	1.250.000	LLOYDS BANK PLC 4.875% 13/01/2023 EMTN	EUR	1.299.158,84	0,10
	<b>Supranational-Multinational</b>				200.000	LLOYDS BANKING GROUP PLC 01/04/2026 FRN EMTN	EUR	211.698,60	0,02
400.000	AFRICAN DEVELOPMENT BANK 0.125% 07/10/2026	EUR	386.764,90	0,03	695.000	NATIONAL WESTMINSTER BANK PLC 0.500% 15/05/2024 EMTN	EUR	693.161,35	0,06
400.000	AFRICAN DEVELOPMENT BANK 0.250% 24/01/2024	EUR	399.045,70	0,03	100.000	NATIONWIDE BUILDING SOCIETY 0.625% 25/03/2027 EMTN	EUR	97.929,95	0,01
500.000	EUROFIMA 3.125% 15/11/2022 EMTN	EUR	510.284,72	0,04	300.000	NATIONWIDE BUILDING SOCIETY 1.125% 31/05/2028 EMTN	EUR	300.059,45	0,03
1.510.000	EUROPEAN INVESTMENT BANK 1.750% 15/09/2045 EMTN	EUR	1.661.435,21	0,14	210.000	NATIONWIDE BUILDING SOCIETY 1.375% 29/06/2032 EMTN	EUR	211.197,81	0,02
7.575.000	EUROPEAN INVESTMENT BANK 4.000% 15/10/2037 EMTN	EUR	10.518.373,97	0,91	507.000	NATWEST GROUP PLC 04/03/2025 FRN EMTN	EUR	515.303,58	0,04
1.150.000	EUROPEAN STABILITY MECHANISM 1.750% 20/10/2045 EMTN	EUR	1.272.294,20	0,11	200.000	NATWEST GROUP PLC 14/09/2032 FRN EMTN	EUR	183.510,24	0,02
2.540.000	EUROPEAN UNION ZCP 04/07/2031 EMTN	EUR	2.307.395,39	0,20	506.000	NATWEST GROUP PLC 26/02/2030 FRN EMTN	EUR	466.532,51	0,04
2.800.000	EUROPEAN UNION ZCP 04/07/2035 EMTN	EUR	2.387.321,13	0,21	600.000	NATWEST MARKETS PLC 0.125% 12/11/2025 EMTN	EUR	572.337,46	0,05
2.100.000	EUROPEAN UNION 0.100% 04/10/2040 EMTN	EUR	1.693.723,73	0,15	100.000	NATWEST MARKETS PLC 2.750% 02/04/2025 EMTN	EUR	104.517,80	0,01
150.000	EUROPEAN UNION 0.750% 04/04/2031 EMTN	EUR	146.508,50	0,01	600.000	RENTOKIL INITIAL PLC 0.500% 14/10/2028 EMTN	EUR	542.654,93	0,05
2.300.000	EUROPEAN UNION 1.500% 04/10/2035 EMTN	EUR	2.380.875,50	0,20	800.000	SANTANDER UK GROUP HOLDINGS PLC 13/09/2029 FRN EMTN	EUR	727.616,94	0,06
300.000	EUROPEAN UNION 3.375% 04/04/2032 EMTN	EUR	365.417,60	0,03	475.000	SANTANDER UK PLC 0.050% 12/01/2027 GMTN	EUR	452.165,04	0,04
200.000	INTERNATIONAL BANK FOR RECONSTRUCTION & DEVELOPMENT 0.500% 16/04/2030	EUR	191.368,14	0,02	500.000	SANTANDER UK PLC 0.375% 20/09/2023	EUR	500.600,33	0,04
200.000	INTERNATIONAL BANK FOR RECONSTRUCTION & DEVELOPMENT 0.625% 12/01/2033	EUR	188.349,86	0,02	600.000	TESCO CORPORATE TREASURY SERVICES PLC 0.375% 27/07/2029 EMTN	EUR	527.988,01	0,05
250.000	NORDIC INVESTMENT BANK 0.125% 10/06/2024 EMTN	EUR	247.881,43	0,02	365.000	TESCO CORPORATE TREASURY SERVICES PLC 0.875% 29/05/2026 EMTN	EUR	353.797,86	0,03
			<b>24.657.039,98</b>	<b>2,12</b>	1.280.000	VODAFONE GROUP PLC 1.125% 20/11/2025 EMTN	EUR	1.284.711,83	0,10
	<b>Finnland</b>				180.000	VODAFONE GROUP PLC 2.200% 25/08/2026 EMTN	EUR	188.481,09	0,02
500.000	AKTIA BANK 0.125% 25/10/2028 EMTN	EUR	469.577,67	0,04				<b>13.109.034,33</b>	<b>1,12</b>
400.000	BALDER FINLAND OYJ 1.000% 20/01/2029 EMTN	EUR	352.175,69	0,03		<b>Rumänien</b>			
191.000	BALDER FINLAND OYJ 2.000% 18/01/2031	EUR	173.517,36	0,01	4.000.000	ROMANIAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 1.375% 02/12/2029 EMTN	EUR	3.416.292,84	0,29
1.200.000	ELENIA VERKKO OYJ 0.375% 06/02/2027 EMTN	EUR	1.119.613,51	0,10	4.000.000	ROMANIAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 2.000% 14/04/2033 EMTN	EUR	3.212.147,88	0,28
1.500.000	FINGRID OYJ 3.500% 03/04/2024 EMTN	EUR	1.586.859,65	0,14	5.000.000	ROMANIAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 2.375% 19/04/2027 EMTN	EUR	4.886.490,10	0,42
1.370.000	FINLAND GOVERNMENT BOND 0.250% 15/09/2040	EUR	1.176.997,11	0,10				<b>11.514.930,82</b>	<b>0,99</b>
500.000	FINLAND GOVERNMENT BOND 0.750% 15/04/2031	EUR	497.357,24	0,04		<b>Japan</b>			
500.000	FINLAND GOVERNMENT BOND 1.500% 15/04/2023	EUR	510.136,61	0,04	1.800.000	ASAHI GROUP HOLDINGS LTD 0.541% 23/10/2028	EUR	1.664.896,52	0,14
300.000	FINLAND GOVERNMENT BOND 1.625% 15/09/2022	EUR	302.964,41	0,03	707.000	NTT FINANCE CORP 0.399% 13/12/2028 EMTN	EUR	661.485,89	0,06
2.360.000	FINLAND GOVERNMENT BOND 2.000% 15/04/2024	EUR	2.455.458,74	0,22	1.000.000	SUMITOMO MITSUI TRUST BANK LTD 0.277% 25/10/2028 EMTN	EUR	932.783,85	0,08
962.000	FINLAND GOVERNMENT BOND 2.625% 04/07/2042	EUR	1.238.396,74	0,11	800.000	TAKEDA PHARMACEUTICAL CO LTD 1.375% 09/07/2032	EUR	759.956,83	0,07
2.190.000	FINLAND GOVERNMENT BOND 2.750% 04/07/2028	EUR	2.479.035,15	0,21	2.105.000	TAKEDA PHARMACEUTICAL CO LTD 2.250% 21/11/2026	EUR	2.185.041,72	0,18
400.000	KOJAMO OYJ 1.625% 07/03/2025	EUR	399.380,06	0,03	900.000	TAKEDA PHARMACEUTICAL CO LTD 3.000% 21/11/2030	EUR	979.347,60	0,08
360.000	OP CORPORATE BANK PLC 0.100% 16/11/2027 EMTN	EUR	333.593,45	0,03				<b>7.183.512,41</b>	<b>0,61</b>
674.000	OP CORPORATE BANK PLC 09/06/2030 FRN	EUR	661.883,59	0,06		<b>Kanada</b>			
1.180.000	SAMPO OYJ 23/05/2049 FRN	EUR	1.214.007,73	0,10	1.300.000	BANK OF NOVA SCOTIA 0.010% 15/12/2027 EMTN	EUR	1.220.068,01	0,10
300.000	SATO OYJ 1.375% 24/02/2028	EUR	278.693,25	0,02	1.959.000	FAIRFAX FINANCIAL HOLDINGS LTD 2.750% 29/03/2028	EUR	1.970.192,55	0,17
300.000	UPM-KYMMENE OYJ 0.125% 19/11/2028 EMTN	EUR	269.713,52	0,02	700.000	ROYAL BANK OF CANADA 0.050% 19/06/2026 EMTN	EUR	672.087,84	0,06
			<b>15.519.361,48</b>	<b>1,33</b>	800.000	ROYAL BANK OF CANADA 0.625% 10/09/2025 GMTN	EUR	792.571,31	0,07
	<b>Vereinigtes Königreich</b>				700.000	ROYAL BANK OF CANADA 0.875% 17/06/2022	EUR	701.881,87	0,06
100.000	ANGLO AMERICAN CAPITAL PLC 1.625% 11/03/2026 EMTN	EUR	98.866,91	0,01	1.000.000	TORONTO-DOMINION BANK/THE ZCP 09/02/2024	EUR	991.208,91	0,08
490.000	AVIVA PLC 04/12/2045 FRN EMTN	EUR	510.248,85	0,04	700.000	TORONTO-DOMINION BANK/THE 0.250% 27/04/2022	EUR	700.324,81	0,06
480.000	BARCLAYS PLC 09/06/2025 FRN EMTN	EUR	474.996,61	0,04				<b>7.048.335,30</b>	<b>0,60</b>
500.000	BP CAPITAL MARKETS PLC 2.519% 07/04/2028 EMTN	EUR	528.486,47	0,05		<b>Neuseeland</b>			
1.000.000	COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC 2.625% 06/11/2023 EMTN	EUR	1.030.055,79	0,09	440.000	ANZ NEW ZEALAND INT'L LTD/LONDON 0.125% 22/09/2023 EMTN	EUR	439.040,26	0,04
84.847	GREAT HALL MORTGAGES NO 1 PLC 2006-1 A2B 18/06/2038 FRN	EUR	83.582,60	0,01	1.625.000	ASB FINANCE LTD 0.250% 08/09/2028 EMTN	EUR	1.463.918,63	0,13
800.000	HSBC HOLDINGS PLC 24/09/2029 FRN	EUR	737.627,46	0,06					
128.000	LLOYDS BANK CORPORATE MARKETS PLC 0.375% 28/01/2025 EMTN	EUR	125.792,62	0,01					

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.



## NN (L) Euro Fixed Income

(ausgedrückt in EUR)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW	Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
1.200.000	ASB FINANCE LTD/LONDON 0.250% 21/05/2031 EMTN	EUR	1.085.804,56	0,09					
595.000	BNZ INTERNATIONAL FUNDING LTD/LONDON 0.375% 14/09/2024 GMTN	EUR	588.499,83	0,05					
220.000	BNZ INTERNATIONAL FUNDING LTD/LONDON 0.500% 13/05/2023 GMTN	EUR	220.828,96	0,02					
1.000.000	BNZ INTERNATIONAL FUNDING LTD/LONDON 0.625% 03/07/2025	EUR	990.302,73	0,08					
875.000	WESTPAC SECURITIES NZ LTD/LONDON 0.250% 06/04/2022 EMTN	EUR	875.033,87	0,07					
896.000	WESTPAC SECURITIES NZ LTD/LONDON 0.427% 14/12/2026 EMTN	EUR	854.917,58	0,07					
300.000	WESTPAC SECURITIES NZ LTD/LONDON 1.099% 24/03/2026 EMTN	EUR	297.578,34	0,03					
			<b>6.815.924,76</b>	<b>0,58</b>					
	<b>Australien</b>								
585.000	AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP LTD 0.250% 29/11/2022 GMTN	EUR	587.038,58	0,05					
515.000	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA 0.500% 27/07/2026 EMTN	EUR	503.720,09	0,04					
500.000	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA 0.875% 19/02/2029 EMTN	EUR	488.970,97	0,04					
162.124	LIBERTY FUNDING PTY LTD 2018-1 A1C 10/10/2049 FRN	EUR	161.206,83	0,01					
471.484	PEPPER RESIDENTIAL SECURITIES TRUST NO 22 22X A1GE 20/06/2060 FRN	EUR	459.547,50	0,04					
140.416	PEPPER RESIDENTIAL SECURITIES TRUST NO 25 25X A1GE 12/03/2061 FRN	EUR	137.627,09	0,01					
171.000	TOYOTA FINANCE AUSTRALIA LTD 2.280% 21/10/2027 EMTN	EUR	179.214,14	0,02					
1.600.000	TRANSURBAN FINANCE CO PTY LTD 1.875% 16/09/2024 EMTN	EUR	1.632.789,60	0,14					
1.000.000	TRANSURBAN FINANCE CO PTY LTD 3.000% 08/04/2030 EMTN	EUR	1.071.613,83	0,09					
816.000	WESTPAC BANKING CORP 0.375% 02/04/2026 EMTN	EUR	795.471,80	0,07					
300.000	WESTPAC BANKING CORP 0.375% 05/03/2023 EMTN	EUR	301.250,93	0,03					
465.000	WESTPAC BANKING CORP 13/05/2031 FRN	EUR	437.247,44	0,04					
			<b>6.755.698,80</b>	<b>0,58</b>					
	<b>Schweden</b>								
1.139.000	ALFA LAVAL TREASURY INTERNATIONAL AB 0.875% 18/02/2026	EUR	1.118.313,11	0,10					
1.130.000	ALFA LAVAL TREASURY INTERNATIONAL AB 1.375% 18/02/2029	EUR	1.107.525,61	0,09					
400.000	ESSITY AB 0.500% 03/02/2030	EUR	357.853,17	0,03					
291.000	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB 03/11/2031 FRN GMTN	EUR	272.724,61	0,02					
535.000	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB 0.375% 09/02/2026	EUR	523.806,53	0,04					
500.000	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB 31/10/2028 FRN GMTN	EUR	502.094,66	0,04					
200.000	SVENSKA HANDELSBANKEN AB 0.125% 18/06/2024 EMTN	EUR	197.749,42	0,02					
700.000	SVENSKA HANDELSBANKEN AB 05/03/2029 FRN EMTN	EUR	701.523,88	0,06					
385.000	SVENSKA HANDELSBANKEN AB 1.000% 15/04/2025 EMTN	EUR	385.857,24	0,03					
1.595.000	TELEFONAKTIEBOLAGET LM ERICSSON 1.000% 26/05/2029 EMTN	EUR	1.383.242,98	0,13					
			<b>6.550.691,21</b>	<b>0,56</b>					
	<b>Schweiz</b>								
200.000	CREDIT SUISSE AG/LONDON 1.500% 10/04/2026 EMTN	EUR	199.862,65	0,02					
219.000	CREDIT SUISSE GROUP AG 02/04/2026 FRN EMTN	EUR	225.781,90	0,02					
800.000	CREDIT SUISSE GROUP AG 13/10/2026 FRN	EUR	794.338,22	0,07					
400.000	CREDIT SUISSE GROUP AG 17/07/2025 FRN EMTN	EUR	394.228,59	0,03					
800.000	CREDIT SUISSE GROUP AG 24/06/2027 FRN EMTN	EUR	756.265,54	0,06					
700.000	UBS AG/LONDON 0.010% 31/03/2026 EMTN	EUR	667.827,76	0,06					
2.137.000	UBS AG/LONDON 0.500% 31/03/2031 EMTN	EUR	1.945.574,89	0,16					
200.000	UBS GROUP AG 03/11/2026 FRN	EUR	191.151,22	0,02					
200.000	UBS GROUP AG 0.875% 03/11/2031	EUR	183.981,14	0,02					
			<b>5.359.011,91</b>	<b>0,46</b>					
	<b>Norwegen</b>								
746.000	DNB BANK ASA 0.250% 09/04/2024	EUR	741.278,91	0,06					
1.052.000	DNB BOLIGKREDITT AS 0.010% 21/01/2031	EUR	946.560,33	0,08					
1.800.000	DNB BOLIGKREDITT AS 0.250% 07/09/2026 EMTN	EUR	1.742.798,43	0,15					
1.567.000	SPAREBANK 1 SR-BANK ASA 0.250% 09/11/2026 EMTN	EUR	1.488.869,63	0,13					
295.000	STATKRAFT AS 1.125% 20/03/2025 EMTN	EUR	295.350,83	0,03					
			<b>5.214.858,13</b>	<b>0,45</b>					
	<b>Polen</b>								
2.450.000	POLAND GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 1.500% 09/09/2025 EMTN	EUR	2.487.384,16	0,21					
2.400.000	POLAND GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 2.000% 08/03/2049 EMTN	EUR	2.343.861,19	0,20					
			<b>4.831.245,35</b>	<b>0,41</b>					
	<b>Portugal</b>								
400.000	BANCO COMERCIAL PORTUGUES SA 0.750% 31/05/2022	EUR	400.789,18	0,03					
1.900.000	BRISA-CONCESSAO RODOVIARIA SA 2.375% 10/05/2027 EMTN	EUR	1.975.994,93	0,17					
1.320.000	PORTUGAL OBRIGACOES DO TESOURO OT 4.100% 15/04/2037	EUR	1.758.606,01	0,15					
			<b>4.135.390,12</b>	<b>0,35</b>					
	<b>Singapur</b>								
500.000	DBS BANK LTD 0.375% 23/01/2024	EUR	499.042,86	0,04					
1.540.000	DBS GROUP HOLDINGS LTD 11/04/2028 FRN GMTN	EUR	1.550.484,55	0,13					
800.000	UNITED OVERSEAS BANK LTD 0.250% 11/09/2023 EMTN	EUR	799.952,22	0,07					
			<b>2.849.479,63</b>	<b>0,24</b>					
	<b>Island</b>								
900.000	ISLANDSBANKI HF 19/01/2024 FRN GMTN	EUR	902.636,46	0,08					
700.000	LANDSBANKINN HF 0.500% 20/05/2024 EMTN	EUR	684.731,42	0,06					
			<b>1.587.367,88</b>	<b>0,14</b>					
	<b>Jersey</b>								
300.000	EURO-DM SECURITIES LTD ZCP 08/04/2026	DEM	145.441,74	0,01					
550.000	GLENCORE FINANCE EUROPE LTD 1.750% 17/03/2025 EMTN	EUR	549.708,25	0,05					
			<b>695.149,99</b>	<b>0,06</b>					
	<b>Südkorea</b>								
642.000	KOOKMIN BANK 0.048% 19/10/2026	EUR	612.142,25	0,05					
			<b>612.142,25</b>	<b>0,05</b>					
	<b>Kaimaninseln</b>								
360.000	XLIT LTD 29/06/2047 FRN	EUR	369.893,78	0,03					
			<b>369.893,78</b>	<b>0,03</b>					
	<b>Israel</b>								
100.000	ISRAEL GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 1.500% 18/01/2027 EMTN	EUR	101.836,65	0,01					
250.000	ISRAEL GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 2.875% 29/01/2024 EMTN	EUR	260.010,73	0,02					
			<b>361.847,38</b>	<b>0,03</b>					
	<b>Litauen</b>								
300.000	LITHUANIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 2.125% 22/10/2035 EMTN	EUR	322.520,36	0,04					
			<b>322.520,36</b>	<b>0,04</b>					

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Euro Fixed Income

(ausgedrückt in EUR)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
<b>Guernsey</b>				
300.000	CREDIT SUISSE GROUP FUNDING GUERNSEY LTD 1.250% 14/04/2022 EMTN	EUR	300.127,56	0,03
			<b>300.127,56</b>	<b>0,03</b>
<b>Dänemark</b>				
300.000	JYSKE REALKREDIT AS 0.500% 01/10/2026	EUR	293.410,57	0,03
			<b>293.410,57</b>	<b>0,03</b>
<b>Tschechische Republik</b>				
200.000	EP INFRASTRUCTURE AS 2.045% 09/10/2028	EUR	162.968,98	0,02
			<b>162.968,98</b>	<b>0,02</b>
			<b>1.049.097.920,64</b>	<b>89,83</b>
<b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>				
<b>Anleihen und andere Schuldtitel</b>				
<b>Supranational-Multinational</b>				
400.000	INTERNATIONAL BANK FOR RECONSTRUCTION & DEVELOPMENT 0.500% 20/12/2022 EMTN	EUR	401.971,16	0,03
			<b>401.971,16</b>	<b>0,03</b>
			<b>401.971,16</b>	<b>0,03</b>
<b>Organismen für gemeinsame Anlagen</b>				
<b>Offene Fonds</b>				
<b>Luxemburg</b>				
10.274	NN (L) AAA ABS - Z CAP EUR	EUR	53.312.299,70	4,56
4.964	NN (L) EUROPEAN ABS - Z CAP EUR	EUR	27.052.509,36	2,32
7.620	NN (L) LIQUID EUR - Z CAP EUR	EUR	7.526.226,74	0,64
			<b>87.891.035,80</b>	<b>7,52</b>
			<b>87.891.035,80</b>	<b>7,52</b>

**Wertpapierbestand Gesamt 1.137.390.927,60 97,38**

### Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022

Bezeichnung	Verkauf/ Kauf	Zinssatz (%)	Fälligkeits- datum	Währung	Nennwert	Swap-Wert in EUR
<b>Credit Default Swap</b>						
CDX ITRAXX EUROPE SERIES 37 VERSION 1	Kauf	1,000	20/06/2027	EUR	299.016.906,00	(4.086.562,39)
						<b>(4.086.562,39)</b>
Zu erhalten (%)	Zu zahlen (%)	Fälligkeits- datum	Währung	Nennwert	Swap-Wert in EUR	
<b>Zinsswaps</b>						
Floating	0,601	21/03/2072	EUR	21.000.000,00	1.369.161,99	
Floating	0,633	18/03/2072	EUR	24.200.472,00	1.278.693,17	
Floating	0,144	05/11/2071	EUR	4.360.469,00	1.070.550,95	
Floating	0,166	05/11/2071	EUR	4.360.469,00	1.032.899,04	
Floating	0,173	05/11/2071	EUR	4.360.469,00	1.020.918,92	

Zu erhalten (%)	Zu zahlen (%)	Fälligkeits- datum	Währung	Nennwert	Swap-Wert in EUR
Floating	0,174	05/11/2071	EUR	4.360.469,00	1.019.207,48
Floating	0,651	21/03/2072	EUR	19.069.528,00	866.649,79
1,456	Floating	03/11/2035	EUR	6.600.000,00	154.470,29
1,539	Floating	01/08/2037	EUR	3.400.000,00	125.549,18
0,960	Floating	27/11/2024	EUR	10.000.000,00	61.531,60
0,503	Floating	13/03/2024	EUR	13.700.000,00	3.230,60
0,570	Floating	01/08/2024	EUR	8.500.000,00	(11.663,87)
0,196	Floating	02/11/2023	EUR	10.000.000,00	(18.065,30)
1,068	Floating	11/02/2036	EUR	3.100.000,00	(82.116,89)
0,525	Floating	13/05/2026	EUR	10.545.000,00	(171.880,86)
0,726	Floating	11/08/2036	EUR	3.900.000,00	(286.219,79)
1,154	Floating	21/03/2042	EUR	46.838.484,00	(610.359,31)
1,151	Floating	18/03/2042	EUR	56.471.516,00	(770.770,69)
0,062	Floating	24/10/2029	EUR	12.000.000,00	(902.682,24)
1,120	Floating	21/03/2042	EUR	53.200.000,00	(1.016.542,41)
0,277	Floating	02/08/2051	EUR	7.700.000,00	(1.445.451,70)
-0,030	Floating	08/11/2028	EUR	20.900.000,00	(1.451.255,45)
-0,046	Floating	17/10/2029	EUR	25.400.000,00	(2.106.433,43)
0,375	Floating	14/01/2032	EUR	42.729.004,00	(3.192.198,00)
0,369	Floating	14/01/2032	EUR	42.930.996,00	(3.231.365,41)
0,256	Floating	29/10/2031	EUR	123.020.000,00	(10.297.946,38)
					<b>(17.592.088,72)</b>

Stückzahl	Bezeichnung	Fälligkeits- datum	Währung	Nennwert	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR
<b>Total Return Swap</b>					

248.568	TRS BARCLAYS EURO AGGREGATE BOND INDEX	17/05/2022	EUR	67.000.000,00	(4.105.591,06)
					<b>(4.105.591,06)</b>

Zu erhalten (%)	Zu zahlen (%)	Fälligkeits- datum	Währung	Nennwert	Swap-Wert in EUR

### Inflationsswaps

2.541	Floating	15/03/2032	EUR	33.701.629,00	(725.364,88)
2.503	Floating	15/03/2032	EUR	34.343.565,00	(888.258,53)
2.500	Floating	15/03/2032	EUR	34.224.806,00	(894.816,45)
					<b>(2.508.439,86)</b>

Stückzahl	Bezeichnung	Währung	Engagement in EUR	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR
<b>Zins-Futures</b>				

(57)	EURO-BOBL FUTURE 08/06/2022	EUR	7.345.020,00	265.620,00
116	EURO-BTP FUTURE 08/06/2022	EUR	16.043.960,00	(829.992,08)
202	EURO-BUND FUTURE 08/06/2022	EUR	32.049.320,00	(1.785.277,16)
(292)	EURO-BUXL 30Y BOND 08/06/2022	EUR	54.370.400,00	4.347.606,46

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Euro Fixed Income

(ausgedrückt in EUR)

### Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl	Bezeichnung	Währung	Engagement in EUR	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR
(1.567)	EURO-OAT FUTURE 08/06/2022	EUR	237.416.170,00	11.474.284,12
			<b>347.224.870,00</b>	<b>13.472.241,34</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>			<b>(14.820.440,69)</b>	

### Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick

		% NIW
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	<b>1.137.390.927,60</b>	<b>97,38</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	<b>(14.820.440,69)</b>	<b>(1,27)</b>
<b>Bankverbindlichkeiten</b>	<b>(623.220,91)</b>	<b>(0,05)</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>	<b>46.104.078,11</b>	<b>3,94</b>
<b>Nettovermögen Gesamt</b>	<b>1.168.051.344,11</b>	<b>100,00</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Euro High Dividend

(ausgedrückt in EUR)

### Statistische Angaben

<b>Nettovermögen</b>	31.03.2022	EUR	655.315.559,40	Distribution I (EUR)	31.03.2022	EUR	554,39
	30.09.2021	EUR	754.916.345,16		30.09.2021	EUR	567,54
	30.09.2020	EUR	547.488.734,49		30.09.2020	EUR	445,81
<b>Nettoinventarwert pro Anteil**</b>				Distribution N (EUR)	31.03.2022	EUR	1.463,77
					30.09.2021	EUR	1.499,27
					30.09.2020	EUR	1.178,76
Capitalisation I (EUR)	31.03.2022	EUR	800,54	Distribution P (EUR)	31.03.2022	EUR	1.355,97
	30.09.2021	EUR	800,67		30.09.2021	EUR	1.395,27
	30.09.2020	EUR	612,06		30.09.2020	EUR	1.107,02
Capitalisation N (EUR)	31.03.2022	EUR	725,92	Distribution R (EUR)	31.03.2022	EUR	320,86
	30.09.2021	EUR	726,36		30.09.2021	EUR	328,88
	30.09.2020	EUR	555,72		30.09.2020	EUR	258,96
Capitalisation P (EUR)	31.03.2022	EUR	672,65	Distribution X (M) (EUR)	31.03.2022	EUR	299,67
	30.09.2021	EUR	676,09		30.09.2021	EUR	306,03
	30.09.2020	EUR	521,97		30.09.2020	EUR	244,68
Capitalisation P (USD)	31.03.2022	USD	135,90	Distribution X (M) Hedged (i) (AUD)	31.03.2022	AUD	314,01
	30.09.2021	USD	142,28		30.09.2021	AUD	319,12
	30.09.2020	USD	111,14		30.09.2020	AUD	253,94
Capitalisation P Hedged (i) (CHF)	31.03.2022	CHF	325,96	Distribution X (M) Hedged (i) (USD)	31.03.2022	USD	326,10
	30.09.2021	CHF	327,00		30.09.2021	USD	329,25
	30.09.2020	CHF	252,49		30.09.2020	USD	259,27
Capitalisation P Hedged (i) (USD)	31.03.2022	USD	410,03	Distribution Y (M) (EUR)	31.03.2022	EUR	261,48
	30.09.2021	USD	408,45		30.09.2021	EUR	268,60
	30.09.2020	USD	311,79		30.09.2020	EUR	217,25
Capitalisation R (EUR)	31.03.2022	EUR	387,04	Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD)	31.03.2022	AUD	276,26
	30.09.2021	EUR	387,57		30.09.2021	AUD	282,33
	30.09.2020	EUR	296,99		30.09.2020	AUD	227,26
Capitalisation R Hedged (i) (CHF)	31.03.2022	CHF	380,96	Distribution Y (M) Hedged (i) (USD)	31.03.2022	USD	302,80
	30.09.2021	CHF	381,07		30.09.2021	USD	307,26
	30.09.2020	CHF	292,16		30.09.2020	USD	244,51
Capitalisation R Hedged (i) (USD)	31.03.2022	USD	440,03	<b>Anzahl der Anteile</b>			
	30.09.2021	USD	436,26				
	30.09.2020	USD	330,77				
Capitalisation U (EUR)	31.03.2022	EUR	8.483,64	Capitalisation I (EUR)	31.03.2022		355.819
	30.09.2021	EUR	8.479,91		30.09.2021		391.599
	30.09.2020	EUR	6.474,50		30.09.2020		354.741
Capitalisation V (EUR)	31.03.2022	EUR	276,87	Capitalisation N (EUR)	31.03.2022		463
	30.09.2021	EUR	278,16		30.09.2021		440
	30.09.2020	EUR	214,55		30.09.2020		751
Capitalisation X (EUR)	31.03.2022	EUR	605,56	Capitalisation P (EUR)	31.03.2022		169.884
	30.09.2021	EUR	610,18		30.09.2021		171.176
	30.09.2020	EUR	473,44		30.09.2020		200.180
Capitalisation Z (EUR)	31.03.2022	EUR	4.835,25	Capitalisation P (USD)	31.03.2022		2.308
	30.09.2021	EUR	-		30.09.2021		1.725
	30.09.2020	EUR	-		30.09.2020		3.329

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

## NN (L) Euro High Dividend

(ausgedrückt in EUR)

### Statistische Angaben (Fortsetzung)

#### Anzahl der Anteile

Capitalisation P Hedged (i) (CHF)	31.03.2022	82
	30.09.2021	20
	30.09.2020	58
Capitalisation P Hedged (i) (USD)	31.03.2022	9.406
	30.09.2021	9.790
	30.09.2020	25.489
Capitalisation R (EUR)	31.03.2022	45.953
	30.09.2021	41.859
	30.09.2020	34.942
Capitalisation R Hedged (i) (CHF)	31.03.2022	4.539
	30.09.2021	4.127
	30.09.2020	4.430
Capitalisation R Hedged (i) (USD)	31.03.2022	32.133
	30.09.2021	22.824
	30.09.2020	15.469
Capitalisation U (EUR)	31.03.2022	363
	30.09.2021	427
	30.09.2020	672
Capitalisation V (EUR)	31.03.2022	312.565
	30.09.2021	594.251
	30.09.2020	503.067
Capitalisation X (EUR)	31.03.2022	45.200
	30.09.2021	45.043
	30.09.2020	51.736
Capitalisation Z (EUR)	31.03.2022	2.342
	30.09.2021	-
	30.09.2020	-
Distribution I (EUR)	31.03.2022	31.042
	30.09.2021	31.988
	30.09.2020	49.914
Distribution N (EUR)	31.03.2022	941
	30.09.2021	718
	30.09.2020	641
Distribution P (EUR)	31.03.2022	19.275
	30.09.2021	18.916
	30.09.2020	21.638
Distribution R (EUR)	31.03.2022	16.184
	30.09.2021	13.759
	30.09.2020	9.603
Distribution X (M) (EUR)	31.03.2022	7.763
	30.09.2021	7.896
	30.09.2020	8.315

#### Anzahl der Anteile

Distribution X (M) Hedged (i) (AUD)	31.03.2022	17.415
	30.09.2021	15.654
	30.09.2020	16.498
Distribution X (M) Hedged (i) (USD)	31.03.2022	22.491
	30.09.2021	31.891
	30.09.2020	25.532
Distribution Y (M) (EUR)	31.03.2022	22.473
	30.09.2021	22.876
	30.09.2020	22.116
Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD)	31.03.2022	24.431
	30.09.2021	19.494
	30.09.2020	1.329
Distribution Y (M) Hedged (i) (USD)	31.03.2022	68.479
	30.09.2021	93.061
	30.09.2020	4.604

#### Dividende

Distribution I (EUR)	14.12.2021	EUR	13,45
Distribution N (EUR)	14.12.2021	EUR	35,60
Distribution P (EUR)	14.12.2021	EUR	33,25
Distribution R (EUR)	14.12.2021	EUR	7,80
Distribution X (M) (EUR)	02.03.2022	EUR	0,70
Distribution X (M) (EUR)	07.02.2022	EUR	0,70
Distribution X (M) (EUR)	04.01.2022	EUR	0,70
Distribution X (M) (EUR)	02.12.2021	EUR	0,70
Distribution X (M) (EUR)	02.11.2021	EUR	0,70
Distribution X (M) (EUR)	04.10.2021	EUR	0,70
Distribution X (M) Hedged (i) (AUD)	02.03.2022	AUD	0,67
Distribution X (M) Hedged (i) (AUD)	07.02.2022	AUD	0,67
Distribution X (M) Hedged (i) (AUD)	04.01.2022	AUD	0,67
Distribution X (M) Hedged (i) (AUD)	02.12.2021	AUD	0,67
Distribution X (M) Hedged (i) (AUD)	02.11.2021	AUD	0,67
Distribution X (M) Hedged (i) (AUD)	04.10.2021	AUD	0,67

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

## NN (L) Euro High Dividend

(ausgedrückt in EUR)

### Statistische Angaben (Fortsetzung)

				Laufende Kosten in %*		
Distribution X (M) Hedged (i) (USD)	02.03.2022	USD	0,65	Capitalisation I (EUR)	31.03.2022	0,81%
Distribution X (M) Hedged (i) (USD)	07.02.2022	USD	0,65	Capitalisation N (EUR)	31.03.2022	0,90%
Distribution X (M) Hedged (i) (USD)	04.01.2022	USD	0,65	Capitalisation P (EUR)	31.03.2022	1,80%
Distribution X (M) Hedged (i) (USD)	02.12.2021	USD	0,65	Capitalisation P (USD)	31.03.2022	1,79%
Distribution X (M) Hedged (i) (USD)	02.11.2021	USD	0,65	Capitalisation P Hedged (i) (CHF)	31.03.2022	1,82%
Distribution X (M) Hedged (i) (USD)	04.10.2021	USD	0,65	Capitalisation P Hedged (i) (USD)	31.03.2022	1,82%
Distribution Y (M) (EUR)	02.03.2022	EUR	0,65	Capitalisation R (EUR)	31.03.2022	1,05%
Distribution Y (M) (EUR)	07.02.2022	EUR	0,65	Capitalisation R Hedged (i) (CHF)	31.03.2022	1,07%
Distribution Y (M) (EUR)	04.01.2022	EUR	0,65	Capitalisation R Hedged (i) (USD)	31.03.2022	1,07%
Distribution Y (M) (EUR)	02.12.2021	EUR	0,65	Capitalisation U (EUR)	31.03.2022	0,69%
Distribution Y (M) (EUR)	02.11.2021	EUR	0,65	Capitalisation V (EUR)	31.03.2022	1,71%
Distribution Y (M) (EUR)	04.10.2021	EUR	0,65	Capitalisation X (EUR)	31.03.2022	2,30%
Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD)	02.03.2022	AUD	0,62	Capitalisation Z (EUR)	31.03.2022	0,21%
Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD)	07.02.2022	AUD	0,62	Distribution I (EUR)	31.03.2022	0,81%
Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD)	04.01.2022	AUD	0,62	Distribution N (EUR)	31.03.2022	0,90%
Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD)	02.12.2021	AUD	0,62	Distribution P (EUR)	31.03.2022	1,80%
Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD)	02.11.2021	AUD	0,62	Distribution R (EUR)	31.03.2022	1,06%
Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD)	04.10.2021	AUD	0,62	Distribution X (M) (EUR)	31.03.2022	2,30%
Distribution Y (M) Hedged (i) (USD)	02.03.2022	USD	0,64	Distribution X (M) Hedged (i) (AUD)	31.03.2022	2,32%
Distribution Y (M) Hedged (i) (USD)	07.02.2022	USD	0,64	Distribution X (M) Hedged (i) (USD)	31.03.2022	2,32%
Distribution Y (M) Hedged (i) (USD)	04.01.2022	USD	0,64	Distribution Y (M) (EUR)	31.03.2022	3,31%
Distribution Y (M) Hedged (i) (USD)	02.12.2021	USD	0,64	Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD)	31.03.2022	3,33%
Distribution Y (M) Hedged (i) (USD)	02.11.2021	USD	0,64	Distribution Y (M) Hedged (i) (USD)	31.03.2022	3,33%
Distribution Y (M) Hedged (i) (USD)	04.10.2021	USD	0,64	<b>Portfolioumsatz in %*</b>	31.03.2022	242,81%

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

## NN (L) Euro High Dividend

(ausgedrückt in EUR)

### Finanzabschlüsse

#### Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022

	Erläuterungen	
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	2	<b>631.506.496,89</b>
Aktien		631.506.496,89
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	2	<b>519.236,53</b>
Devisentermingeschäfte		519.236,53
<b>Bankguthaben</b>		<b>27.320.392,23</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte</b>	4	<b>14.343.219,61</b>
<b>Vermögenswerte Gesamt</b>		<b>673.689.345,26</b>
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>	4, 12	<b>(18.373.785,86)</b>
<b>Verbindlichkeiten Gesamt</b>		<b>(18.373.785,86)</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Berichtszeitraums</b>		<b>655.315.559,40</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Euro High Dividend

(ausgedrückt in EUR)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
<b>Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>				
<b>Aktien</b>				
<b>Frankreich</b>				
500.972	BNP PARIBAS SA	EUR	26.015.475,96	3,97
102.770	CAPGEMINI SE	EUR	20.810.925,00	3,18
118.151	CIE GENERALE DES ETABLISSEMENTS MICHELIN SCA	EUR	14.526.665,45	2,22
140.124	COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	EUR	7.604.529,48	1,16
1.513.061	ENGIE SA	EUR	18.056.869,97	2,75
117.068	FAURECIA SE	EUR	2.768.658,20	0,42
24.535	KERING SA	EUR	14.124.799,50	2,16
32.744	L'OREAL SA	EUR	11.913.904,40	1,82
50.360	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	EUR	32.703.784,00	4,99
123.344	PERNOD RICARD SA	EUR	24.582.459,20	3,75
154.797	REXEL SA	EUR	3.007.705,71	0,46
266.705	SANOFI	EUR	24.672.879,55	3,77
731.232	TOTALENERGIES SE	EUR	33.658.608,96	5,13
182.865	VINCI SA	EUR	17.004.616,35	2,59
			<b>251.451.881,73</b>	<b>38,37</b>
<b>Deutschland</b>				
113.630	ALLIANZ SE - REG	EUR	24.606.576,50	3,75
61.518	COVESTRO AG	EUR	2.819.985,12	0,43
190.259	DAIMLER TRUCK HOLDING AG	EUR	4.800.234,57	0,73
127.221	DEUTSCHE BOERSE AG	EUR	20.737.023,00	3,16
288.373	DEUTSCHE POST AG - REG	EUR	12.558.644,15	1,92
1.321.158	DEUTSCHE TELEKOM AG - REG	EUR	22.369.847,26	3,40
1.184.945	E.ON SE	EUR	12.491.690,19	1,91
124.198	EVONIK INDUSTRIES AG	EUR	3.127.305,64	0,48
88.543	LEG IMMOBILIEN SE	EUR	9.142.064,75	1,40
36.128	MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGSGESELLSCHAFT AG IN MUENCHEN - REG	EUR	8.779.104,00	1,34
281.668	SAP SE	EUR	28.482.268,16	4,35
178.667	SIEMENS AG - REG	EUR	22.451.295,22	3,43
186.281	SIEMENS HEALTHINEERS AG	EUR	10.476.443,44	1,60
83.934	STROEER SE & CO KGAA	EUR	5.254.268,40	0,80
			<b>188.096.750,40</b>	<b>28,70</b>
<b>Niederlande</b>				
1.131.768	AEGON NV	EUR	5.434.749,94	0,83
166.250	AIRBUS SE	EUR	18.347.350,00	2,80
37.911	ASML HOLDING NV	EUR	23.125.710,00	3,53
144.771	HEINEKEN NV	EUR	12.534.273,18	1,91
400.549	KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	EUR	11.661.984,14	1,78
787.609	STELLANTIS NV	EUR	11.655.037,98	1,78
			<b>82.759.105,24</b>	<b>12,63</b>
<b>Spanien</b>				
2.863.777	IBERDROLA SA	EUR	28.408.667,84	4,34
			<b>28.408.667,84</b>	<b>4,34</b>
<b>Finnland</b>				
1.730.226	NORDEA BANK ABP	EUR	16.229.519,88	2,48
307.264	UPM-KYMMENE OYJ	EUR	9.113.450,24	1,39
			<b>25.342.970,12</b>	<b>3,87</b>

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
<b>Irland</b>				
303.160	CRH PLC	EUR	11.019.866,00	1,68
286.975	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	EUR	11.608.138,75	1,77
			<b>22.628.004,75</b>	<b>3,45</b>
<b>Vereinigtes Königreich</b>				
742.723	SHELL PLC	EUR	18.534.652,47	2,83
			<b>18.534.652,47</b>	<b>2,83</b>
<b>Belgien</b>				
110.229	UCB SA	EUR	11.954.335,05	1,82
			<b>11.954.335,05</b>	<b>1,82</b>
<b>Luxemburg</b>				
57.949	APERAM SA	EUR	2.330.129,29	0,36
			<b>2.330.129,29</b>	<b>0,36</b>
			<b>631.506.496,89</b>	<b>96,37</b>
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>			<b>631.506.496,89</b>	<b>96,37</b>

### Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022

Zu erhalten	Zu zahlen	Fälligkeits- datum	Engagement in EUR	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR	
<b>Devisentermingeschäfte</b>					
13.906.354,35	AUD	9.066.287,61	EUR 19/04/2022	9.066.287,61	316.945,10
53.406.446,39	USD	47.868.773,80	EUR 19/04/2022	47.868.773,80	109.721,48
6.773.419,21	EUR	7.419.080,29	USD 19/04/2022	6.773.419,21	108.375,33
1.921.302,30	CHF	1.874.048,47	EUR 19/04/2022	1.874.048,47	2.494,53
168.245,91	EUR	170.256,88	CHF 19/04/2022	168.245,91	1.955,39
8.614,03	EUR	12.745,32	AUD 01/04/2022	8.614,03	11,96
204.597,48	USD	184.280,55	EUR 01/04/2022	184.280,55	(397,50)
126.952,30	EUR	141.735,90	USD 04/04/2022	126.952,30	(433,58)
1.134.145,72	EUR	1.709.657,98	AUD 19/04/2022	1.134.145,72	(19.436,18)
				<b>67.204.767,60</b>	<b>519.236,53</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>				<b>519.236,53</b>	

### Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick

		% NIW
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	<b>631.506.496,89</b>	<b>96,37</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	<b>519.236,53</b>	<b>0,08</b>
<b>Bankguthaben</b>	<b>27.320.392,23</b>	<b>4,17</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>	<b>(4.030.566,25)</b>	<b>(0,62)</b>
<b>Nettovermögen Gesamt</b>	<b>655.315.559,40</b>	<b>100,00</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.



## NN (L) Euro Income

(ausgedrückt in EUR)

### Statistische Angaben

<b>Nettovermögen</b>	31.03.2022	EUR	30.019.045,74	<b>Anzahl der Anteile</b>			
	30.09.2021	EUR	35.129.220,87				
	30.09.2020	EUR	37.441.683,20		Distribution R (EUR)	31.03.2022	644
<b>Nettoinventarwert pro Anteil**</b>					30.09.2021	644	
					30.09.2020	1.225	
				Distribution X (EUR)	31.03.2022	1.006	
Capitalisation P (EUR)	31.03.2022	EUR	366,63		30.09.2021	1.194	
	30.09.2021	EUR	385,17		30.09.2020	1.212	
	30.09.2020	EUR	300,14				
Capitalisation R (EUR)	31.03.2022	EUR	264,85	<b>Dividende</b>			
	30.09.2021	EUR	277,20	Distribution P (EUR)	14.12.2021	EUR	8,20
	30.09.2020	EUR	214,39				
Capitalisation X (EUR)	31.03.2022	EUR	1.363,01	Distribution P (Q) (EUR)	28.03.2022	EUR	2,33
	30.09.2021	EUR	1.435,50				
	30.09.2020	EUR	1.124,23	Distribution P (Q) (EUR)	28.12.2021	EUR	2,24
Distribution P (EUR)	31.03.2022	EUR	113,42				
	30.09.2021	EUR	127,17	Distribution R (EUR)	14.12.2021	EUR	15,35
	30.09.2020	EUR	107,02				
Distribution P (Q) (EUR)	31.03.2022	EUR	117,71	Distribution X (EUR)	14.12.2021	EUR	31,55
	30.09.2021	EUR	128,22				
	30.09.2020	EUR	106,73	<b>Laufende Kosten in %*</b>			
Distribution R (EUR)	31.03.2022	EUR	190,69	Capitalisation P (EUR)	31.03.2022		1,80%
	30.09.2021	EUR	214,56				
	30.09.2020	EUR	180,68	Capitalisation R (EUR)	31.03.2022		1,05%
Distribution X (EUR)	31.03.2022	EUR	470,62				
	30.09.2021	EUR	526,53	Capitalisation X (EUR)	31.03.2022		2,30%
	30.09.2020	EUR	442,71				
<b>Anzahl der Anteile</b>				Distribution P (EUR)	31.03.2022		1,80%
Capitalisation P (EUR)	31.03.2022		40.850				
	30.09.2021		43.670	Distribution P (Q) (EUR)	31.03.2022		1,80%
	30.09.2020		56.985				
Capitalisation R (EUR)	31.03.2022		713	Distribution R (EUR)	31.03.2022		1,05%
	30.09.2021		713				
	30.09.2020		998	Distribution X (EUR)	31.03.2022		2,30%
Capitalisation X (EUR)	31.03.2022		861	<b>Portfolioumsatz in %*</b>	31.03.2022		138,67%
	30.09.2021		889				
	30.09.2020		947				
Distribution P (EUR)	31.03.2022		114.351				
	30.09.2021		125.377				
	30.09.2020		170.037				
Distribution P (Q) (EUR)	31.03.2022		972				
	30.09.2021		972				
	30.09.2020		972				

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

## NN (L) Euro Income

(ausgedrückt in EUR)

### Finanzabschlüsse

#### Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022

	Erläuterungen	
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	2	<b>29.940.487,09</b>
Aktien		29.530.670,41
Organismen für gemeinsame Anlagen		409.816,68
<b>Bankguthaben</b>		<b>114.828,27</b>
<b>Hinterlegte Sicherheiten</b>		<b>147.777,02</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte</b>	4	<b>58.409,19</b>
<b>Vermögenswerte Gesamt</b>		<b>30.261.501,57</b>
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>	4	<b>(126.519,41)</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	2	<b>(115.936,42)</b>
Optionen		(112.741,42)
Futures		(3.195,00)
<b>Verbindlichkeiten Gesamt</b>		<b>(242.455,83)</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Berichtszeitraums</b>		<b>30.019.045,74</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Euro Income

(ausgedrückt in EUR)

## Wertpapierbestand zum 31.03.2022

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
<b>Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>				
<b>Aktien</b>				
<b>Frankreich</b>				
5.235	AIR LIQUIDE SA	EUR	831.946,20	2,77
9.554	AMUNDI SA	EUR	594.258,80	1,98
10.560	BNP PARIBAS SA	EUR	548.380,80	1,83
3.957	CAPGEMINI SE	EUR	801.292,50	2,67
1.949	CIE GENERALE DES ETABLISSEMENTS MICHELIN SCA	EUR	239.629,55	0,80
16.801	COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	EUR	911.790,27	3,04
7.634	EIFPAGE SA	EUR	711.794,16	2,37
26.236	ENGIE SA	EUR	313.100,42	1,04
1.540	KERING SA	EUR	886.578,00	2,95
2.282	L'OREAL SA	EUR	830.305,70	2,77
3.139	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	EUR	2.038.466,60	6,79
10.322	PUBLICIS GROUPE SA	EUR	570.393,72	1,90
19.730	REXEL SA	EUR	383.353,90	1,28
14.871	SANOFI	EUR	1.375.716,21	4,58
17.084	TOTALENERGIES SE	EUR	786.376,52	2,62
11.782	VEOLIA ENVIRONNEMENT SA	EUR	342.738,38	1,14
419	VINCI SA	EUR	38.962,81	0,13
			<b>12.205.084,54</b>	<b>40,66</b>
<b>Deutschland</b>				
5.331	ALLIANZ SE - REG	EUR	1.154.428,05	3,85
11.125	COVESTRO AG	EUR	509.970,00	1,70
7.459	DAIMLER TRUCK HOLDING AG	EUR	188.190,57	0,63
19.597	DEUTSCHE POST AG - REG	EUR	853.449,35	2,84
25.746	DEUTSCHE TELEKOM AG - REG	EUR	435.931,27	1,46
7.305	INFINEON TECHNOLOGIES AG	EUR	226.345,43	0,75
1.724	LEG IMMOBILIEN SE	EUR	178.003,00	0,59
7.537	MERCEDES-BENZ GROUP AG	EUR	480.935,97	1,60
13.573	SAP SE	EUR	1.372.501,76	4,57
8.919	SIEMENS AG - REG	EUR	1.120.761,54	3,73
8.125	SIEMENS HEALTHINEERS AG	EUR	456.950,00	1,52
			<b>6.977.466,94</b>	<b>23,24</b>
<b>Niederlande</b>				
142.311	AEGON NV	EUR	683.377,42	2,27
4.406	AIRBUS SE	EUR	486.246,16	1,62
4.344	ASML HOLDING NV	EUR	2.649.840,00	8,83
3.598	ASR NEDERLAND NV	EUR	151.943,54	0,51
33.541	ING GROEP NV	EUR	319.008,45	1,06
32.860	KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	EUR	956.718,90	3,19
30.041	STELLANTIS NV	EUR	444.546,72	1,48
			<b>5.691.681,19</b>	<b>18,96</b>
<b>Italien</b>				
71.774	ENI SPA	EUR	954.163,56	3,18
232.840	INTESA SANPAOLO SPA	EUR	485.122,14	1,61
			<b>1.439.285,70</b>	<b>4,79</b>
<b>Spanien</b>				
229.750	BANCO SANTANDER SA	EUR	712.225,00	2,37
1.520	ENDESA SA	EUR	30.058,00	0,10
17.741	IBERDROLA SA	EUR	175.990,72	0,59

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
7.292	INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL SA	EUR	144.235,76	0,48
			<b>1.062.509,48</b>	<b>3,54</b>
<b>Irland</b>				
15.727	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	EUR	636.157,15	2,12
			<b>636.157,15</b>	<b>2,12</b>
<b>Luxemburg</b>				
6.698	APERAM SA	EUR	269.326,58	0,90
23.884	TENARIS SA	EUR	328.524,42	1,09
			<b>597.851,00</b>	<b>1,99</b>
<b>Österreich</b>				
6.179	ERSTE GROUP BANK AG	EUR	204.463,11	0,69
3.140	OMV AG	EUR	136.244,60	0,45
3.994	WIENERBERGER AG	EUR	109.435,60	0,37
			<b>450.143,31</b>	<b>1,51</b>
<b>Finnland</b>				
6.216	KESKO OYJ - B	EUR	155.462,16	0,52
9.009	STORA ENSO OYJ - R	EUR	160.495,34	0,53
			<b>315.957,50</b>	<b>1,05</b>
<b>Belgien</b>				
468	SOFINA SA	EUR	154.533,60	0,51
			<b>154.533,60</b>	<b>0,51</b>
			<b>29.530.670,41</b>	<b>98,37</b>

## Organismen für gemeinsame Anlagen

### Offene Fonds

<b>Luxemburg</b>				
415	NN (L) LIQUID EUR - Z CAP EUR	EUR	409.816,68	1,37
			<b>409.816,68</b>	<b>1,37</b>
			<b>409.816,68</b>	<b>1,37</b>
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>			<b>29.940.487,09</b>	<b>99,74</b>

## Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022

Stückzahl	Bezeichnung	Währung	Engagement in EUR	Marktwert in EUR
<b>Optionen</b>				
(200)	CALL EURO STOXX 50 INDEX 13/04/2022 3824.00	EUR	780.504,00	(17.216,68)
(200)	CALL EURO STOXX 50 INDEX 07/04/2022 3824.00	EUR	780.504,00	(27.045,16)
(300)	CALL EURO STOXX 50 INDEX 20/04/2022 3865.00	EUR	1.170.756,00	(32.977,23)
(200)	CALL EURO STOXX 50 INDEX 06/04/2022 3824.00	EUR	780.504,00	(35.502,35)
			<b>3.512.268,00</b>	<b>(112.741,42)</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Euro Income

(ausgedrückt in EUR)

### Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl	Bezeichnung	Währung	Engagement in EUR	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR
<b>Future auf Aktienindizes</b>				
22	EURO STOXX 50 17/06/2022	EUR	841.060,00	(3.195,00)
			<b>841.060,00</b>	<b>(3.195,00)</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>				<b>(115.936,42)</b>

### Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick

		%
		NIW
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	<b>29.940.487,09</b>	<b>99,74</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	<b>(115.936,42)</b>	<b>(0,39)</b>
<b>Bankguthaben</b>	<b>114.828,27</b>	<b>0,38</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>	<b>79.666,80</b>	<b>0,27</b>
<b>Nettovermögen Gesamt</b>	<b>30.019.045,74</b>	<b>100,00</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Euro Liquidity

(ausgedrückt in EUR)

### Statistische Angaben

<b>Nettovermögen</b>	31.03.2022	EUR	45.693.062,84	<b>Anzahl der Anteile</b>			
	30.09.2021	EUR	50.894.213,86				
	30.09.2020	EUR	66.249.710,57				
<b>Nettoinventarwert pro Anteil**</b>				Capitalisation R (EUR)	31.03.2022	15.094	
					30.09.2021	16.500	
					30.09.2020	24.282	
Capitalisation I (EUR)	31.03.2022	EUR	-	Capitalisation S (EUR)	31.03.2022	63	
	30.09.2021	EUR	4.868,65		30.09.2021	63	
	30.09.2020	EUR	4.897,29		30.09.2020	73	
Capitalisation N (EUR)	31.03.2022	EUR	252,00	Capitalisation X (EUR)	31.03.2022	29.720	
	30.09.2021	EUR	252,89		30.09.2021	25.915	
	30.09.2020	EUR	254,45		30.09.2020	39.029	
Capitalisation P (EUR)	31.03.2022	EUR	252,25	Distribution N (EUR)	31.03.2022	30	
	30.09.2021	EUR	253,14		30.09.2021	38	
	30.09.2020	EUR	254,71		30.09.2020	59	
Capitalisation R (EUR)	31.03.2022	EUR	252,25	Distribution P (EUR)	31.03.2022	703	
	30.09.2021	EUR	253,14		30.09.2021	723	
	30.09.2020	EUR	254,70		30.09.2020	1.876	
Capitalisation S (EUR)	31.03.2022	EUR	5.115,34	Distribution R (EUR)	31.03.2022	4.313	
	30.09.2021	EUR	5.132,66		30.09.2021	5.733	
	30.09.2020	EUR	5.162,84		30.09.2020	7.293	
Capitalisation X (EUR)	31.03.2022	EUR	249,66	<b>Laufende Kosten in %*</b>			
	30.09.2021	EUR	250,54		Capitalisation N (EUR)	31.03.2022	0,17%
	30.09.2020	EUR	252,09		Capitalisation P (EUR)	31.03.2022	0,17%
Distribution N (EUR)	31.03.2022	EUR	991,58	Capitalisation R (EUR)	31.03.2022	0,17%	
	30.09.2021	EUR	995,11	Capitalisation S (EUR)	31.03.2022	0,14%	
	30.09.2020	EUR	1.001,31	Capitalisation X (EUR)	31.03.2022	0,17%	
Distribution P (EUR)	31.03.2022	EUR	992,74	Distribution N (EUR)	31.03.2022	0,18%	
	30.09.2021	EUR	996,25	Distribution P (EUR)	31.03.2022	0,17%	
	30.09.2020	EUR	1.002,40	Distribution R (EUR)	31.03.2022	0,17%	
Distribution R (EUR)	31.03.2022	EUR	992,71	<b>Portfolioumsatz in %*</b>			
	30.09.2021	EUR	996,22		31.03.2022	(39,68%)	
	30.09.2020	EUR	1.002,38				
<b>Anzahl der Anteile</b>							
	31.03.2022		-				
	30.09.2021		375				
Capitalisation I (EUR)	30.09.2020		424				
	31.03.2022		24.992				
	30.09.2021		20.071				
Capitalisation N (EUR)	30.09.2020		23.258				
	31.03.2022		90.521				
	30.09.2021		104.803				
Capitalisation P (EUR)	30.09.2020		128.007				

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

## NN (L) Euro Liquidity

(ausgedrückt in EUR)

### Finanzabschlüsse

#### Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022

	Erläuterungen	
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	2	<b>44.028.894,27</b>
Organismen für gemeinsame Anlagen		2.054.170,12
Anleihen und andere Schuldtitel		9.759.752,13
Geldmarktinstrumente		32.214.972,02
<b>Bankguthaben</b>		<b>3.299.244,33</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte</b>	4	<b>2.154.888,90</b>
<b>Vermögenswerte Gesamt</b>		<b>49.483.027,50</b>
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>	4	<b>(3.789.964,66)</b>
<b>Verbindlichkeiten Gesamt</b>		<b>(3.789.964,66)</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Berichtszeitraums</b>		<b>45.693.062,84</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Euro Liquidity

(ausgedrückt in EUR)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
<b>Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>				
<b>Anleihen und andere Schuldtitel</b>				
<b>Luxemburg</b>				
2.500.000	PURPLE PROTECTED ASSET SA 12/04/2022 FRN EMTN	EUR	2.488.150,00	5,45
			<b>2.488.150,00</b>	<b>5,45</b>
<b>Deutschland</b>				
1.500.000	VOLKSWAGEN FINANCIAL SERVICES AG 0.625% 01/04/2022 EMTN	EUR	1.500.000,00	3,28
770.000	VOLKSWAGEN LEASING GMBH 0.500% 20/06/2022 EMTN	EUR	771.172,39	1,69
			<b>2.271.172,39</b>	<b>4,97</b>
<b>Frankreich</b>				
2.000.000	SOCIETE GENERALE SA 01/04/2022 FRN EMTN	EUR	2.000.000,00	4,38
			<b>2.000.000,00</b>	<b>4,38</b>
<b>Spanien</b>				
1.500.000	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA 12/04/2022 FRN GMTN	EUR	1.500.217,13	3,28
			<b>1.500.217,13</b>	<b>3,28</b>
<b>Vereinigtes Königreich</b>				
1.000.000	BARCLAYS PLC 1.500% 01/04/2022 EMTN	EUR	1.000.000,00	2,19
			<b>1.000.000,00</b>	<b>2,19</b>
<b>Guernsey</b>				
500.000	CREDIT SUISSE GROUP FUNDING GUERNSEY LTD 1.250% 14/04/2022 EMTN	EUR	500.212,61	1,09
			<b>500.212,61</b>	<b>1,09</b>
			<b>9.759.752,13</b>	<b>21,36</b>
<b>Geldmarktinstrumente</b>				
<b>Frankreich</b>				
2.000.000	METROPOLE DE LYON ZCP 26/04/2022	EUR	2.000.715,76	4,37
2.000.000	REGION NORD PAS ZCP 07/04/2022	EUR	2.000.176,34	4,38
1.000.000	REGION OCCITANIE ZCP 08/04/2022	EUR	1.000.104,82	2,19
1.000.000	SAGESS ZCP 06/05/2022	EUR	1.000.455,50	2,19
			<b>6.001.452,42</b>	<b>13,13</b>
<b>Belgien</b>				
500.000	BRUSSELS MUNICIPALITIES REGION ZCP 25/04/2022	EUR	500.155,73	1,09
1.200.000	BRUSSELS MUNICIPALITIES REGIONAL FUND ZCP 15/06/2022	EUR	1.200.973,20	2,63
1.500.000	SOCIETE WALL ZCP 08/04/2022	EUR	1.500.020,13	3,28
2.000.000	VLAAMSE GEMEENSCHAP ZCP 19/04/2022	EUR	2.000.478,44	4,38
			<b>5.201.627,50</b>	<b>11,38</b>
<b>Schweiz</b>				
2.000.000	BASLER KANTONALBANK ZCP 23/05/2022 (1)	EUR	2.001.495,64	4,38
2.000.000	ZUERCHER KANTONALBANK ZCP 17/06/2022 (1)	EUR	2.001.884,00	4,38
			<b>4.003.379,64</b>	<b>8,76</b>
<b>Deutschland</b>				
2.000.000	E.ON SE ZCP 25/04/2022	EUR	2.000.462,82	4,38
1.000.000	RWE AG ZCP 22/04/2022	EUR	1.000.170,76	2,19

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
1.000.000	RWE AG ZCP 31/05/2022	EUR	1.000.562,76	2,19
			<b>4.001.196,34</b>	<b>8,76</b>
<b>Vereinigtes Königreich</b>				
1.500.000	LAND SECURITIES ZCP 04/04/2022	EUR	1.500.059,88	3,28
2.000.000	QATAR NATIONAL BANK (Q.P.S.C.) ZCP 19/07/2022 (1)	EUR	2.002.252,44	4,38
			<b>3.502.312,32</b>	<b>7,66</b>
<b>Vereinigte Staaten</b>				
1.000.000	DANAHER CORPORATION ZCP 13/04/2022	EUR	1.000.153,22	2,19
2.000.000	FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES INC ZCP 19/04/2022	EUR	2.000.298,36	4,38
			<b>3.000.451,58</b>	<b>6,57</b>
<b>Luxemburg</b>				
1.000.000	INDUSTRIAL AND COMMERCIAL BANK OF CHINA ZCP 24/08/2022 (1)	EUR	1.000.873,55	2,19
500.000	INDUSTRIAL AND COMMERCIAL BANK OF CHINA ZCP 31/08/2022 (1)	EUR	500.443,55	1,10
1.000.000	NEL FINANCE ZCP 28/04/2022	EUR	1.000.188,59	2,18
			<b>2.501.505,69</b>	<b>5,47</b>
<b>Norwegen</b>				
2.000.000	DNB BANK ASA ZCP 09/09/2022	EUR	2.002.428,70	4,38
			<b>2.002.428,70</b>	<b>4,38</b>
<b>Österreich</b>				
1.000.000	BUNDESIMMOBILIENGESELLSCHAFT MBH ZCP 23/05/2022	EUR	1.000.487,50	2,20
			<b>1.000.487,50</b>	<b>2,20</b>
<b>Niederlande</b>				
1.000.000	ENEL FINANCE ZCP 21/04/2022	EUR	1.000.130,33	2,19
			<b>1.000.130,33</b>	<b>2,19</b>
			<b>32.214.972,02</b>	<b>70,50</b>
<b>Organismen für gemeinsame Anlagen</b>				
<b>Offene Fonds</b>				
<b>Luxemburg</b>				
2.080	NN (L) LIQUID EUR - Z CAP EUR	EUR	2.054.170,12	4,50
			<b>2.054.170,12</b>	<b>4,50</b>
			<b>2.054.170,12</b>	<b>4,50</b>
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>			<b>44.028.894,27</b>	<b>96,36</b>
<b>Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick</b>				
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>			<b>44.028.894,27</b>	<b>96,36</b>
<b>Bankguthaben</b>			<b>3.299.244,33</b>	<b>7,22</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>			<b>(1.635.075,76)</b>	<b>(3,58)</b>
<b>Nettovermögen Gesamt</b>			<b>45.693.062,84</b>	<b>100,00</b>

(1) Kurzfristiges Einlagezertifikat.

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Euro Long Duration Bond

(ausgedrückt in EUR)

### Statistische Angaben

<b>Nettovermögen</b>	31.03.2022	EUR	838.669.327,84
	30.09.2021	EUR	917.543.409,85
	30.09.2020	EUR	834.905.317,72
<b>Nettoinventarwert pro Anteil**</b>			
Capitalisation I (EUR)	31.03.2022	EUR	8.722,74
	30.09.2021	EUR	9.786,88
	30.09.2020	EUR	10.253,37
Capitalisation N (EUR)	31.03.2022	EUR	494,93
	30.09.2021	EUR	555,05
	30.09.2020	EUR	580,97
Capitalisation P (EUR)	31.03.2022	EUR	477,41
	30.09.2021	EUR	536,61
	30.09.2020	EUR	564,18
Capitalisation X (EUR)	31.03.2022	EUR	468,60
	30.09.2021	EUR	526,95
	30.09.2020	EUR	554,61
<b>Anzahl der Anteile</b>			
Capitalisation I (EUR)	31.03.2022		30.810
	30.09.2021		31.104
	30.09.2020		25.296
Capitalisation N (EUR)	31.03.2022		1.141.491
	30.09.2021		1.094.078
	30.09.2020		979.878
Capitalisation P (EUR)	31.03.2022		5.523
	30.09.2021		4.936
	30.09.2020		6.164
Capitalisation X (EUR)	31.03.2022		4.956
	30.09.2021		6.111
	30.09.2020		5.009
<b>Laufende Kosten in %*</b>			
Capitalisation I (EUR)	31.03.2022		0,49%
Capitalisation N (EUR)	31.03.2022		0,40%
Capitalisation P (EUR)	31.03.2022		0,85%
Capitalisation X (EUR)	31.03.2022		0,95%
<b>Portfolioumsatz in %*</b>	31.03.2022		1,68%

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.



## NN (L) Euro Long Duration Bond

(ausgedrückt in EUR)

### Finanzabschlüsse

#### Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022

	Erläuterungen	
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	2	<b>826.780.862,32</b>
Organismen für gemeinsame Anlagen		50.642.289,74
Anleihen und andere Schuldtitel		776.138.572,58
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	2	<b>1.382.143,91</b>
Futures		1.382.143,91
<b>Bankguthaben</b>		<b>72.534,21</b>
<b>Hinterlegte Sicherheiten</b>		<b>2.034.761,23</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte</b>	4, 12	<b>25.684.349,91</b>
<b>Vermögenswerte Gesamt</b>		<b>855.954.651,58</b>
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>	4	<b>(4.264.660,06)</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	2	<b>(13.020.663,68)</b>
Credit Default Swaps		(1.581.232,49)
Inflationsswap		(897.220,40)
Zinsswaps		(10.542.210,79)
<b>Verbindlichkeiten Gesamt</b>		<b>(17.285.323,74)</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Berichtszeitraums</b>		<b>838.669.327,84</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Euro Long Duration Bond

(ausgedrückt in EUR)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW	Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
<b>Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>									
<b>Anleihen und andere Schuldtitel</b>									
<b>Frankreich</b>									
600.000	BNP PARIBAS SA 1.625% 02/07/2031 EMTN	EUR	557.894,06	0,07	200.000	RTE RESEAU DE TRANSPORT D'ELECTRICITE SADIR 1.875% 23/10/2037 EMTN	EUR	198.432,10	0,02
700.000	BPCE SFH SA 0.375% 18/03/2041	EUR	580.900,25	0,07	1.400.000	RTE RESEAU DE TRANSPORT D'ELECTRICITE SADIR 2.000% 18/04/2036 EMTN	EUR	1.417.467,35	0,17
400.000	CAISSE FRANCAISE DE FINANCEMENT LOCAL 1.250% 11/05/2032 EMTN	EUR	398.037,51	0,05	100.000	SANOFI 1.875% 21/03/2038 EMTN	EUR	103.958,69	0,01
500.000	CAISSE FRANCAISE DE FINANCEMENT LOCAL 1.250% 22/01/2035 EMTN	EUR	491.579,09	0,06	3.500.000	SNCF RESEAU 3.300% 18/12/2042 EMTN	EUR	4.479.259,44	0,53
325.000	CIE DE FINANCEMENT FONCIER SA 3.875% 25/04/2055 EMTN	EUR	530.034,26	0,06	5.480.000	SNCF RESEAU 5.000% 10/10/2033 EMTN	EUR	7.606.698,35	0,91
200.000	CIE GENERALE DES ETABLISSEMENTS MICHELIN SCA 0.250% 02/11/2032	EUR	172.397,25	0,02	2.000.000	TOTALENERGIES CAPITAL INTERNATIONAL SA 1.535% 31/05/2039 EMTN	EUR	1.862.328,66	0,22
200.000	CNP ASSURANCES 30/06/2051 FRN EMTN	EUR	190.995,18	0,02	500.000	TOTALENERGIES SE FRN PERP EMTN	EUR	429.492,92	0,05
600.000	CREDIT AGRICOLE HOME LOAN SFH SA 0.875% 06/05/2034 EMTN	EUR	566.817,98	0,07	100.000	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD SE 1.750% 01/07/2049 EMTN	EUR	80.404,44	0,01
300.000	CREDIT AGRICOLE HOME LOAN SFH SA 1.250% 24/03/2031 EMTN	EUR	300.543,91	0,04	900.000	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD SE 2.250% 14/05/2038 EMTN	EUR	825.459,87	0,10
200.000	CREDIT AGRICOLE HOME LOAN SFH SA 1.375% 03/02/2032 EMTN	EUR	201.901,15	0,02	<b>244.038.259,02 29,10</b>				
300.000	CREDIT AGRICOLE HOME LOAN SFH SA 1.500% 03/02/2037 EMTN	EUR	302.903,28	0,04	<b>Italien</b>				
800.000	CREDIT AGRICOLE HOME LOAN SFH SA 1.500% 28/09/2038 EMTN	EUR	806.402,99	0,10	200.000	CREDIT AGRICOLE ITALIA SPA 1.000% 30/09/2031 EMTN	EUR	194.462,54	0,02
200.000	CREDIT AGRICOLE SA 0.875% 14/01/2032 EMTN	EUR	181.933,81	0,02	300.000	CREDIT AGRICOLE ITALIA SPA 1.750% 15/01/2038 EMTN	EUR	311.675,59	0,04
2.300.000	ELECTRICITE DE FRANCE SA 2.000% 09/12/2049 EMTN	EUR	2.095.630,40	0,25	320.000	ITALGAS SPA 1.000% 11/12/2031 EMTN	EUR	290.588,27	0,03
1.100.000	ENGIE SA 1.000% 26/10/2036 EMTN	EUR	932.492,28	0,11	3.672.000	ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 1.500% 30/04/2045	EUR	3.125.640,99	0,37
700.000	ENGIE SA 1.500% 13/03/2035 EMTN	EUR	650.759,64	0,08	5.400.000	ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 1.650% 01/03/2032	EUR	5.255.716,75	0,63
8.000.000	FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 0.500% 25/05/2040	EUR	7.033.400,64	0,84	3.252.000	ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 1.700% 01/09/2051	EUR	2.776.679,84	0,33
6.829.036	FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 0.500% 25/05/2072	EUR	4.361.914,88	0,52	4.500.000	ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 1.800% 01/03/2041	EUR	4.138.767,72	0,49
1.749.000	FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 0.500% 25/06/2044	EUR	1.478.473,15	0,18	4.497.000	ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 2.250% 01/09/2036	EUR	4.554.647,09	0,54
8.700.000	FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 0.750% 25/05/2052	EUR	7.334.757,02	0,87	5.007.000	ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 2.450% 01/09/2033	EUR	5.215.486,67	0,62
9.000.000	FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 1.250% 25/05/2034	EUR	9.184.300,83	1,10	6.000.000	ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 2.450% 01/09/2050	EUR	5.989.556,88	0,71
9.693.000	FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 1.250% 25/05/2036	EUR	9.838.823,72	1,17	5.536.000	ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 2.700% 01/03/2047	EUR	5.885.263,80	0,70
6.000.000	FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 1.500% 25/05/2031	EUR	6.346.933,38	0,76	3.660.000	ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 2.800% 01/03/2067	EUR	3.706.579,03	0,44
24.170.000	FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 1.500% 25/05/2050	EUR	24.972.167,98	2,98	3.839.000	ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 2.950% 01/09/2038	EUR	4.215.078,38	0,50
9.000.000	FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 1.750% 25/05/2066	EUR	9.788.493,24	1,17	2.626.000	ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 3.100% 01/03/2040	EUR	2.936.548,87	0,35
8.000.000	FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 1.750% 25/06/2039	EUR	8.739.749,28	1,04	4.772.000	ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 3.250% 01/09/2046	EUR	5.547.539,00	0,66
37.175.000	FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 2.000% 25/05/2048	EUR	42.621.102,56	5,07	4.500.000	ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 3.350% 01/03/2035	EUR	5.114.762,82	0,61
7.000.000	FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 3.250% 25/05/2045	EUR	9.703.944,67	1,16	4.161.000	ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 3.450% 01/03/2048	EUR	5.009.905,79	0,60
6.600.000	FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 4.000% 25/04/2055	EUR	11.126.239,48	1,33	2.635.000	ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 3.850% 01/09/2049	EUR	3.376.385,60	0,40
4.380.000	FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 4.000% 25/04/2060	EUR	7.657.697,23	0,91	8.438.000	ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 4.000% 01/02/2037	EUR	10.388.950,57	1,25
8.398.265	FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 4.000% 25/10/2038	EUR	12.029.362,12	1,43	4.309.000	ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 4.750% 01/09/2044	EUR	6.103.191,07	0,73
10.500.000	FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 4.500% 25/04/2041	EUR	16.265.717,79	1,94	11.224.000	ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 5.000% 01/08/2034	EUR	14.883.236,25	1,78
7.660.000	FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 4.750% 25/04/2035	EUR	11.118.979,47	1,33	7.122.000	ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 5.000% 01/08/2039	EUR	9.913.347,75	1,19
11.000.000	FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 5.750% 25/10/2032	EUR	16.325.647,47	1,95	5.786.000	ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 5.000% 01/09/2040	EUR	8.150.724,31	0,97
400.000	GECINA SA 0.875% 30/06/2036 EMTN	EUR	338.118,45	0,04	8.480.000	ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 5.750% 01/02/2033	EUR	11.611.766,01	1,39
900.000	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE 0.375% 11/02/2031	EUR	827.504,38	0,10	<b>128.696.501,59 15,35</b>				
300.000	MUTUELLE ASSURANCE DES COMMERCANTS ET INDUSTRIELS DE FRANCE ET DES CADRES ET SAL 21/06/2052 FRN	EUR	270.520,14	0,03	<b>Spanien</b>				
200.000	ORANGE SA 0.625% 16/12/2033 EMTN	EUR	178.443,35	0,02	500.000	ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA 1.875% 26/03/2032	EUR	481.481,53	0,06
400.000	ORANGE SA 1.375% 04/09/2049 EMTN	EUR	369.078,89	0,04	700.000	ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA 3.000% 27/03/2031 EMTN	EUR	745.384,07	0,09
125.000	PSA TRESORERIE GIE 6.000% 19/09/2033	EUR	162.164,04	0,02	200.000	BANCO SANTANDER SA 2.000% 27/11/2034	EUR	214.613,47	0,03
					1.000.000	CAIXABANK SA 4.125% 24/03/2036	EUR	1.331.939,97	0,16
					100.000	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA 1.875% 04/12/2034	EUR	84.997,97	0,01
					1.200.000	PROGRAMA CEDULAS TDA FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS 4.250% 10/04/2031	EUR	1.502.708,96	0,18
					2.867.000	SPAIN GOVERNMENT BOND 0.850% 30/07/2037	EUR	2.531.368,25	0,30
					5.000.000	SPAIN GOVERNMENT BOND 1.000% 31/10/2050	EUR	3.974.375,10	0,47

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Euro Long Duration Bond

(ausgedrückt in EUR)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl/ Nominal	Bezeich- nung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW	Stückzahl/ Nominal	Bezeich- nung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
6.500.000	SPAIN GOVERNMENT BOND 1.200% 31/10/2040	EUR	5.879.891,23	0,69	1.270.000	TENNET HOLDING BV 1.875% 13/06/2036 EMTN	EUR	1.260.731,10	0,15
2.500.000	SPAIN GOVERNMENT BOND 1.450% 31/10/2071	EUR	1.834.686,58	0,22	400.000	THERMO FISHER SCIENTIFIC FINANCE I BV 1.625% 18/10/2041	EUR	360.413,85	0,04
6.383.000	SPAIN GOVERNMENT BOND 1.850% 30/07/2035	EUR	6.597.078,54	0,79	1.500.000	UNILEVER FINANCE NETHERLANDS BV 1.625% 12/02/2033 EMTN	EUR	1.521.001,05	0,18
1.900.000	SPAIN GOVERNMENT BOND 1.900% 31/10/2052	EUR	1.821.701,10	0,22	300.000	VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV 3.300% 22/03/2033 EMTN	EUR	325.953,39	0,04
4.000.000	SPAIN GOVERNMENT BOND 2.700% 31/10/2048	EUR	4.660.984,36	0,56	1.000.000	VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV 4.125% 16/11/2038	EUR	1.198.857,83	0,14
6.200.000	SPAIN GOVERNMENT BOND 2.900% 31/10/2046	EUR	7.469.678,90	0,89	400.000	VONOVIA FINANCE BV 1.125% 14/09/2034 EMTN	EUR	338.545,06	0,04
3.750.000	SPAIN GOVERNMENT BOND 3.450% 30/07/2066	EUR	4.915.321,46	0,59				<b>54.502.396,00</b>	<b>6,50</b>
6.448.000	SPAIN GOVERNMENT BOND 4.200% 31/01/2037	EUR	8.689.967,28	1,03					
5.913.000	SPAIN GOVERNMENT BOND 4.700% 30/07/2041	EUR	8.796.740,89	1,05					
6.211.000	SPAIN GOVERNMENT BOND 4.900% 30/07/2040	EUR	9.368.245,33	1,12					
4.688.000	SPAIN GOVERNMENT BOND 5.150% 31/10/2044	EUR	7.608.134,95	0,91					
13.250.000	SPAIN GOVERNMENT BOND 5.750% 30/07/2032	EUR	18.879.007,70	2,24					
1.400.000	TELEFONICA EMISIONES SA 1.957% 01/07/2039	EUR	1.362.195,20	0,16					
			<b>98.750.502,84</b>	<b>11,77</b>					
	<b>Niederlande</b>					<b>Luxemburg</b>			
1.000.000	ABN AMRO BANK NV 1.000% 13/04/2031 EMTN	EUR	981.414,47	0,12	200.000	DH EUROPE FINANCE II SARL 0.750% 18/09/2031	EUR	183.337,42	0,02
400.000	ABN AMRO BANK NV 1.125% 12/01/2032	EUR	394.696,34	0,05	500.000	DH EUROPE FINANCE II SARL 1.350% 18/09/2039	EUR	449.068,39	0,05
700.000	ABN AMRO BANK NV 1.125% 23/04/2039	EUR	663.476,00	0,08	1.300.000	DH EUROPE FINANCE II SARL 1.800% 18/09/2049	EUR	1.212.334,03	0,14
300.000	ABN AMRO BANK NV 1.250% 10/01/2033 EMTN	EUR	298.204,15	0,04	2.290.000	EUROPEAN FINANCIAL STABILITY FACILITY 1.200% 17/02/2045 EMTN	EUR	2.260.027,82	0,27
1.100.000	ABN AMRO BANK NV 1.375% 12/01/2037	EUR	1.092.179,91	0,13	1.122.000	EUROPEAN FINANCIAL STABILITY FACILITY 1.375% 31/05/2047 EMTN	EUR	1.149.655,28	0,14
200.000	ABN AMRO BANK NV 1.450% 12/04/2038	EUR	200.025,99	0,02	6.645.000	EUROPEAN FINANCIAL STABILITY FACILITY 1.450% 05/09/2040 EMTN	EUR	6.821.860,20	0,81
300.000	COOPERATIEVE RABOBANK UA 0.010% 27/11/2040 EMTN	EUR	229.731,89	0,03	8.005.000	EUROPEAN FINANCIAL STABILITY FACILITY 1.700% 13/02/2043 EMTN	EUR	8.640.118,14	1,03
500.000	COOPERATIEVE RABOBANK UA 0.750% 21/06/2039	EUR	446.722,52	0,05	5.595.000	EUROPEAN FINANCIAL STABILITY FACILITY 2.000% 28/02/2056 EMTN	EUR	6.715.520,83	0,80
200.000	COOPERATIEVE RABOBANK UA 1.250% 31/05/2032 EMTN	EUR	199.146,72	0,02	11.400.000	EUROPEAN FINANCIAL STABILITY FACILITY 2.350% 29/07/2044 EMTN	EUR	13.800.780,61	1,66
400.000	COOPERATIEVE RABOBANK UA 1.500% 26/04/2038 EMTN	EUR	403.432,59	0,05	5.000.000	EUROPEAN FINANCIAL STABILITY FACILITY 3.375% 03/04/2037 EMTN	EUR	6.434.386,35	0,77
400.000	DE VOLKSBANK NV 0.125% 19/11/2040 EMTN	EUR	316.170,67	0,04	228.000	HOLCIM FINANCE LUXEMBOURG SA 0.625% 19/01/2033 EMTN	EUR	188.759,21	0,02
750.000	DEUTSCHE TELEKOM INTERNATIONAL FINANCE BV 7.500% 24/01/2033 EMTN	EUR	1.166.506,59	0,14	106.000	JOHN DEERE CASH MANAGEMENT SARL 2.200% 02/04/2032 EMTN	EUR	112.442,60	0,01
145.000	DIGITAL DUTCH FINCO BV 1.000% 15/01/2032	EUR	122.753,66	0,01	500.000	LOGICOR FINANCING SARL 2.000% 17/01/2034 EMTN	EUR	441.807,58	0,05
300.000	DIGITAL DUTCH FINCO BV 1.250% 01/02/2031	EUR	265.479,44	0,03	1.800.000	MEDTRONIC GLOBAL HOLDINGS SCA 1.500% 02/07/2039	EUR	1.648.289,43	0,20
700.000	ENBW INTERNATIONAL FINANCE BV 1.875% 31/10/2033 EMTN	EUR	672.656,12	0,08	600.000	MEDTRONIC GLOBAL HOLDINGS SCA 1.750% 02/07/2049	EUR	539.562,11	0,06
1.000.000	ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV 0.875% 17/06/2036 EMTN	EUR	827.510,16	0,10	128.000	PROLOGIS INTERNATIONAL FUNDING II SA 1.625% 17/06/2032 EMTN	EUR	120.709,46	0,01
388.000	ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV 0.875% 28/09/2034 EMTN	EUR	333.698,86	0,04	1.000.000	REPSOL EUROPE FINANCE SARL 0.875% 06/07/2033 EMTN	EUR	881.882,11	0,11
125.000	ENEXIS HOLDING NV 0.750% 02/07/2031 EMTN	EUR	116.345,05	0,01	300.000	TRATON FINANCE LUXEMBOURG SA 1.250% 24/03/2033 EMTN	EUR	262.011,92	0,03
1.100.000	E.ON INTERNATIONAL FINANCE BV 5.750% 14/02/2033 EMTN	EUR	1.487.590,68	0,18				<b>51.862.553,49</b>	<b>6,18</b>
100.000	GIVAUDAN FINANCE EUROPE BV 1.625% 22/04/2032	EUR	98.233,17	0,01					
388.000	HEIMSTADEN BOSTAD TREASURY BV 1.625% 13/10/2031 EMTN	EUR	341.336,40	0,04					
100.000	KONINKLIJKE DSM NV 0.625% 23/06/2032 EMTN	EUR	89.669,74	0,01					
461.000	LYB INTERNATIONAL FINANCE II BV 1.625% 17/09/2031	EUR	434.677,14	0,05					
1.000.000	MONDELEZ INTERNATIONAL HOLDINGS NETHERLANDS BV 1.250% 09/09/2041	EUR	818.508,85	0,10					
1.553.000	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND ZCP 15/01/2038	EUR	1.350.648,40	0,16					
3.200.000	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND ZCP 15/01/2052	EUR	2.515.066,53	0,30					
3.026.000	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 0.500% 15/01/2040	EUR	2.856.803,03	0,34					
5.680.000	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 2.500% 15/01/2033	EUR	6.684.179,81	0,80					
4.485.904	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 2.750% 15/01/2047	EUR	6.465.992,88	0,77					
5.137.000	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 3.750% 15/01/2042	EUR	7.871.118,88	0,94					
5.000.000	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 4.000% 15/01/2037	EUR	7.182.538,10	0,86					
1.000.000	SHELL INTERNATIONAL FINANCE BV 1.250% 11/11/2032 EMTN	EUR	967.069,69	0,12					
300.000	SIEMENS FINANCIERINGSMAATSCHAPPIJ NV 1.250% 25/02/2035 EMTN	EUR	291.675,90	0,03					
385.000	SIEMENS FINANCIERINGSMAATSCHAPPIJ NV 1.250% 28/02/2031	EUR	382.723,17	0,05					
1.000.000	TENNET HOLDING BV 1.500% 03/06/2039 EMTN	EUR	928.910,22	0,11					
						<b>Belgien</b>			
					2.300.000	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV 2.750% 17/03/2036 EMTN	EUR	2.477.198,21	0,30
					2.000.000	BELGIUM GOVERNMENT BOND 0.400% 22/06/2040	EUR	1.696.826,30	0,20
					1.600.000	BELGIUM GOVERNMENT BOND 0.650% 22/06/2071	EUR	1.070.671,76	0,13
					5.200.000	BELGIUM GOVERNMENT BOND 1.250% 22/04/2033	EUR	5.367.004,19	0,64
					1.184.000	BELGIUM GOVERNMENT BOND 1.450% 22/06/2037	EUR	1.219.251,60	0,15
					3.800.000	BELGIUM GOVERNMENT BOND 1.600% 22/06/2047	EUR	3.917.413,08	0,47
					2.171.000	BELGIUM GOVERNMENT BOND 1.700% 22/06/2050	EUR	2.281.826,92	0,27
					2.382.000	BELGIUM GOVERNMENT BOND 1.900% 22/06/2038	EUR	2.617.241,10	0,31
					1.667.000	BELGIUM GOVERNMENT BOND 2.150% 22/06/2066	EUR	1.973.885,91	0,24
					1.816.699	BELGIUM GOVERNMENT BOND 2.250% 22/06/2057	EUR	2.168.873,62	0,26
					1.631.882	BELGIUM GOVERNMENT BOND 3.000% 22/06/2034	EUR	1.990.938,27	0,24
					3.246.379	BELGIUM GOVERNMENT BOND 3.750% 22/06/2045	EUR	4.755.050,89	0,57
					2.099.000	BELGIUM GOVERNMENT BOND 4.000% 28/03/2032	EUR	2.716.521,64	0,32
					4.571.000	BELGIUM GOVERNMENT BOND 4.250% 28/03/2041	EUR	6.779.357,24	0,81
					5.504.947	BELGIUM GOVERNMENT BOND 5.000% 28/03/2035	EUR	8.069.285,03	0,95

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Euro Long Duration Bond

(ausgedrückt in EUR)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW	Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
300.000	PROXIMUS SADP 0.750% 17/11/2036 EMTN	EUR	264.699,80	0,03	200.000	VERBUND AG 0.900% 01/04/2041	EUR	173.206,26	0,02
			<b>49.366.045,56</b>	<b>5,89</b>				<b>23.271.204,26</b>	<b>2,77</b>
<b>Deutschland</b>					<b>Vereinigte Staaten</b>				
1.998.000	BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE ZCP 15/08/2052	EUR	1.639.618,00	0,20	500.000	AMERICAN TOWER CORP 1.250% 21/05/2033	EUR	442.734,91	0,05
8.260.000	BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE 4.000% 04/01/2037	EUR	12.284.592,24	1,45	2.000.000	AT&T INC 3.150% 04/09/2036	EUR	2.199.375,48	0,27
1.500.000	BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE 4.250% 04/07/2039	EUR	2.397.334,97	0,29	700.000	AT&T INC 3.375% 15/03/2034	EUR	786.275,69	0,09
6.000.000	BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE 4.750% 04/07/2040	EUR	10.299.280,92	1,23	520.000	CHUBB INA HOLDINGS INC 2.500% 15/03/2038	EUR	534.063,44	0,06
400.000	DZ HYP AG 0.375% 10/11/2034 EMTN	EUR	354.814,65	0,04	3.000.000	COCA-COLA CO/THE 1.625% 09/03/2035	EUR	2.992.524,45	0,37
300.000	HANNOVER RUECK SE 30/06/2042 FRN	EUR	264.506,29	0,03	1.000.000	ELI LILLY & CO 1.125% 14/09/2051	EUR	813.963,97	0,10
300.000	ING-DIBA AG 1.250% 09/10/2033 EMTN	EUR	297.951,62	0,04	400.000	ELI LILLY & CO 2.125% 03/06/2030	EUR	423.438,92	0,05
767.000	MERCEDES-BENZ GROUP AG 0.750% 11/03/2033 EMTN	EUR	691.416,26	0,08	355.000	EQUINIX INC 1.000% 15/03/2033	EUR	298.794,70	0,04
900.000	MERCK FINANCIAL SERVICES GMBH 0.875% 05/07/2031 EMTN	EUR	851.146,87	0,10	490.000	GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE 1.000% 18/03/2033 EMTN	EUR	434.372,52	0,05
720.000	STATE OF NORTH RHINE-WESTPHALIA GERMANY ZCP 12/10/2035 EMTN	EUR	603.512,04	0,07	1.200.000	INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP 1.250% 09/02/2034 EMTN	EUR	1.148.018,02	0,14
6.081.000	STATE OF NORTH RHINE-WESTPHALIA GERMANY 1.000% 16/10/2046 EMTN	EUR	5.698.164,44	0,68	1.073.000	JPMORGAN CHASE & CO 04/11/2032 FRN EMTN	EUR	989.947,73	0,12
1.400.000	STATE OF NORTH RHINE-WESTPHALIA GERMANY 1.375% 15/01/2120 EMTN	EUR	1.092.837,19	0,13	1.021.000	MORGAN STANLEY 29/04/2033 FRN	EUR	937.978,72	0,11
1.300.000	STATE OF NORTH RHINE-WESTPHALIA GERMANY 1.750% 11/07/2068 EMTN	EUR	1.396.300,71	0,17	1.700.000	PEPSICO INC 0.875% 16/10/2039	EUR	1.434.898,60	0,17
145.000	UNICREDIT BANK AG 0.250% 15/01/2032	EUR	131.755,39	0,02	600.000	PROCTER & GAMBLE CO 1.875% 30/10/2038	EUR	621.528,49	0,07
200.000	VONOVIA SE 0.750% 01/09/2032 EMTN	EUR	172.003,66	0,02	300.000	PROLOGIS EURO FINANCE LLC 1.500% 10/09/2049	EUR	249.388,04	0,03
400.000	VONOVIA SE 1.500% 14/06/2041	EUR	327.637,32	0,04	500.000	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC 1.500% 01/10/2039 EMTN	EUR	448.860,67	0,05
400.000	VONOVIA SE 1.625% 01/09/2051 EMTN	EUR	312.096,11	0,04	253.000	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC 2.875% 24/07/2037	EUR	273.595,59	0,03
			<b>38.814.968,68</b>	<b>4,63</b>	389.000	VERIZON COMMUNICATIONS INC 1.125% 19/09/2035	EUR	351.391,43	0,04
<b>Supranational-Multinational</b>					300.000	VERIZON COMMUNICATIONS INC 1.850% 18/05/2040	EUR	282.783,57	0,03
10.000.000	EUROPEAN INVESTMENT BANK 0.050% 27/01/2051	EUR	7.137.158,40	0,86	300.000	VERIZON COMMUNICATIONS INC 2.875% 15/01/2038	EUR	327.239,98	0,04
2.459.000	EUROPEAN INVESTMENT BANK 0.875% 13/09/2047 EMTN	EUR	2.279.725,25	0,27				<b>15.991.174,92</b>	<b>1,91</b>
5.546.000	EUROPEAN INVESTMENT BANK 1.750% 15/09/2045 EMTN	EUR	6.102.198,47	0,73	<b>Irland</b>				
2.600.000	EUROPEAN INVESTMENT BANK 3.000% 14/10/2033 EMTN	EUR	3.106.933,52	0,37	250.000	ATLAS COPCO FINANCE DAC 0.750% 08/02/2032 EMTN	EUR	231.441,48	0,03
5.700.000	EUROPEAN INVESTMENT BANK 4.000% 15/10/2037 EMTN	EUR	7.914.816,05	0,94	1.156.000	IRELAND GOVERNMENT BOND 0.400% 15/05/2035	EUR	1.050.529,52	0,13
1.500.000	EUROPEAN STABILITY MECHANISM 0.875% 18/07/2042 EMTN	EUR	1.386.078,14	0,17	2.044.464	IRELAND GOVERNMENT BOND 1.300% 15/05/2033	EUR	2.087.654,06	0,25
3.643.000	EUROPEAN STABILITY MECHANISM 1.850% 01/12/2055 EMTN	EUR	4.267.308,92	0,51	2.300.000	IRELAND GOVERNMENT BOND 1.500% 15/05/2050	EUR	2.339.959,83	0,28
3.000.000	EUROPEAN UNION 0.300% 04/11/2050 EMTN	EUR	2.297.939,07	0,27	1.721.612	IRELAND GOVERNMENT BOND 1.700% 15/05/2037	EUR	1.840.456,05	0,22
			<b>34.492.157,82</b>	<b>4,12</b>	3.163.000	IRELAND GOVERNMENT BOND 2.000% 18/02/2045	EUR	3.582.896,16	0,42
<b>Österreich</b>					100.000	SMURFIT KAPPA TREASURY ULC 1.000% 22/09/2033	EUR	86.928,27	0,01
1.500.000	AUSTRIA GOVERNMENT BOND ZCP 20/10/2040	EUR	1.211.289,12	0,14				<b>11.219.865,37</b>	<b>1,34</b>
438.000	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 0.700% 20/04/2071	EUR	331.366,20	0,04	<b>Finnland</b>				
1.611.000	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 0.750% 20/03/2051	EUR	1.454.236,20	0,17	1.045.000	FINLAND GOVERNMENT BOND 0.125% 15/04/2036	EUR	918.302,20	0,11
950.000	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 0.850% 30/06/2020	EUR	622.093,02	0,07	1.200.000	FINLAND GOVERNMENT BOND 0.125% 15/04/2052	EUR	918.854,11	0,11
830.000	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 1.500% 02/11/2086	EUR	850.068,25	0,10	1.360.000	FINLAND GOVERNMENT BOND 0.750% 15/04/2031	EUR	1.352.811,69	0,16
2.166.000	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 1.500% 20/02/2047	EUR	2.355.177,64	0,28	1.500.000	FINLAND GOVERNMENT BOND 1.125% 15/04/2034	EUR	1.522.115,04	0,18
1.689.000	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 2.100% 20/09/2117	EUR	2.073.912,26	0,25	1.142.000	FINLAND GOVERNMENT BOND 1.375% 15/04/2047	EUR	1.240.456,54	0,15
2.150.000	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 2.400% 23/05/2034	EUR	2.497.130,81	0,30	1.532.000	FINLAND GOVERNMENT BOND 2.625% 04/07/2042	EUR	1.972.166,12	0,24
2.355.000	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 3.150% 20/06/2044	EUR	3.343.779,15	0,40	581.000	SAMPO OYJ 03/09/2052 FRN EMTN	EUR	544.842,81	0,06
717.000	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 3.800% 26/01/2062	EUR	1.288.686,36	0,15				<b>8.469.548,51</b>	<b>1,01</b>
4.757.000	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 4.150% 15/03/2037	EUR	6.819.842,80	0,82	<b>Polen</b>				
300.000	UNICREDIT BANK AUSTRIA AG 0.050% 21/09/2035	EUR	250.416,19	0,03	3.500.000	POLAND GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 2.000% 25/10/2046 EMTN	EUR	3.392.500,34	0,40

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Euro Long Duration Bond

(ausgedrückt in EUR)

## Wertpapierbestand zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
<b>Rumänien</b>				
3.000.000	ROMANIAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.625% 03/04/2049 EMTN	EUR	2.946.940,50	0,35
			<b>2.946.940,50</b>	<b>0,35</b>
<b>Vereinigtes Königreich</b>				
1.000.000	BP CAPITAL MARKETS PLC 1.104% 15/11/2034	EUR	886.072,86	0,11
1.000.000	BP CAPITAL MARKETS PLC 1.231% 08/05/2031 EMTN	EUR	944.795,92	0,11
180.000	NATIONWIDE BUILDING SOCIETY 1.375% 29/06/2032 EMTN	EUR	181.026,70	0,02
400.000	SWISS RE FINANCE UK PLC 04/06/2052 FRN EMTN	EUR	385.979,36	0,05
			<b>2.397.874,84</b>	<b>0,29</b>
<b>Japan</b>				
500.000	TAKEDA PHARMACEUTICAL CO LTD 1.375% 09/07/2032	EUR	474.973,02	0,06
500.000	TAKEDA PHARMACEUTICAL CO LTD 2.000% 09/07/2040	EUR	475.387,99	0,06
1.000.000	TAKEDA PHARMACEUTICAL CO LTD 3.000% 21/11/2030	EUR	1.088.164,00	0,12
			<b>2.038.525,01</b>	<b>0,24</b>
<b>Norwegen</b>				
2.000.000	EQUINOR ASA 1.625% 17/02/2035 EMTN	EUR	1.952.386,36	0,23
			<b>1.952.386,36</b>	<b>0,23</b>
<b>Jersey</b>				
1.500.000	HEATHROW FUNDING LTD 1.875% 14/03/2034 EMTN	EUR	1.381.879,34	0,16
			<b>1.381.879,34</b>	<b>0,16</b>
<b>Schweiz</b>				
373.000	CREDIT SUISSE GROUP AG 0.625% 18/01/2033 EMTN	EUR	302.699,63	0,04
500.000	UBS AG/LONDON 0.500% 31/03/2031 EMTN	EUR	455.211,72	0,05
200.000	UBS GROUP AG 0.875% 03/11/2031	EUR	183.981,14	0,02
			<b>941.892,49</b>	<b>0,11</b>
<b>Portugal</b>				
1.000.000	PORTUGAL OBRIGACOES DO TESOURO OT 1.000% 12/04/2052	EUR	776.016,46	0,09
			<b>776.016,46</b>	<b>0,09</b>
<b>Schweden</b>				
500.000	SVERIGES SAKERSTALDA OBLIGATIONER AB 1.250% 19/04/2033 EMTN	EUR	495.958,94	0,06
			<b>495.958,94</b>	<b>0,06</b>
<b>Australien</b>				
400.000	WESTPAC BANKING CORP 0.375% 22/09/2036 EMTN	EUR	339.420,24	0,04
			<b>339.420,24</b>	<b>0,04</b>
			<b>776.138.572,58</b>	<b>92,54</b>

### Organismen für gemeinsame Anlagen

#### Offene Fonds

##### Luxemburg

3.548	NN (L) EUROPEAN ABS - Z CAP EUR	EUR	19.335.677,52	2,31
31.696	NN (L) LIQUID EUR - Z CAP EUR	EUR	31.306.612,22	3,73
			<b>50.642.289,74</b>	<b>6,04</b>
			<b>50.642.289,74</b>	<b>6,04</b>

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>			<b>826.780.862,32</b>	<b>98,58</b>

## Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022

Bezeichnung	Verkauf / Kauf	Zinssatz (%)	Fälligkeits- datum	Währung	Nennwert	Swap-Wert in EUR
<b>Credit Default Swap</b>						
CDX ITRAXX EUROPE SERIES 37 VERSION 1	Kauf	1,000	20/06/2027	EUR	115.699.995,00	(1.581.232,49)
						<b>(1.581.232,49)</b>

Zu erhalten (%)	Zu zahlen (%)	Fälligkeits- datum	Währung	Nennwert	Swap-Wert in EUR
-----------------	---------------	-----------------------	---------	----------	---------------------

### Zinsswaps

Floating	0,601	21/03/2072	EUR	7.500.000,00	488.986,43
Floating	0,633	18/03/2072	EUR	8.675.570,00	458.395,69
Floating	0,144	05/11/2071	EUR	1.638.327,00	402.230,25
Floating	0,166	05/11/2071	EUR	1.638.326,00	388.083,34
Floating	0,173	05/11/2071	EUR	1.638.326,00	383.582,13
Floating	0,174	05/11/2071	EUR	1.638.327,00	382.939,34
Floating	0,651	21/03/2072	EUR	6.864.430,00	311.966,65
0,375	Floating	14/01/2032	EUR	2.908.126,00	(217.260,25)
1,154	Floating	21/03/2042	EUR	16.758.149,00	(218.377,95)
0,369	Floating	14/01/2032	EUR	2.921.874,00	(219.926,01)
1,151	Floating	18/03/2042	EUR	20.241.851,00	(276.277,79)
1,120	Floating	21/03/2042	EUR	19.100.000,00	(364.961,65)
0,372	Floating	08/11/2041	EUR	3.820.000,00	(578.482,92)
-0,275	Floating	22/08/2029	EUR	9.854.000,00	(946.915,58)
0,333	Floating	08/11/2037	EUR	7.100.000,00	(965.093,63)
0,143	Floating	08/11/2031	EUR	24.247.000,00	(2.288.859,09)
0,075	Floating	02/02/2041	EUR	17.259.000,00	(3.424.904,61)
0,256	Floating	29/10/2031	EUR	46.080.000,00	(3.857.335,14)
					<b>(10.542.210,79)</b>

Zu erhalten (%)	Zu zahlen (%)	Fälligkeits- datum	Währung	Nennwert	Swap-Wert in EUR
-----------------	---------------	-----------------------	---------	----------	---------------------

### Inflationsswaps

2.541	Floating	15/03/2032	EUR	12.054.420,00	(259.448,97)
2.503	Floating	15/03/2032	EUR	12.284.029,00	(317.712,90)
2.500	Floating	15/03/2032	EUR	12.241.551,00	(320.058,53)
					<b>(897.220,40)</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Euro Long Duration Bond

(ausgedrückt in EUR)

### Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl	Bezeichnung	Währung	Engagement in EUR	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR
<b>Zins-Futures</b>				
5	EURO-BOBL FUTURE 08/06/2022	EUR	644.300,00	(23.550,00)
36	EURO-BTP FUTURE 08/06/2022	EUR	4.979.160,00	(257.583,75)
630	EURO-BUND FUTURE 08/06/2022	EUR	99.955.800,00	(5.567.943,62)
(987)	EURO-OAT FUTURE 08/06/2022	EUR	149.540.370,00	7.227.261,28
(3)	EURO-SCHATZ FUTURE 08/06/2022	EUR	332.205,00	3.960,00
			<b>255.451.835,00</b>	<b>1.382.143,91</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>				<b>(11.638.519,77)</b>

### Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick

		%
		NIW
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	<b>826.780.862,32</b>	<b>98,58</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	<b>(11.638.519,77)</b>	<b>(1,39)</b>
<b>Bankguthaben</b>	<b>72.534,21</b>	<b>0,01</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>	<b>23.454.451,08</b>	<b>2,80</b>
<b>Nettovermögen Gesamt</b>	<b>838.669.327,84</b>	<b>100,00</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Euro Short Duration

(ausgedrückt in EUR)

### Statistische Angaben

<b>Nettovermögen</b>	31.03.2022	EUR	201.585.268,14	<b>Anzahl der Anteile</b>			
	30.09.2021	EUR	164.829.097,50				
	30.09.2020	EUR	194.624.193,16		Distribution R (EUR)	31.03.2022	62
<b>Nettoinventarwert pro Anteil**</b>					30.09.2021	62	
					30.09.2020	78	
Capitalisation I (EUR)	31.03.2022	EUR	5.270,23	Distribution Z (EUR)	31.03.2022	51	
	30.09.2021	EUR	5.343,79		30.09.2021	51	
	30.09.2020	EUR	5.375,20		30.09.2020	66	
Capitalisation P (EUR)	31.03.2022	EUR	423,22	<b>Laufende Kosten in %*</b>			
	30.09.2021	EUR	429,78		Capitalisation I (EUR)	31.03.2022	0,49%
	30.09.2020	EUR	433,60		Capitalisation P (EUR)	31.03.2022	0,79%
Capitalisation R (EUR)	31.03.2022	EUR	427,40	Capitalisation R (EUR)	31.03.2022	0,56%	
	30.09.2021	EUR	433,51	Capitalisation Z (EUR)	31.03.2022	0,13%	
	30.09.2020	EUR	436,37	Distribution P (EUR)	31.03.2022	0,80%	
Capitalisation Z (EUR)	31.03.2022	EUR	4.960,43	Distribution R (EUR)	31.03.2022	0,56%	
	30.09.2021	EUR	5.020,61	Distribution Z (EUR)	31.03.2022	0,13%	
	30.09.2020	EUR	5.031,97	<b>Portfolioumsatz in %*</b>	31.03.2022	314,74%	
Distribution P (EUR)	31.03.2022	EUR	1.190,67				
	30.09.2021	EUR	1.209,15				
	30.09.2020	EUR	1.220,02				
Distribution R (EUR)	31.03.2022	EUR	1.202,63				
	30.09.2021	EUR	1.219,82				
	30.09.2020	EUR	1.227,82				
Distribution Z (EUR)	31.03.2022	EUR	247.912,36				
	30.09.2021	EUR	250.920,61				
	30.09.2020	EUR	251.486,95				
<b>Anzahl der Anteile</b>							
Capitalisation I (EUR)	31.03.2022		27.579				
	30.09.2021		18.850				
	30.09.2020		20.269				
Capitalisation P (EUR)	31.03.2022		6.601				
	30.09.2021		6.576				
	30.09.2020		19.888				
Capitalisation R (EUR)	31.03.2022		407				
	30.09.2021		407				
	30.09.2020		407				
Capitalisation Z (EUR)	31.03.2022		8.094				
	30.09.2021		9.513				
	30.09.2020		11.842				
Distribution P (EUR)	31.03.2022		428				
	30.09.2021		474				
	30.09.2020		574				

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

## NN (L) Euro Short Duration

(ausgedrückt in EUR)

### Finanzabschlüsse

#### Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022

	Erläuterungen	
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	2	<b>200.553.286,88</b>
Anleihen und andere Schuldtitel		198.546.575,22
Geldmarktinstrumente		2.006.711,66
<b>Bankguthaben</b>		<b>41.943,00</b>
<b>Hinterlegte Sicherheiten</b>		<b>444.999,49</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte</b>	4	<b>1.902.054,99</b>
<b>Vermögenswerte Gesamt</b>		<b>202.942.284,36</b>
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>	4	<b>(1.231.376,22)</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	2	<b>(125.640,00)</b>
Futures		(125.640,00)
<b>Verbindlichkeiten Gesamt</b>		<b>(1.357.016,22)</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Berichtszeitraums</b>		<b>201.585.268,14</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.



## NN (L) Euro Short Duration

(ausgedrückt in EUR)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
<b>Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>				
<b>Anleihen und andere Schuldtitel</b>				
<b>Italien</b>				
29.000.000	ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO ZCP 15/04/2024	EUR	28.718.032,71	14,25
5.700.000	ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO ZCP 15/12/2024	EUR	5.580.215,93	2,77
16.000.000	ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 0.950% 01/03/2023	EUR	16.177.192,32	8,02
11.400.000	ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 1.750% 01/07/2024	EUR	11.695.048,87	5,80
			<b>62.170.489,83</b>	<b>30,84</b>
<b>Frankreich</b>				
1.000.000	CENTRE HOSPITAL NANCY ZCP 24/10/2022	EUR	1.001.845,35	0,50
8.000.000	DEXIA CREDIT LOCAL SA 0.625% 03/02/2024 EMTN	EUR	8.029.670,32	3,98
6.000.000	FRANCE GOVERNMENT BOND OAT ZCP 25/02/2025	EUR	5.946.578,70	2,95
19.000.000	FRANCE GOVERNMENT BOND OAT ZCP 25/03/2025	EUR	18.839.610,36	9,35
1.000.000	UNEDIC ASSEO 0.875% 25/10/2022 EMTN	EUR	1.006.580,35	0,50
			<b>34.824.285,08</b>	<b>17,28</b>
<b>Spanien</b>				
28.700.000	SPAIN GOVERNMENT BOND ZCP 31/05/2024	EUR	28.577.758,38	14,17
2.000.000	SPAIN GOVERNMENT BOND 4.800% 31/01/2024	EUR	2.172.101,70	1,08
			<b>30.749.860,08</b>	<b>15,25</b>
<b>Deutschland</b>				
6.000.000	BUNDESSCHATZANWEISUNGEN ZCP 15/03/2024	EUR	6.008.774,40	2,98
2.000.000	VOLKSWAGEN FINANCIAL SERVICES AG 2.500% 06/04/2023 EMTN	EUR	2.043.669,24	1,01
7.000.000	VOLKSWAGEN LEASING GMBH 1.125% 04/04/2024 EMTN	EUR	7.016.402,89	3,49
			<b>15.068.846,53</b>	<b>7,48</b>
<b>Vereinigte Staaten</b>				
3.000.000	FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES INC 0.125% 03/12/2022	EUR	3.003.615,48	1,49
4.500.000	FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES INC 0.750% 21/05/2023	EUR	4.524.205,14	2,24
1.000.000	GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE 1.375% 26/07/2022 EMTN	EUR	1.005.042,91	0,50
1.600.000	MORGAN STANLEY 1.875% 30/03/2023	EUR	1.630.444,08	0,81
			<b>10.163.307,61</b>	<b>5,04</b>
<b>Belgien</b>				
8.000.000	KBC GROUP NV 23/02/2025 FRN EMTN	EUR	7.990.388,00	3,96
			<b>7.990.388,00</b>	<b>3,96</b>
<b>Irland</b>				
5.200.000	IRELAND GOVERNMENT BOND 3.900% 20/03/2023	EUR	5.413.239,83	2,68
2.000.000	IRELAND GOVERNMENT BOND 5.400% 13/03/2025	EUR	2.297.123,34	1,14
			<b>7.710.363,17</b>	<b>3,82</b>
<b>Finnland</b>				
6.000.000	NORDEA BANK ABP 0.875% 26/06/2023 EMTN	EUR	6.053.731,74	3,00
			<b>6.053.731,74</b>	<b>3,00</b>
<b>Schweiz</b>				
2.000.000	CREDIT SUISSE AG/LONDON 1.000% 07/06/2023 EMTN	EUR	2.019.049,96	1,00

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
1.000.000	UBS AG/LONDON 0.625% 23/01/2023 GMTN	EUR	1.005.810,80	0,50
3.000.000	UBS AG/LONDON 0.750% 21/04/2023 EMTN	EUR	3.023.215,08	1,50
			<b>6.048.075,84</b>	<b>3,00</b>
<b>Luxemburg</b>				
5.500.000	BANK OF CHINA LUXEMBOURG SA 0.125% 16/01/2023	EUR	5.487.144,36	2,73
			<b>5.487.144,36</b>	<b>2,73</b>
<b>Kanada</b>				
5.500.000	TORONTO-DOMINION BANK/THE 0.375% 25/04/2024 EMTN	EUR	5.462.771,88	2,71
			<b>5.462.771,88</b>	<b>2,71</b>
<b>Dänemark</b>				
1.500.000	DANSKE BANK A/S 0.875% 22/05/2023 EMTN	EUR	1.509.798,69	0,75
2.850.000	NYKREDIT REALKREDIT AS 11/10/2023 FRN EMTN	EUR	2.880.847,12	1,43
			<b>4.390.645,81</b>	<b>2,18</b>
<b>Niederlande</b>				
2.417.000	BMW FINANCE NV 0.625% 06/10/2023 EMTN	EUR	2.426.665,29	1,20
			<b>2.426.665,29</b>	<b>1,20</b>
			<b>198.546.575,22</b>	<b>98,49</b>
<b>Geldmarktinstrument</b>				
<b>Frankreich</b>				
2.000.000	FRANCE TREASURY BILL BTF ZCP 02/11/2022	EUR	2.006.711,66	1,00
			<b>2.006.711,66</b>	<b>1,00</b>
			<b>2.006.711,66</b>	<b>1,00</b>
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>			<b>200.553.286,88</b>	<b>99,49</b>

### Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022

Stückzahl	Bezeichnung	Währung	Engagement in EUR	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR
<b>Zins-Future</b>				
370	EURO-SCHATZ FUTURE 08/06/2022	EUR	40.971.950,00	(125.640,00)
			<b>40.971.950,00</b>	<b>(125.640,00)</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>				<b>(125.640,00)</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Euro Short Duration

(ausgedrückt in EUR)

### Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick

		% NIW
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	200.553.286,88	99,49
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	(125.640,00)	(0,06)
<b>Bankguthaben</b>	41.943,00	0,02
<b>Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>	1.115.678,26	0,55
<b>Nettovermögen Gesamt</b>	201.585.268,14	100,00

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Euro Sustainable Credit

(ausgedrückt in EUR)

### Statistische Angaben

<b>Nettovermögen</b>	31.03.2022	EUR	1.117.723.129,16	<b>Anzahl der Anteile</b>			
	30.09.2021	EUR	1.180.733.751,17				
	30.09.2020	EUR	971.708.644,25				
<b>Nettoinventarwert pro Anteil**</b>				Capitalisation X (EUR)	31.03.2022	8	
					30.09.2021	8	
					30.09.2020	-	
Capitalisation I (EUR)	31.03.2022	EUR	5.481,62	Capitalisation Z (EUR)	31.03.2022	8.114	
	30.09.2021	EUR	5.820,73		30.09.2021	7.930	
	30.09.2020	EUR	5.721,40		30.09.2020	6.751	
Capitalisation N (EUR)	31.03.2022	EUR	25,56	Distribution P (EUR)	31.03.2022	57.276	
	30.09.2021	EUR	27,13		30.09.2021	66.550	
	30.09.2020	EUR	26,66		30.09.2020	28.979	
Capitalisation P (EUR)	31.03.2022	EUR	239,53	Distribution R (EUR)	31.03.2022	11.831	
	30.09.2021	EUR	254,82		30.09.2021	9.050	
	30.09.2020	EUR	251,40		30.09.2020	6.832	
Capitalisation T (EUR)	31.03.2022	EUR	5.515,41	<b>Laufende Kosten in %*</b>			
	30.09.2021	EUR	5.851,65		Capitalisation I (EUR)	31.03.2022	0,49%
	30.09.2020	EUR	5.742,04		Capitalisation N (EUR)	31.03.2022	0,43%
Capitalisation X (EUR)	31.03.2022	EUR	234,81	Capitalisation P (EUR)	31.03.2022	0,85%	
	30.09.2021	EUR	249,97	Capitalisation T (EUR)	31.03.2022	0,32%	
	30.09.2020	EUR	-	Capitalisation X (EUR)	31.03.2022	0,90%	
Capitalisation Z (EUR)	31.03.2022	EUR	4.808,27	Capitalisation Z (EUR)	31.03.2022	0,13%	
	30.09.2021	EUR	5.096,56	Distribution P (EUR)	31.03.2022	0,85%	
	30.09.2020	EUR	4.991,59	Distribution R (EUR)	31.03.2022	0,56%	
Distribution P (EUR)	31.03.2022	EUR	255,88	<b>Portfolioumsatz in %*</b>	31.03.2022	65,39%	
	30.09.2021	EUR	272,19				
	30.09.2020	EUR	268,52				
Distribution R (EUR)	31.03.2022	EUR	252,38				
	30.09.2021	EUR	268,09				
	30.09.2020	EUR	263,95				
<b>Anzahl der Anteile</b>							
	31.03.2022		142.855				
	30.09.2021		141.511				
Capitalisation I (EUR)	30.09.2020		134.006				
	31.03.2022		4.591.148				
	30.09.2021		4.725.123				
Capitalisation N (EUR)	30.09.2020		2.065.578				
	31.03.2022		38.081				
	30.09.2021		18.220				
Capitalisation P (EUR)	30.09.2020		2.667				
	31.03.2022		27.471				
	30.09.2021		27.893				
Capitalisation T (EUR)	30.09.2020		18.459				

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

## NN (L) Euro Sustainable Credit

(ausgedrückt in EUR)

### Finanzabschlüsse

#### Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022

	Erläuterungen	
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	2	<b>1.090.688.358,07</b>
Anleihen und andere Schuldtitel		1.090.688.358,07
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	2	<b>126.890,23</b>
Credit Default Swaps		58.049,94
Devisentermingeschäfte		68.840,29
<b>Bankguthaben</b>		<b>34.712.541,95</b>
<b>Hinterlegte Sicherheiten</b>		<b>982.807,33</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte</b>	4, 12	<b>38.319.207,39</b>
<b>Vermögenswerte Gesamt</b>		<b>1.164.829.804,97</b>
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>	4	<b>(45.614.245,43)</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	2	<b>(1.492.430,38)</b>
Zinsswaps		(1.145.669,99)
Futures		(346.760,39)
<b>Verbindlichkeiten Gesamt</b>		<b>(47.106.675,81)</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Berichtszeitraums</b>		<b>1.117.723.129,16</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Euro Sustainable Credit

(ausgedrückt in EUR)

## Wertpapierbestand zum 31.03.2022

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW	Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
<b>Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>									
<b>Anleihen und andere Schuldtitel</b>									
<b>Niederlande</b>									
3.982.000	AGCO INTERNATIONAL HOLDINGS BV 0.800% 06/10/2028	EUR	3.588.716,81	0,32	500.000	ING GROEP NV 09/06/2032 FRN EMTN	EUR	465.464,71	0,04
561.000	AKELIUS RESIDENTIAL PROPERTY FINANCING BV 1.125% 11/01/2029 EMTN	EUR	507.174,92	0,05	1.500.000	ING GROEP NV 11/04/2028 FRN EMTN	EUR	1.533.726,81	0,14
2.700.000	ALLIANDER NV FRN PERP	EUR	2.672.534,25	0,24	3.500.000	ING GROEP NV 15/02/2029 FRN EMTN	EUR	3.566.372,78	0,32
700.000	ALLIANDER NV 0.875% 22/04/2026 EMTN	EUR	694.701,78	0,06	1.700.000	ING GROEP NV 18/02/2029 FRN	EUR	1.552.253,00	0,14
1.080.000	ALLIANDER NV 2.875% 14/06/2024 EMTN	EUR	1.139.718,50	0,10	2.500.000	ING GROEP NV 26/05/2031 FRN EMTN	EUR	2.495.191,43	0,22
2.300.000	ARGENTUM NETHERLANDS BV FOR GIVAUDAN SA 1.125% 17/09/2025	EUR	2.300.883,94	0,21	1.400.000	ING GROEP NV 29/11/2030 FRN EMTN	EUR	1.296.304,30	0,12
1.355.000	ASML HOLDING NV 0.250% 25/02/2030	EUR	1.243.713,77	0,11	1.360.000	KONINKLIJKE DSM NV 0.625% 23/06/2032 EMTN	EUR	1.219.508,44	0,11
5.070.000	ATRADUIS FINANCE BV 23/09/2044 FRN	EUR	5.361.244,93	0,48	3.200.000	LINDE FINANCE BV 0.550% 19/05/2032 EMTN	EUR	2.932.393,31	0,26
163.000	BMW FINANCE NV 1.000% 22/05/2028 EMTN	EUR	159.783,58	0,01	3.000.000	NATURGY FINANCE BV 0.750% 28/11/2029 EMTN	EUR	2.833.351,59	0,25
5.200.000	BRENNTAG FINANCE BV 0.500% 06/10/2029 EMTN	EUR	4.682.365,69	0,42	3.200.000	NATURGY FINANCE BV 1.250% 15/01/2026 EMTN	EUR	3.202.374,91	0,29
200.000	CITYCON TREASURY BV 1.625% 12/03/2028 EMTN	EUR	170.152,78	0,02	600.000	NIBC BANK NV 0.875% 08/07/2025 EMTN	EUR	589.268,13	0,05
400.000	COOPERATIEVE RABOBANK UA 01/12/2027 FRN GMTN	EUR	379.799,62	0,03	1.000.000	NIBC BANK NV 0.875% 24/06/2027 EMTN	EUR	940.158,72	0,08
800.000	COOPERATIEVE RABOBANK UA 10/04/2029 FRN EMTN	USD	721.787,67	0,06	800.000	NIBC BANK NV 1.125% 19/04/2023 EMTN	EUR	804.178,13	0,07
700.000	CTP NV 0.625% 27/11/2023 EMTN	EUR	692.077,96	0,06	5.689.000	NOVO NORDISK FINANCE NETHERLANDS BV 1.125% 30/09/2027 EMTN	EUR	5.680.543,93	0,51
3.447.000	CTP NV 0.750% 18/02/2027 EMTN	EUR	3.103.377,95	0,28	2.500.000	PROSUS NV 2.085% 19/01/2030	EUR	2.149.880,08	0,19
1.940.000	CTP NV 0.875% 20/01/2026 EMTN	EUR	1.828.088,93	0,16	3.219.000	RECKITT BENCKISER TREASURY SERVICES NEDERLAND BV 0.750% 19/05/2030	EUR	3.060.638,95	0,27
1.060.000	CTP NV 1.250% 21/06/2029 EMTN	EUR	929.004,26	0,08	1.700.000	REPSOL INTERNATIONAL FINANCE BV FRN PERP	EUR	1.612.563,00	0,14
2.100.000	CTP NV 1.500% 27/09/2031 EMTN	EUR	1.770.626,68	0,16	2.323.000	SAGAX EURO MTN NL BV 0.750% 26/01/2028 EMTN	EUR	2.040.182,07	0,18
3.895.000	DAMFOSS FINANCE I BV 0.375% 28/10/2028 EMTN	EUR	3.561.659,63	0,32	2.417.000	SAGAX EURO MTN NL BV 1.625% 24/02/2026 EMTN	EUR	2.366.391,14	0,21
800.000	DE VOLKSBANK NV 0.010% 16/09/2024 EMTN	EUR	788.505,08	0,07	2.000.000	SIEMENS FINANCIERINGSMAATSCHAPPIJ NV 1.250% 25/02/2035 EMTN	EUR	1.944.505,98	0,17
2.000.000	DE VOLKSBANK NV 0.375% 03/03/2028 EMTN	EUR	1.819.653,18	0,16	1.195.000	SIGNIFY NV 2.000% 11/05/2024	EUR	1.216.766,32	0,11
2.400.000	DE VOLKSBANK NV 22/10/2030 FRN EMTN	EUR	2.365.098,24	0,21	1.600.000	SIGNIFY NV 2.375% 11/05/2027	EUR	1.634.764,26	0,15
3.500.000	DEUTSCHE TELEKOM INTERNATIONAL FINANCE BV 1.125% 22/05/2026 EMTN	EUR	3.514.216,65	0,31	6.711.000	STELLANTIS NV 2.750% 01/04/2032 EMTN	EUR	6.757.680,58	0,60
1.000.000	DEUTSCHE TELEKOM INTERNATIONAL FINANCE BV 1.375% 30/01/2027 EMTN	EUR	1.011.597,45	0,09	6.854.000	STELLANTIS NV 3.375% 07/07/2023	EUR	7.055.904,52	0,63
1.109.000	DEUTSCHE TELEKOM INTERNATIONAL FINANCE BV 1.500% 03/04/2028 EMTN	EUR	1.123.861,42	0,10	2.000.000	TELEFONICA EUROPE BV FRN PERP	EUR	2.017.798,00	0,18
200.000	DIGITAL DUTCH FINCO BV 1.250% 01/02/2031	EUR	176.986,29	0,02	3.835.000	TENNET HOLDING BV FRN PERP	EUR	3.920.693,88	0,35
1.300.000	DIGITAL DUTCH FINCO BV 1.500% 15/03/2030	EUR	1.196.304,82	0,11	3.429.000	TENNET HOLDING BV 0.875% 16/06/2035 EMTN	EUR	3.028.384,31	0,27
1.900.000	EDP FINANCE BV 1.875% 21/09/2029 EMTN	EUR	1.908.798,94	0,17	2.863.000	TENNET HOLDING BV 1.500% 03/06/2039 EMTN	EUR	2.659.469,96	0,24
2.935.000	ELM BV FOR FIRMENICH INTERNATIONAL SA FRN PERP	EUR	2.965.219,70	0,27	765.000	VESTEDA FINANCE BV 0.750% 18/10/2031 EMTN	EUR	681.786,97	0,06
7.030.000	ELM BV FOR SWISS REINSURANCE CO LTD FRN PERP	EUR	7.033.888,79	0,64	1.500.000	VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV FRN PERP	EUR	1.563.639,26	0,14
6.988.000	ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV 0.500% 17/06/2030 EMTN	EUR	6.255.070,54	0,57	2.500.000	VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV FRN PERP	EUR	2.519.184,43	0,23
2.574.000	ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV 0.875% 17/06/2036 EMTN	EUR	2.130.011,15	0,19	3.500.000	VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV FRN PERP	EUR	3.521.639,10	0,32
5.217.000	ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV 0.875% 28/09/2034 EMTN	EUR	4.486.873,60	0,40	11.700.000	VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV FRN PERP	EUR	11.766.329,87	1,06
1.000.000	ENEXIS HOLDING NV 0.625% 17/06/2032 EMTN	EUR	909.297,16	0,08	600.000	VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV 1.875% 30/03/2027	EUR	601.130,96	0,05
2.400.000	ENEXIS HOLDING NV 0.875% 28/04/2026 EMTN	EUR	2.382.139,18	0,21	3.600.000	VONOVIA FINANCE BV 0.625% 07/10/2027 EMTN	EUR	3.360.427,02	0,30
5.200.000	E.ON INTERNATIONAL FINANCE BV 5.750% 14/02/2033 EMTN	EUR	7.032.246,83	0,63	2.500.000	VONOVIA FINANCE BV 1.000% 09/07/2030 EMTN	EUR	2.278.009,13	0,20
2.368.000	HEIMSTADEN BOSTAD TREASURY BV 0.250% 13/10/2024 EMTN	EUR	2.299.240,48	0,21	100.000	VONOVIA FINANCE BV 2.250% 15/12/2023 EMTN	EUR	102.858,99	0,01
2.596.000	HEIMSTADEN BOSTAD TREASURY BV 0.625% 24/07/2025 EMTN	EUR	2.503.162,26	0,22	2.966.000	WOLTERS KLUWER NV 0.750% 03/07/2030	EUR	2.733.515,28	0,24
2.046.000	HEIMSTADEN BOSTAD TREASURY BV 0.750% 06/09/2029 EMTN	EUR	1.745.676,09	0,16	1.300.000	ZF EUROPE FINANCE BV 2.000% 23/02/2026	EUR	1.220.265,12	0,11
458.000	HEIMSTADEN BOSTAD TREASURY BV 1.000% 13/04/2028 EMTN	EUR	413.380,15	0,04	<b>Vereinigte Staaten</b>				
484.000	HEIMSTADEN BOSTAD TREASURY BV 1.375% 24/07/2028 EMTN	EUR	444.513,49	0,04	2.318.000	AMERICAN TOWER CORP 0.400% 15/02/2027	EUR	2.163.137,48	0,19
2.046.000	HEIMSTADEN BOSTAD TREASURY BV 1.625% 13/10/2031 EMTN	EUR	1.799.933,68	0,16	4.000.000	AMERICAN TOWER CORP 0.875% 21/05/2029	EUR	3.656.392,96	0,33
1.500.000	IBERDROLA INTERNATIONAL BV FRN PERP	EUR	1.511.879,00	0,14	2.695.000	AMERICAN TOWER CORP 0.950% 05/10/2030	EUR	2.434.873,05	0,22
					2.100.000	AT&T INC 0.800% 04/03/2030	EUR	1.960.966,79	0,18
					8.045.000	AT&T INC 1.600% 19/05/2028	EUR	8.101.177,27	0,72
					2.800.000	AT&T INC 2.050% 19/05/2032	EUR	2.849.989,83	0,25
					1.800.000	AT&T INC 2.350% 05/09/2029	EUR	1.881.680,85	0,17
					3.300.000	AT&T INC 2.600% 17/12/2029	EUR	3.505.779,12	0,31
					2.300.000	AT&T INC 3.150% 04/09/2036	EUR	2.529.281,80	0,23
					10.050.000	AUTOLIV INC 0.750% 26/06/2023	EUR	10.075.078,07	0,89
					9.005.000	BANK OF AMERICA CORP 07/02/2025 FRN EMTN	EUR	9.083.219,41	0,81
					600.000	BANK OF AMERICA CORP 0.750% 26/07/2023 EMTN	EUR	604.301,96	0,05
					1.471.000	BANK OF AMERICA CORP 22/03/2031 FRN EMTN	EUR	1.340.559,41	0,12
					700.000	BANK OF AMERICA CORP 2.375% 19/06/2024 EMTN	EUR	724.384,16	0,06
								<b>194.250.467,19</b>	<b>17,38</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Euro Sustainable Credit

(ausgedrückt in EUR)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW	Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
500.000	BANK OF AMERICA CORP 24/08/2028 FRN EMTN	EUR	470.516,28	0,04	100.000	ARKEMA SA 3.125% 06/12/2023 EMTN	EUR	103.876,34	0,01
178.000	CELANESE US HOLDINGS LLC 1.125% 26/09/2023	EUR	178.599,95	0,02	1.800.000	BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL SA 0.010% 07/03/2025 EMTN	EUR	1.749.894,23	0,16
2.880.000	CELANESE US HOLDINGS LLC 1.250% 11/02/2025	EUR	2.821.322,94	0,25	5.600.000	BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL SA 0.010% 11/05/2026 EMTN	EUR	5.313.421,57	0,48
2.280.000	CITIGROUP INC 06/07/2026 FRN EMTN	EUR	2.271.781,06	0,20	600.000	BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL SA 0.100% 08/10/2027 EMTN	EUR	556.525,85	0,05
500.000	CITIGROUP INC 24/07/2026 FRN EMTN	EUR	501.877,10	0,04	1.500.000	BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL SA 0.250% 19/07/2028	EUR	1.369.691,33	0,12
3.835.000	COCA-COLA CO/THE 1.125% 09/03/2027	EUR	3.856.722,44	0,35	5.700.000	BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL SA 0.750% 08/06/2026 EMTN	EUR	5.584.127,44	0,50
500.000	COCA-COLA CO/THE 1.250% 08/03/2031	EUR	492.502,18	0,04	5.600.000	BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL SA 0.750% 17/07/2025 EMTN	EUR	5.536.824,22	0,50
2.000.000	COCA-COLA CO/THE 1.625% 09/03/2035	EUR	1.995.016,30	0,18	1.900.000	BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL SA 1.125% 19/11/2031 EMTN	EUR	1.695.925,67	0,15
200.000	DIGITAL EURO FINCO LLC 1.125% 09/04/2028	EUR	186.900,17	0,02	500.000	BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL SA 2.375% 24/03/2026 EMTN	EUR	512.010,56	0,05
4.251.000	ELI LILLY & CO 1.125% 14/09/2051	EUR	3.460.160,84	0,31	1.900.000	BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL SA 2.500% 25/05/2028 EMTN	EUR	1.938.613,93	0,17
6.136.000	EMERSON ELECTRIC CO 2.000% 15/10/2029 EMTN	EUR	6.330.037,68	0,57	300.000	BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL SA 3.000% 21/05/2024 EMTN	EUR	313.280,77	0,03
3.012.000	EQUITABLE FINANCIAL LIFE GLOBAL FUNDING 0.600% 16/06/2028 EMTN	EUR	2.794.190,38	0,25	2.500.000	BNP PARIBAS SA 04/06/2026 FRN	EUR	2.431.097,75	0,22
1.200.000	FORD MOTOR CREDIT CO LLC 1.514% 17/02/2023	EUR	1.201.680,65	0,11	1.500.000	BNP PARIBAS SA 11/07/2030 FRN EMTN	EUR	1.388.916,11	0,12
2.071.000	GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE 0.250% 26/01/2028 EMTN	EUR	1.894.334,69	0,17	3.700.000	BNP PARIBAS SA 13/04/2027 FRN EMTN	EUR	3.498.742,31	0,31
1.500.000	GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE 1.000% 18/03/2033 EMTN	EUR	1.329.711,81	0,12	2.000.000	BNP PARIBAS SA 14/10/2027 FRN EMTN	EUR	2.020.816,06	0,18
3.100.000	GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE 1.375% 15/05/2024 EMTN	EUR	3.131.818,99	0,28	6.200.000	BNP PARIBAS SA 15/01/2032 FRN EMTN	EUR	5.865.361,08	0,51
3.500.000	GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE 30/04/2024 FRN EMTN	EUR	3.478.072,05	0,31	1.200.000	BNP PARIBAS SA 15/07/2025 FRN EMTN	EUR	1.185.318,31	0,11
2.695.000	INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP 0.300% 11/02/2028	EUR	2.548.072,80	0,23	5.100.000	BNP PARIBAS SA 19/02/2028 FRN EMTN	EUR	4.790.564,33	0,43
1.397.000	INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCES INC 1.800% 25/09/2026	EUR	1.399.840,35	0,13	1.300.000	BNP PARIBAS SA 20/11/2030 FRN EMTN	EUR	1.320.753,56	0,12
9.300.000	JPMORGAN CHASE & CO 11/03/2027 FRN EMTN	EUR	9.164.679,51	0,82	1.500.000	BNP PARIBAS SA 23/01/2027 FRN EMTN	EUR	1.531.026,78	0,14
2.900.000	JPMORGAN CHASE & CO 18/05/2028 FRN EMTN	EUR	2.898.154,64	0,26	1.900.000	BNP PARIBAS SA 30/05/2028 FRN EMTN	EUR	1.785.002,94	0,16
1.045.000	JPMORGAN CHASE & CO 24/02/2028 FRN EMTN	EUR	984.202,98	0,09	1.200.000	BNP PARIBAS SA 31/03/2032 FRN EMTN	EUR	1.204.116,96	0,11
1.710.000	LINDE INC/CT 1.625% 01/12/2025	EUR	1.752.163,93	0,16	1.900.000	BPCE SA 0.250% 14/01/2031	EUR	1.676.482,78	0,15
2.600.000	MMS USA HOLDINGS INC 0.625% 13/06/2025	EUR	2.554.869,77	0,23	4.900.000	BPCE SA 0.625% 15/01/2030	EUR	4.531.873,29	0,41
3.700.000	MORGAN STANLEY 1.750% 30/01/2025 GMTN	EUR	3.784.577,63	0,34	2.600.000	BPCE SA 30/11/2027 FRN EMTN	EUR	2.637.962,42	0,24
2.498.000	MORGAN STANLEY 23/10/2026 FRN EMTN	EUR	2.492.457,76	0,22	300.000	CAPGEMINI SE 1.625% 15/04/2026	EUR	305.020,92	0,03
983.000	MORGAN STANLEY 29/04/2033 FRN	EUR	903.068,64	0,08	2.500.000	CARREFOUR SA 1.875% 30/10/2026 EMTN	EUR	2.511.420,95	0,22
5.900.000	MORGAN STANLEY 29/10/2027 FRN	EUR	5.591.200,90	0,50	1.200.000	CREDIT AGRICOLE ASSURANCES SA FRN PERP	EUR	1.279.244,53	0,11
630.000	NASDAQ INC 0.875% 13/02/2030	EUR	577.698,50	0,05	400.000	CREDIT AGRICOLE ASSURANCES SA 27/09/2048 FRN	EUR	440.797,73	0,04
100.000	NATIONAL GRID NORTH AMERICA INC 1.000% 12/07/2024 EMTN	EUR	100.176,18	0,01	4.300.000	CREDIT AGRICOLE SA 05/06/2030 FRN EMTN	EUR	4.264.071,78	0,38
2.000.000	NETFLIX INC 3.625% 15/05/2027	EUR	2.133.785,00	0,19	3.900.000	CREDIT AGRICOLE SA 2.000% 25/03/2029 EMTN	EUR	3.845.945,81	0,34
2.500.000	NETFLIX INC 3.625% 15/06/2030	EUR	2.644.107,48	0,24	2.300.000	CREDIT AGRICOLE SA 22/04/2026 FRN EMTN	EUR	2.277.051,29	0,20
4.200.000	NETFLIX INC 3.875% 15/11/2029	EUR	4.556.763,16	0,41	1.000.000	CREDIT AGRICOLE SA/LONDON 0.500% 24/06/2024 EMTN	EUR	994.792,66	0,09
2.385.000	NEW YORK LIFE GLOBAL FUNDING 0.250% 04/10/2028 GMTN	EUR	2.206.106,90	0,20	3.500.000	CREDIT AGRICOLE SA/LONDON 1.250% 14/04/2026 EMTN	EUR	3.508.368,92	0,31
5.779.000	NEW YORK LIFE GLOBAL FUNDING 0.250% 23/01/2027 GMTN	EUR	5.474.417,17	0,49	2.600.000	CREDIT AGRICOLE SA/LONDON 1.375% 03/05/2027 EMTN	EUR	2.603.156,69	0,23
955.000	PEPSICO INC 0.400% 09/10/2032	EUR	843.280,91	0,08	300.000	CREDIT AGRICOLE SA/LONDON 1.375% 13/03/2025 EMTN	EUR	302.421,64	0,03
3.135.000	PEPSICO INC 0.500% 06/05/2028 EMTN	EUR	3.005.987,41	0,27	1.000.000	CREDIT AGRICOLE SA/LONDON 1.875% 20/12/2026 EMTN	EUR	1.016.128,61	0,09
1.800.000	PROCTER & GAMBLE CO/THE 1.200% 30/10/2028	EUR	1.828.273,28	0,16	1.000.000	CREDIT MUTUEL ARKEA SA 0.010% 28/01/2026 EMTN	EUR	956.973,11	0,09
1.800.000	PROCTER & GAMBLE CO/THE 4.875% 11/05/2027	EUR	2.152.050,64	0,19	1.000.000	CREDIT MUTUEL ARKEA SA 0.875% 07/05/2027 EMTN	EUR	970.483,89	0,09
2.218.000	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC 1.950% 24/07/2029	EUR	2.273.394,26	0,20	400.000	CREDIT MUTUEL ARKEA SA 25/10/2029 FRN EMTN	EUR	398.710,70	0,04
3.448.000	VERIZON COMMUNICATIONS INC 0.375% 22/03/2029	EUR	3.199.706,93	0,29	2.400.000	ELO SACA 2.875% 29/01/2026 EMTN	EUR	2.408.399,59	0,22
1.694.000	VERIZON COMMUNICATIONS INC 0.875% 08/04/2027	EUR	1.662.679,02	0,15	3.800.000	ESSILORLUXOTTICA SA 0.125% 27/05/2025 EMTN	EUR	3.710.202,05	0,33
3.887.000	VERIZON COMMUNICATIONS INC 1.125% 19/09/2035	EUR	3.511.204,33	0,31	1.000.000	ESSILORLUXOTTICA SA 0.500% 05/06/2028 EMTN	EUR	959.379,17	0,09
4.000.000	VERIZON COMMUNICATIONS INC 1.250% 08/04/2030	EUR	3.905.454,92	0,35	1.000.000	EUTELSAT SA 1.500% 13/10/2028	EUR	962.678,90	0,09
2.400.000	ZF NORTH AMERICA CAPITAL INC 2.750% 27/04/2023	EUR	2.441.196,22	0,22	490.000	FIRMENICH PRODUCTIONS PARTICIPATIONS SAS 1.375% 30/10/2026	EUR	487.016,38	0,04
			<b>163.895.638,89</b>	<b>14,66</b>	1.000.000	HSBC CONTINENTAL EUROPE SA 0.100% 03/09/2027 EMTN	EUR	929.186,33	0,08
	<b>Frankreich</b>				800.000	ICADE SANTE SACA 1.375% 17/09/2030	EUR	756.075,90	0,07
2.900.000	ALSTOM SA ZCP 11/01/2029	EUR	2.540.005,72	0,23	1.000.000	IMERYS SA 1.000% 15/07/2031	EUR	858.695,11	0,08
2.000.000	APRR SA ZCP 19/06/2028 EMTN	EUR	1.839.630,68	0,16	2.100.000	IMERYS SA 1.500% 15/01/2027 EMTN	EUR	2.064.677,39	0,18
600.000	APRR SA 1.250% 06/01/2027 EMTN	EUR	600.093,14	0,05	3.000.000	JCDECAUX SA 1.625% 07/02/2030	EUR	2.843.760,96	0,25
800.000	APRR SA 1.500% 25/01/2030 EMTN	EUR	800.776,40	0,07	1.700.000	KERING SA 0.750% 13/05/2028 EMTN	EUR	1.646.935,10	0,15
2.000.000	APRR SA 1.625% 13/01/2032 EMTN	EUR	1.996.948,46	0,18	900.000	LA POSTE SA 1.375% 21/04/2032 EMTN	EUR	881.626,94	0,08

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.











## NN (L) Euro Sustainable Credit

(ausgedrückt in EUR)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
500.000	HEATHROW FUNDING LTD 1.500% 11/02/2030 EMTN	EUR	470.796,58	0,04
2.000.000	HEATHROW FUNDING LTD 1.875% 14/03/2034 EMTN	EUR	1.842.505,78	0,16
			<b>16.473.102,60</b>	<b>1,48</b>
<b>Australien</b>				
3.747.000	TOYOTA FINANCE AUSTRALIA LTD 2.280% 21/10/2027 EMTN	EUR	3.926.990,48	0,35
1.100.000	TRANSURBAN FINANCE CO PTY LTD 1.750% 29/03/2028 EMTN	EUR	1.095.583,93	0,10
3.200.000	TRANSURBAN FINANCE CO PTY LTD 1.875% 16/09/2024 EMTN	EUR	3.265.579,20	0,29
2.367.000	TRANSURBAN FINANCE CO PTY LTD 3.000% 08/04/2030 EMTN	EUR	2.536.509,94	0,23
2.422.000	WESTPAC BANKING CORP 0.875% 17/04/2027 EMTN	EUR	2.362.737,22	0,21
1.629.000	WESTPAC BANKING CORP 13/05/2031 FRN	EUR	1.531.776,52	0,14
			<b>14.719.177,29</b>	<b>1,32</b>
<b>Island</b>				
300.000	ARION BANKI HF 0.625% 27/05/2024 EMTN	EUR	293.912,62	0,03
3.720.000	ISLANDSBANKI HF 19/01/2024 FRN GMTN	EUR	3.730.897,37	0,33
4.000.000	LANDSBANKINN HF 0.500% 20/05/2024 EMTN	EUR	3.912.750,96	0,35
1.755.000	LANDSBANKINN HF 1.000% 30/05/2023 EMTN	EUR	1.756.770,36	0,16
			<b>9.694.331,31</b>	<b>0,87</b>
<b>Norwegen</b>				
600.000	NORSK HYDRO ASA 1.125% 11/04/2025	EUR	592.490,20	0,05
5.800.000	SPAREBANK 1 SR-BANK ASA 0.250% 09/11/2026 EMTN	EUR	5.510.812,93	0,50
1.223.000	SPAREBANK 1 SR-BANK ASA 15/07/2027 FRN EMTN	EUR	1.164.817,87	0,10
			<b>7.268.121,00</b>	<b>0,65</b>
<b>Singapur</b>				
5.930.000	DBS GROUP HOLDINGS LTD 11/04/2028 FRN GMTN	EUR	5.970.372,33	0,53
			<b>5.970.372,33</b>	<b>0,53</b>
<b>Kanada</b>				
4.667.000	FAIRFAX FINANCIAL HOLDINGS LTD 2.750% 29/03/2028	EUR	4.693.664,44	0,42
700.000	GREAT-WEST LIFECO INC 1.750% 07/12/2026	EUR	706.219,05	0,06
300.000	MAGNA INTERNATIONAL INC 1.500% 25/09/2027	EUR	298.695,34	0,03
			<b>5.698.578,83</b>	<b>0,51</b>
<b>Bermuda</b>				
4.800.000	BACARDI LTD 2.750% 03/07/2023	EUR	4.916.533,01	0,44
			<b>4.916.533,01</b>	<b>0,44</b>
<b>Dänemark</b>				
3.742.000	CARLSBERG BREWERIES AS 0.375% 30/06/2027	EUR	3.501.465,66	0,32
490.000	CARLSBERG BREWERIES AS 0.625% 09/03/2030 EMTN	EUR	443.628,04	0,04
1.000.000	CARLSBERG BREWERIES AS 0.875% 01/07/2029 EMTN	EUR	931.032,47	0,08
			<b>4.876.126,17</b>	<b>0,44</b>
<b>Kaimaninseln</b>				
2.095.000	XLIT LTD 29/06/2047 FRN	EUR	2.152.576,32	0,19
			<b>2.152.576,32</b>	<b>0,19</b>
			<b>1.090.688.358,07</b>	<b>97,58</b>
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>			<b>1.090.688.358,07</b>	<b>97,58</b>

### Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022

Bezeichnung	Verkauf / Kauf	Zinssatz (%)	Fälligkeits- datum	Währung	Nennwert	Swap-Wert in EUR
<b>Credit Default Swaps</b>						
CDS MICHELIN LUXEMBOURG SCS 2.7500% 20/06/2019	Verkauf	1,000	20/12/2023	EUR	1.360.000,00	18.616,55
CDS HANNOVER RUECK SE 1.000% 20/06/2026	Verkauf	1,000	20/06/2026	EUR	3.000.000,00	16.430,58
CDS HANNOVER RUECK SE 1.000% 20/06/2026	Verkauf	1,000	20/06/2026	EUR	2.800.000,00	15.335,21
CDS HANNOVER RUECK SE 1.000% 20/06/2026	Verkauf	1,000	20/06/2026	EUR	1.400.000,00	7.667,60
						<b>58.049,94</b>
Zu erhalten (%)	Zu zahlen (%)	Fälligkeits- datum	Währung	Nennwert	Swap-Wert in EUR	
<b>Zinsswaps</b>						
0,789	Floating	20/12/2027	EUR	1.000.000,00	(12.337,62)	
0,432	Floating	25/02/2025	EUR	25.000.000,00	(244.584,00)	
0,837	Floating	16/02/2032	EUR	10.600.000,00	(342.338,45)	
-0,148	Floating	16/11/2024	EUR	24.000.000,00	(546.409,92)	
						<b>(1.145.669,99)</b>
Zu erhalten	Zu zahlen	Fälligkeits- datum	Engagement in EUR	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR		
<b>Devisentermingeschäfte</b>						
20.465.009,09	EUR	17.322.860,71	GBP	30/06/2022	20.465.009,09	44.235,32
4.081.470,41	EUR	4.528.735,08	USD	30/06/2022	4.081.470,41	25.677,31
2.719.103,39	USD	2.436.216,05	EUR	30/06/2022	2.436.216,05	(1.072,34)
					<b>26.982.695,55</b>	<b>68.840,29</b>
Stückzahl	Bezeichnung	Währung	Engagement in EUR	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR		
<b>Zins-Futures</b>						
(155)	EURO-BOBL FUTURE 08/06/2022	EUR	19.973.300,00	427.270,49		
(80)	EURO-BUND FUTURE 08/06/2022	EUR	12.692.800,00	81.475,22		
58	EURO-BUXL 30Y BOND 08/06/2022	EUR	10.799.600,00	(951.200,00)		
(33)	LONG GILT FUTURE 28/06/2022	GBP	4.734.082,15	71.071,76		
(6)	US LONG BOND (CBT) 21/06/2022	USD	809.216,73	23.358,27		
6	US 10YR NOTE (CBT) 21/06/2022	USD	662.607,29	(19.379,41)		
(3)	US 2YR NOTE (CBT) 30/06/2022	USD	571.397,68	7.372,60		

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Euro Sustainable Credit

(ausgedrückt in EUR)

### Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl	Bezeichnung	Währung	Engagement in EUR	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR
(5)	US 5YR NOTE (CBT) 30/06/2022	USD	515.379,95	13.270,68
			<b>50.758.383,80</b>	<b>(346.760,39)</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>			<b>(1.365.540,15)</b>	

### Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick

		% NIW
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	<b>1.090.688.358,07</b>	<b>97,58</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	<b>(1.365.540,15)</b>	<b>(0,12)</b>
<b>Bankguthaben</b>	<b>34.712.541,95</b>	<b>3,11</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>	<b>(6.312.230,71)</b>	<b>(0,57)</b>
<b>Nettovermögen Gesamt</b>	<b>1.117.723.129,16</b>	<b>100,00</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Euro Sustainable Credit (excluding Financials)

(ausgedrückt in EUR)

### Statistische Angaben

<b>Nettovermögen</b>	31.03.2022	EUR	485.814.544,53	<b>Anzahl der Anteile</b>			
	30.09.2021	EUR	508.800.479,02				
	30.09.2020	EUR	537.277.019,53				
<b>Nettoinventarwert pro Anteil**</b>				Capitalisation N (EUR)	31.03.2022	6.202	
					30.09.2021	6.430	
					30.09.2020	9.282	
Capitalisation I (EUR)	31.03.2022	EUR	8.022,38	Capitalisation O (EUR)	31.03.2022	22.832	
	30.09.2021	EUR	8.534,04		30.09.2021	23.322	
	30.09.2020	EUR	8.422,97		30.09.2020	197.023	
Capitalisation I Hedged (i) (NOK)	31.03.2022	NOK	47.416,57	Capitalisation P (EUR)	31.03.2022	125.565	
	30.09.2021	NOK	-		30.09.2021	121.997	
	30.09.2020	NOK	-		30.09.2020	116.670	
Capitalisation N (EUR)	31.03.2022	EUR	391,75	Capitalisation R (EUR)	31.03.2022	1.463	
	30.09.2021	EUR	416,61		30.09.2021	1.492	
	30.09.2020	EUR	410,93		30.09.2020	1.810	
Capitalisation O (EUR)	31.03.2022	EUR	392,12	Capitalisation X (EUR)	31.03.2022	46.280	
	30.09.2021	EUR	416,95		30.09.2021	45.055	
	30.09.2020	EUR	410,93		30.09.2020	27.459	
Capitalisation P (EUR)	31.03.2022	EUR	379,33	Distribution P (EUR)	31.03.2022	4.466	
	30.09.2021	EUR	404,25		30.09.2021	3.688	
	30.09.2020	EUR	400,42		30.09.2020	4.418	
Capitalisation R (EUR)	31.03.2022	EUR	384,01	Distribution P Duration Hedged (EUR)	31.03.2022	-	
	30.09.2021	EUR	408,65		30.09.2021	-	
	30.09.2020	EUR	403,61		30.09.2020	3.835	
Capitalisation X (EUR)	31.03.2022	EUR	300,52	Distribution R (EUR)	31.03.2022	639	
	30.09.2021	EUR	320,42		30.09.2021	659	
	30.09.2020	EUR	317,71		30.09.2020	683	
Distribution P (EUR)	31.03.2022	EUR	1.180,22	<b>Laufende Kosten in %*</b>			
	30.09.2021	EUR	1.257,75		Capitalisation I (EUR)	31.03.2022	0,49%
	30.09.2020	EUR	1.245,80				
Distribution P Duration Hedged (EUR)	31.03.2022	EUR	-	Capitalisation I Hedged (i) (NOK)	31.03.2022	0,51%	
	30.09.2021	EUR	-				
	30.09.2020	EUR	251,07	Capitalisation N (EUR)	31.03.2022	0,43%	
Distribution R (EUR)	31.03.2022	EUR	1.189,48	Capitalisation O (EUR)	31.03.2022	0,40%	
	30.09.2021	EUR	1.265,78				
	30.09.2020	EUR	1.251,01	Capitalisation P (EUR)	31.03.2022	0,85%	
<b>Anzahl der Anteile</b>				Capitalisation R (EUR)	31.03.2022	0,56%	
				Capitalisation X (EUR)	31.03.2022	0,95%	
				Distribution P (EUR)	31.03.2022	0,85%	
Capitalisation I (EUR)	31.03.2022		50.359	Distribution R (EUR)	31.03.2022	0,56%	
	30.09.2021		49.984				
	30.09.2020		46.184				
Capitalisation I Hedged (i) (NOK)	31.03.2022		473				
	30.09.2021		-				
	30.09.2020		-				

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

NN (L) Euro Sustainable Credit (excluding Financials)

(ausgedrückt in EUR)

Statistische Angaben (Fortsetzung)

Portfolioumsatz in %*	31.03.2022	63,09%
-----------------------	------------	--------

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

## NN (L) Euro Sustainable Credit (excluding Financials)

(ausgedrückt in EUR)

### Finanzabschlüsse

#### Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022

	Erläuterungen	
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	2	<b>459.118.662,27</b>
Anleihen und andere Schuldtitel		459.118.662,27
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	2	<b>53.798,41</b>
Credit Default Swaps		14.373,07
Devisentermingeschäfte		39.425,34
<b>Bankguthaben</b>		<b>28.362.577,66</b>
<b>Hinterlegte Sicherheiten</b>		<b>491.993,80</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte</b>	4, 12	<b>8.521.314,53</b>
<b>Vermögenswerte Gesamt</b>		<b>496.548.346,67</b>
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>	4, 12	<b>(9.998.776,12)</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	2	<b>(735.026,02)</b>
Zinsswaps		(473.287,14)
Futures		(261.738,88)
<b>Verbindlichkeiten Gesamt</b>		<b>(10.733.802,14)</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Berichtszeitraums</b>		<b>485.814.544,53</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Euro Sustainable Credit (excluding Financials)

(ausgedrückt in EUR)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW	Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW					
<b>Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>														
<b>Anleihen und andere Schuldtitel</b>														
<b>Niederlande</b>														
1.991.000	AGCO INTERNATIONAL HOLDINGS BV 0.800% 06/10/2028	EUR	1.794.358,41	0,37	2.519.000	TENNET HOLDING BV 1.500% 03/06/2039 EMTN	EUR	2.339.924,84	0,48					
205.000	AKZO NOBEL NV 1.625% 14/04/2030 EMTN	EUR	203.061,33	0,04	2.000.000	THERMO FISHER SCIENTIFIC FINANCE I BV 1.125% 18/10/2033	EUR	1.849.690,42	0,38					
1.865.000	ALLIANDER NV FRN PERP	EUR	1.846.028,29	0,38	1.500.000	UNILEVER FINANCE NETHERLANDS BV 1.125% 29/04/2028 EMTN	EUR	1.496.646,42	0,31					
1.730.000	ALLIANDER NV 0.375% 10/06/2030 EMTN	EUR	1.595.131,19	0,33	1.000.000	UNILEVER FINANCE NETHERLANDS BV 1.625% 12/02/2033 EMTN	EUR	1.014.000,70	0,21					
2.100.000	ALLIANDER NV 0.875% 22/04/2026 EMTN	EUR	2.084.105,33	0,43	400.000	VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV FRN PERP	EUR	405.970,05	0,08					
1.600.000	ALLIANDER NV 2.875% 14/06/2024 EMTN	EUR	1.688.471,86	0,35	400.000	VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV FRN PERP	EUR	416.970,47	0,09					
400.000	ARGENTUM NETHERLANDS BV FOR GIVAUDAN SA 2.000% 17/09/2030	EUR	405.406,00	0,08	500.000	VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV FRN PERP	EUR	503.091,30	0,10					
1.419.000	ASML HOLDING NV 0.250% 25/02/2030	EUR	1.302.457,44	0,27	700.000	VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV FRN PERP	EUR	689.275,49	0,14					
454.000	ASML HOLDING NV 0.625% 07/05/2029	EUR	435.415,76	0,09	1.100.000	VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV FRN PERP	EUR	1.098.821,00	0,23					
680.000	BMW FINANCE NV ZCP 24/03/2023 EMTN	EUR	680.616,03	0,14	1.200.000	VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV FRN PERP	EUR	1.254.229,91	0,26					
1.826.000	BMW FINANCE NV 1.000% 22/05/2028 EMTN	EUR	1.789.968,25	0,37	2.200.000	VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV FRN PERP	EUR	2.212.472,28	0,46					
2.600.000	BRENNTAG FINANCE BV 0.500% 06/10/2029 EMTN	EUR	2.341.182,84	0,48	3.200.000	VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV FRN PERP	EUR	3.224.556,06	0,66					
2.275.000	BRENNTAG FINANCE BV 1.125% 27/09/2025	EUR	2.262.016,05	0,47	2.741.000	WOLTERS KLUWER NV 0.750% 03/07/2030	EUR	2.526.151,51	0,52					
1.328.000	DANFOSS FINANCE I BV 0.375% 28/10/2028 EMTN	EUR	1.214.347,62	0,25	800.000	ZF EUROPE FINANCE BV 2.000% 23/02/2026	EUR	750.932,38	0,15					
999.000	DANFOSS FINANCE II BV 0.750% 28/04/2031 EMTN	EUR	893.862,27	0,18	<b>99.751.198,81 20,53</b>									
3.000.000	DEUTSCHE TELEKOM INTERNATIONAL FINANCE BV 0.875% 30/01/2024 EMTN	EUR	3.016.237,14	0,62	<b>Vereinigte Staaten</b>									
1.250.000	DEUTSCHE TELEKOM INTERNATIONAL FINANCE BV 1.500% 03/04/2028 EMTN	EUR	1.266.750,93	0,26	828.000	AMERICAN TOWER CORP 0.400% 15/02/2027	EUR	772.682,41	0,16					
800.000	EDP FINANCE BV 1.875% 21/09/2029 EMTN	EUR	803.704,82	0,17	2.000.000	AMERICAN TOWER CORP 0.875% 21/05/2029	EUR	1.828.196,48	0,38					
1.285.000	ELM BV FOR FIRMENICH INTERNATIONAL SA FRN PERP	EUR	1.298.230,77	0,27	1.573.000	AMERICAN TOWER CORP 0.950% 05/10/2030	EUR	1.421.170,80	0,29					
4.728.000	ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV 0.875% 28/09/2034 EMTN	EUR	4.066.309,83	0,83	8.135.000	AT&T INC 1.600% 19/05/2028	EUR	8.191.805,73	1,68					
300.000	ENEXIS HOLDING NV 0.625% 17/06/2032 EMTN	EUR	272.789,15	0,06	1.000.000	AT&T INC 2.350% 05/09/2029	EUR	1.045.378,25	0,22					
2.890.000	ENEXIS HOLDING NV 0.750% 02/07/2031 EMTN	EUR	2.689.897,53	0,55	2.500.000	AT&T INC 2.450% 15/03/2035	EUR	2.553.467,45	0,53					
1.700.000	ENEXIS HOLDING NV 0.875% 28/04/2026 EMTN	EUR	1.687.348,58	0,35	4.100.000	AT&T INC 2.600% 17/12/2029	EUR	4.355.664,97	0,89					
300.000	E.ON INTERNATIONAL FINANCE BV 1.500% 31/07/2029 EMTN	EUR	298.217,51	0,06	1.000.000	AT&T INC 3.150% 04/09/2036	EUR	1.099.687,74	0,23					
4.100.000	E.ON INTERNATIONAL FINANCE BV 5.750% 14/02/2033 EMTN	EUR	5.544.656,16	1,13	4.098.000	AUTOLIV INC 0.750% 26/06/2023	EUR	4.108.225,86	0,84					
700.000	IBERDROLA INTERNATIONAL BV FRN PERP	EUR	705.543,53	0,15	280.000	CELANESE US HOLDINGS LLC 1.125% 26/09/2023	EUR	280.943,75	0,06					
1.000.000	IBERDROLA INTERNATIONAL BV FRN PERP	EUR	945.305,12	0,19	2.956.000	CELANESE US HOLDINGS LLC 1.250% 11/02/2025	EUR	2.895.774,52	0,60					
2.900.000	KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV 0.250% 26/06/2025	EUR	2.813.861,18	0,58	1.000.000	COCA-COLA CO/THE 1.250% 08/03/2031	EUR	985.004,36	0,20					
670.000	KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV 1.750% 02/04/2027	EUR	680.924,73	0,14	2.045.000	COCA-COLA CO/THE 1.625% 09/03/2035	EUR	2.039.904,17	0,42					
630.000	KONINKLIJKE DSM NV 0.625% 23/06/2032 EMTN	EUR	564.919,35	0,12	2.322.000	ELI LILLY & CO 1.125% 14/09/2051	EUR	1.890.024,34	0,39					
3.000.000	LINDE FINANCE BV 0.550% 19/05/2032 EMTN	EUR	2.749.118,73	0,57	4.171.000	EMERSON ELECTRIC CO 2.000% 15/10/2029 EMTN	EUR	4.302.898,82	0,88					
3.000.000	NATURGY FINANCE BV 0.750% 28/11/2029 EMTN	EUR	2.833.351,59	0,58	550.000	FORD MOTOR CREDIT CO LLC 1.514% 17/02/2023	EUR	550.770,30	0,11					
3.700.000	NATURGY FINANCE BV 0.875% 15/05/2025 EMTN	EUR	3.693.798,28	0,76	1.200.000	ILLINOIS TOOL WORKS INC 0.625% 05/12/2027	EUR	1.160.459,44	0,24					
2.457.000	NOVO NORDISK FINANCE NETHERLANDS BV 1.125% 30/09/2027 EMTN	EUR	2.453.347,94	0,50	1.350.000	INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP 0.300% 11/02/2028	EUR	1.276.400,11	0,26					
1.500.000	PROSUS NV 2.085% 19/01/2030	EUR	1.289.928,05	0,27	1.620.000	INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP 1.250% 29/01/2027	EUR	1.628.482,26	0,34					
1.000.000	RELX FINANCE BV 0.500% 10/03/2028	EUR	940.472,35	0,19	1.693.000	INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCES INC 1.800% 25/09/2026	EUR	1.696.442,17	0,35					
1.300.000	REPSOL INTERNATIONAL FINANCE BV FRN PERP	EUR	1.233.136,41	0,25	1.500.000	MMS USA HOLDINGS INC 0.625% 13/06/2025	EUR	1.473.963,33	0,30					
300.000	SIEMENS FINANCIERINGSMAATSCHAPPIJ NV 0.250% 20/02/2029 EMTN	EUR	281.426,80	0,06	800.000	NETFLIX INC 3.625% 15/05/2027	EUR	853.514,00	0,18					
1.700.000	SIEMENS FINANCIERINGSMAATSCHAPPIJ NV 1.250% 25/02/2035 EMTN	EUR	1.652.830,08	0,34	1.500.000	NETFLIX INC 3.625% 15/06/2030	EUR	1.586.464,49	0,33					
1.695.000	SIGNIFY NV 2.000% 11/05/2024	EUR	1.725.873,56	0,36	1.200.000	NETFLIX INC 3.875% 15/11/2029	EUR	1.301.932,33	0,27					
950.000	SIGNIFY NV 2.375% 11/05/2027	EUR	970.641,28	0,20	500.000	PEPSICO INC 0.400% 09/10/2032	EUR	441.508,33	0,09					
3.257.000	STELLANTIS NV 2.750% 01/04/2032 EMTN	EUR	3.279.655,14	0,68	3.295.000	PEPSICO INC 0.500% 06/05/2028 EMTN	EUR	3.159.403,04	0,64					
3.414.000	STELLANTIS NV 3.375% 07/07/2023	EUR	3.514.569,30	0,72	2.500.000	PROCTER & GAMBLE CO/THE 4.875% 11/05/2027	EUR	2.988.959,23	0,62					
2.200.000	TELEFONICA EUROPE BV FRN PERP	EUR	2.219.577,80	0,46	1.700.000	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC 1.950% 24/07/2029	EUR	1.742.457,28	0,36					
1.255.000	TENNET HOLDING BV FRN PERP	EUR	1.283.043,24	0,26	2.069.000	VERIZON COMMUNICATIONS INC 0.375% 22/03/2029	EUR	1.920.009,76	0,40					
3.008.000	TENNET HOLDING BV 0.875% 16/06/2035 EMTN	EUR	2.656.570,43	0,55	3.027.000	VERIZON COMMUNICATIONS INC 0.875% 08/04/2027	EUR	2.971.032,71	0,61					
					1.749.000	VERIZON COMMUNICATIONS INC 1.125% 19/09/2035	EUR	1.579.906,45	0,33					
					1.000.000	VERIZON COMMUNICATIONS INC 1.250% 08/04/2030	EUR	976.363,73	0,20					
					300.000	VF CORP 0.625% 25/02/2032	EUR	265.692,08	0,05					
					<b>65.344.590,69 13,45</b>									

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Euro Sustainable Credit (excluding Financials)

(ausgedrückt in EUR)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW	Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
<b>Frankreich</b>					3.900.000	O2 TELEFONICA DEUTSCHLAND FINANZIERUNGS GMBH 1.750% 05/07/2025	EUR	3.963.566,96	0,83
1.800.000	ALSTOM SA ZCP 11/01/2029	EUR	1.576.555,27	0,32	1.300.000	SCHAEFFLER AG 2.750% 12/10/2025 EMTN	EUR	1.305.021,47	0,27
1.000.000	APRR SA ZCP 19/06/2028 EMTN	EUR	919.815,34	0,19	1.685.000	SYMRISE AG 1.250% 29/11/2025	EUR	1.665.063,10	0,34
500.000	APRR SA 1.250% 06/01/2027 EMTN	EUR	500.077,62	0,10	1.650.000	VOLKSWAGEN BANK GMBH 1.250% 15/12/2025 EMTN	EUR	1.623.882,83	0,33
2.100.000	APRR SA 1.625% 13/01/2032 EMTN	EUR	2.096.795,88	0,43	500.000	VOLKSWAGEN BANK GMBH 1.875% 31/01/2024 EMTN	EUR	509.047,33	0,10
3.100.000	APRR SA 1.875% 06/01/2031 EMTN	EUR	3.185.768,10	0,66	3.884.000	VOLKSWAGEN FINANCIAL SERVICES AG 0.125% 12/02/2027 EMTN	EUR	3.569.497,41	0,73
1.000.000	ARKEMA SA 3.125% 06/12/2023 EMTN	EUR	1.038.763,39	0,21	170.000	VOLKSWAGEN FINANCIAL SERVICES AG 1.375% 16/10/2023 EMTN	EUR	171.839,33	0,04
3.100.000	CAPGEMINI SE 2.500% 01/07/2023	EUR	3.173.667,07	0,65	500.000	VOLKSWAGEN FINANCIAL SERVICES AG 1.500% 01/10/2024 EMTN	EUR	502.995,25	0,10
1.000.000	CARREFOUR SA 1.000% 17/05/2027 EMTN	EUR	961.348,67	0,20	6.550.000	VOLKSWAGEN FINANCIAL SERVICES AG 3.375% 06/04/2028 EMTN	EUR	7.004.662,55	1,45
1.200.000	CARREFOUR SA 1.875% 30/10/2026 EMTN	EUR	1.205.482,06	0,25	2.000.000	VOLKSWAGEN LEASING GMBH 1.000% 16/02/2023 EMTN	EUR	2.014.396,64	0,41
2.100.000	ELO SACA 2.875% 29/01/2026 EMTN	EUR	2.107.349,64	0,43	300.000	VOLKSWAGEN LEASING GMBH 1.625% 15/08/2025 EMTN	EUR	299.627,46	0,06
1.200.000	ESSILORLUXOTTICA SA 0.125% 27/05/2025 EMTN	EUR	1.171.642,75	0,24				<b>48.878.263,17</b>	<b>10,06</b>
2.300.000	ESSILORLUXOTTICA SA 0.500% 05/06/2028 EMTN	EUR	2.206.572,09	0,45	<b>Luxemburg</b>				
840.000	FIRMENICH PRODUCTIONS PARTICIPATIONS SAS 1.375% 30/10/2026	EUR	834.885,22	0,17	5.415.000	CNH INDUSTRIAL FINANCE EUROPE SA 1.875% 19/01/2026 EMTN	EUR	5.492.378,35	1,13
1.650.000	FIRMENICH PRODUCTIONS PARTICIPATIONS SAS 1.750% 30/04/2030	EUR	1.634.752,70	0,34	1.616.000	DH EUROPE FINANCE II SARL 0.750% 18/09/2031	EUR	1.481.366,39	0,30
3.000.000	IMERYS SA 1.500% 15/01/2027 EMTN	EUR	2.949.539,13	0,61	1.985.000	HOLCIM FINANCE LUXEMBOURG SA FRN PERP	EUR	1.990.341,42	0,41
2.500.000	JCDECAUX SA 1.625% 07/02/2030	EUR	2.369.800,80	0,49	790.000	HOLCIM FINANCE LUXEMBOURG SA 0.500% 23/04/2031	EUR	683.223,83	0,14
2.600.000	KERING SA 0.750% 13/05/2028 EMTN	EUR	2.518.841,91	0,52	1.855.000	HOLCIM FINANCE LUXEMBOURG SA 0.500% 29/11/2026 EMTN	EUR	1.767.162,99	0,36
2.400.000	KERING SA 1.250% 10/05/2026 EMTN	EUR	2.413.743,29	0,50	345.000	HOLCIM FINANCE LUXEMBOURG SA 0.625% 19/01/2033 EMTN	EUR	285.622,48	0,06
1.200.000	KERING SA 1.500% 05/04/2027 EMTN	EUR	1.218.112,97	0,25	1.222.000	JOHN DEERE CASH MANAGEMENT SARL 2.200% 02/04/2032 EMTN	EUR	1.296.272,22	0,27
1.100.000	ORANGE SA FRN PERP EMTN	EUR	1.226.719,22	0,25	3.655.000	MEDTRONIC GLOBAL HOLDINGS SCA 0.375% 15/10/2028	EUR	3.434.161,68	0,71
1.000.000	ORANGE SA ZCP 04/09/2026 EMTN	EUR	952.568,72	0,20	2.700.000	MEDTRONIC GLOBAL HOLDINGS SCA 0.750% 15/10/2032	EUR	2.473.241,01	0,51
1.300.000	ORANGE SA 0.625% 16/12/2033 EMTN	EUR	1.159.881,76	0,24	1.300.000	MEDTRONIC GLOBAL HOLDINGS SCA 1.375% 15/10/2040	EUR	1.155.289,36	0,24
2.900.000	ORANGE SA 1.125% 15/07/2024 EMTN	EUR	2.937.694,75	0,60	1.600.000	MEDTRONIC GLOBAL HOLDINGS SCA 1.500% 02/07/2039	EUR	1.465.146,16	0,30
1.000.000	ORANGE SA 1.375% 20/03/2028 EMTN	EUR	1.003.542,56	0,21	2.000.000	MEDTRONIC GLOBAL HOLDINGS SCA 1.625% 07/03/2031	EUR	2.022.636,14	0,42
500.000	ORANGE SA 1.625% 07/04/2032 EMTN	EUR	502.850,35	0,10	2.500.000	REPSOL EUROPE FINANCE SARL 0.875% 06/07/2033 EMTN	EUR	2.204.705,28	0,45
1.700.000	PERNOD RICARD SA 0.500% 24/10/2027	EUR	1.621.590,73	0,33	3.283.000	SES SA 1.625% 22/03/2026 EMTN	EUR	3.251.903,72	0,67
800.000	PERNOD RICARD SA 1.125% 07/04/2025	EUR	803.768,74	0,17	600.000	TRATON FINANCE LUXEMBOURG SA 1.250% 24/03/2033 EMTN	EUR	524.023,83	0,11
1.000.000	PSA BANQUE FRANCE SA 0.625% 10/10/2022 EMTN	EUR	1.004.303,02	0,21	1.837.000	TYCO ELECTRONICS GROUP SA ZCP 16/02/2029	EUR	1.647.033,37	0,34
1.450.000	PSA BANQUE FRANCE SA 0.750% 19/04/2023 EMTN	EUR	1.456.603,63	0,30				<b>31.174.508,23</b>	<b>6,42</b>
700.000	SOLVAY FINANCE SACA FRN PERP	EUR	728.859,21	0,15	<b>Japan</b>				
500.000	TDF INFRASTRUCTURE SASU 1.750% 01/12/2029	EUR	456.734,64	0,09	2.104.000	ASAHI GROUP HOLDINGS LTD 0.336% 19/04/2027	EUR	1.977.515,66	0,41
500.000	TOTALENERGIES CAPITAL INTERNATIONAL SA 1.535% 31/05/2039 EMTN	EUR	465.582,17	0,10	5.725.000	ASAHI GROUP HOLDINGS LTD 0.541% 23/10/2028	EUR	5.295.295,87	1,09
2.500.000	TOTALENERGIES SE FRN PERP	EUR	2.205.949,38	0,45	274.000	NTT FINANCE CORP 0.399% 13/12/2028 EMTN	EUR	256.360,87	0,05
3.945.000	TOTALENERGIES SE FRN PERP EMTN	EUR	3.927.558,21	0,81	4.000.000	TAKEDA PHARMACEUTICAL CO LTD 1.375% 09/07/2032	EUR	3.799.784,16	0,78
5.174.000	TOTALENERGIES SE FRN PERP EMTN	EUR	5.193.402,50	1,08	6.315.000	TAKEDA PHARMACEUTICAL CO LTD 2.250% 21/11/2026	EUR	6.555.125,16	1,35
			<b>59.731.123,49</b>	<b>12,30</b>	2.000.000	TAKEDA PHARMACEUTICAL CO LTD 3.000% 21/11/2030	EUR	2.176.328,00	0,45
<b>Deutschland</b>								<b>20.060.409,72</b>	<b>4,13</b>
3.380.000	ALBEMARLE NEW HOLDING GMBH 1.625% 25/11/2028	EUR	3.222.656,50	0,66	<b>Irland</b>				
3.689.000	CONTINENTAL AG ZCP 12/09/2023	EUR	3.664.103,01	0,75	1.450.000	ATLAS COPCO FINANCE DAC 0.750% 08/02/2032 EMTN	EUR	1.342.360,56	0,28
1.015.000	COVESTRO AG 0.875% 03/02/2026 EMTN	EUR	1.001.613,27	0,21	4.571.000	CCEP FINANCE IRELAND DAC ZCP 06/09/2025	EUR	4.403.106,21	0,90
1.015.000	COVESTRO AG 1.375% 12/06/2030 EMTN	EUR	977.240,89	0,20	1.950.000	CCEP FINANCE IRELAND DAC 0.875% 06/05/2033	EUR	1.734.314,38	0,36
1.000.000	DEUTSCHE BAHN FINANCE GMBH FRN PERP	EUR	904.032,58	0,19	1.900.000	CRH FINANCE DAC 3.125% 03/04/2023	EUR	1.956.497,07	0,40
1.000.000	DEUTSCHE BAHN FINANCE GMBH 1.375% 16/04/2040 EMTN	EUR	933.901,31	0,19	1.008.000	CRH SMW FINANCE DAC 1.250% 05/11/2026 EMTN	EUR	997.528,79	0,21
1.800.000	E.ON SE 0.750% 18/12/2030 EMTN	EUR	1.698.593,85	0,35	1.635.000	KERRY GROUP FINANCIAL SERVICES UNLTD CO 0.625% 20/09/2029	EUR	1.496.400,98	0,31
970.000	E.ON SE 1.625% 29/03/2031 EMTN	EUR	972.003,97	0,20	4.500.000	KERRY GROUP FINANCIAL SERVICES UNLTD CO 2.375% 10/09/2025	EUR	4.674.431,43	0,96
2.800.000	EUROGRID GMBH 1.500% 18/04/2028 EMTN	EUR	2.794.481,17	0,58					
2.000.000	EUROGRID GMBH 1.875% 10/06/2025 EMTN	EUR	2.043.231,88	0,42					
1.600.000	EVONIK INDUSTRIES AG 02/09/2081 FRN	EUR	1.467.283,20	0,30					
640.000	HEIDELBERGCEMENT AG 1.500% 07/02/2025 EMTN	EUR	645.221,98	0,13					
900.000	HEIDELBERGCEMENT AG 2.250% 03/06/2024 EMTN	EUR	922.198,97	0,19					
700.000	INFINEON TECHNOLOGIES AG 0.625% 17/02/2025	EUR	693.499,05	0,14					
1.800.000	LANXESS AG 1.750% 22/03/2028 EMTN	EUR	1.780.284,42	0,37					
1.000.000	MERCK FINANCIAL SERVICES GMBH 0.500% 16/07/2028 EMTN	EUR	954.750,95	0,20					
1.500.000	MERCK KGAA 12/12/2074 FRN	EUR	1.573.565,84	0,32					

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.



## NN (L) Euro Sustainable Credit (excluding Financials)

(ausgedrückt in EUR)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW	Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
1.820.000	SMURFIT KAPPA ACQUISITIONS ULC 2.875% 15/01/2026	EUR	1.901.503,59	0,39	500.000	HEATHROW FUNDING LTD 1.500% 11/02/2030 EMTN	EUR	470.796,58	0,10
716.000	SMURFIT KAPPA TREASURY ULC 0.500% 22/09/2029	EUR	643.510,47	0,13	1.000.000	HEATHROW FUNDING LTD 1.875% 14/03/2034 EMTN	EUR	921.252,89	0,19
516.000	SMURFIT KAPPA TREASURY ULC 1.000% 22/09/2033	EUR	448.549,89	0,09				<b>11.133.465,93</b>	<b>2,29</b>
			<b>19.598.203,37</b>	<b>4,03</b>					
	<b>Australien</b>					<b>Schweden</b>			
1.883.000	TELSTRA CORP LTD 1.000% 23/04/2030	EUR	1.821.125,81	0,37	1.899.000	ALFA LAVAL TREASURY INTERNATIONAL AB 0.875% 18/02/2026	EUR	1.864.509,74	0,38
2.200.000	TELSTRA CORP LTD 3.750% 16/05/2022 EMTN	EUR	2.210.053,87	0,45	2.260.000	ALFA LAVAL TREASURY INTERNATIONAL AB 1.375% 18/02/2029	EUR	2.215.051,22	0,46
3.631.000	TOYOTA FINANCE AUSTRALIA LTD 2.280% 21/10/2027 EMTN	EUR	3.805.418,32	0,78	635.000	ATLAS COPCO AB 0.625% 30/08/2026 EMTN	EUR	620.635,05	0,13
3.000.000	TRANSURBAN FINANCE CO PTY LTD 1.750% 29/03/2028 EMTN	EUR	2.987.956,17	0,62	1.700.000	ESSITY AB 1.125% 05/03/2025 EMTN	EUR	1.694.118,87	0,35
2.000.000	TRANSURBAN FINANCE CO PTY LTD 1.875% 16/09/2024 EMTN	EUR	2.040.987,00	0,42	500.000	ESSITY AB 1.125% 27/03/2024 EMTN	EUR	503.652,24	0,10
5.867.000	TRANSURBAN FINANCE CO PTY LTD 3.000% 08/04/2030 EMTN	EUR	6.287.158,34	1,30	800.000	ESSITY AB 1.625% 30/03/2027 EMTN	EUR	802.724,56	0,17
			<b>19.152.699,51</b>	<b>3,94</b>	950.000	SCANIA CV AB 2.250% 03/06/2025 EMTN	EUR	975.006,63	0,20
					1.578.000	TELEFONAKTIEBOLAGET LM ERICSSON 1.000% 26/05/2029 EMTN	EUR	1.368.499,95	0,28
								<b>10.044.198,26</b>	<b>2,07</b>
	<b>Vereinigtes Königreich</b>					<b>Belgien</b>			
297.000	BRITISH TELECOMMUNICATIONS PLC 1.125% 12/09/2029 EMTN	EUR	283.724,49	0,06	1.000.000	ALIAxis FINANCE SA 0.875% 08/11/2028	EUR	899.681,89	0,19
1.680.000	BRITISH TELECOMMUNICATIONS PLC 1.500% 23/06/2027 EMTN	EUR	1.674.177,20	0,34	4.205.000	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV 1.150% 22/01/2027 EMTN	EUR	4.205.933,17	0,86
1.761.000	COCA-COLA EUROPA PACIFIC PARTNERS PLC 0.700% 12/09/2031	EUR	1.573.856,26	0,32	2.100.000	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV 2.750% 17/03/2036 EMTN	EUR	2.261.789,67	0,47
2.814.000	COCA-COLA EUROPA PACIFIC PARTNERS PLC 1.125% 12/04/2029	EUR	2.712.582,88	0,56	1.900.000	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV 2.875% 02/04/2032 EMTN	EUR	2.100.288,73	0,43
1.400.000	COCA-COLA EUROPA PACIFIC PARTNERS PLC 2.625% 06/11/2023 EMTN	EUR	1.442.078,11	0,30				<b>9.467.693,46</b>	<b>1,95</b>
1.426.000	DIAGEO FINANCE PLC 1.000% 22/04/2025 EMTN	EUR	1.431.705,31	0,29		<b>Dänemark</b>			
1.100.000	FCE BANK PLC 1.615% 11/05/2023 EMTN	EUR	1.105.523,50	0,23	3.542.000	CARLSBERG BREWERIES AS 0.375% 30/06/2027	EUR	3.314.321,59	0,68
600.000	FCE BANK PLC 2.727% 03/06/2022 EMTN	GBP	710.964,39	0,15	730.000	CARLSBERG BREWERIES AS 0.625% 09/03/2030 EMTN	EUR	660.915,25	0,14
1.900.000	RENTOKIL INITIAL PLC 0.500% 14/10/2028 EMTN	EUR	1.718.407,27	0,35				<b>3.975.236,84</b>	<b>0,82</b>
3.135.000	TESCO CORPORATE TREASURY SERVICES PLC 0.875% 29/05/2026 EMTN	EUR	3.038.784,37	0,62		<b>Finnland</b>			
1.448.000	TESCO CORPORATE TREASURY SERVICES PLC 2.500% 02/05/2025 EMTN	GBP	1.702.516,81	0,35	735.000	METSO OUTOTEC OYJ 0.875% 26/05/2028 EMTN	EUR	680.157,73	0,14
			<b>17.394.320,59</b>	<b>3,57</b>	961.000	STORA ENSO OYJ 0.625% 02/12/2030 EMTN	EUR	847.516,70	0,17
					2.580.000	UPM-KYMMENE OYJ 0.125% 19/11/2028 EMTN	EUR	2.319.536,31	0,48
								<b>3.847.210,74</b>	<b>0,79</b>
	<b>Italien</b>					<b>Bermuda</b>			
1.131.000	AZA SPA 1.500% 16/03/2028 EMTN	EUR	1.111.263,62	0,23	3.300.000	BACARDI LTD 2.750% 03/07/2023	EUR	3.380.116,44	0,70
1.700.000	EDEL SPA FRN PERP	EUR	1.725.787,50	0,36				<b>3.380.116,44</b>	<b>0,70</b>
3.500.000	EDEL SPA 24/05/2080 FRN	EUR	3.584.296,03	0,74		<b>Norwegen</b>			
977.000	FCA BANK SPA/IRELAND 0.125% 16/11/2023 EMTN	EUR	969.408,50	0,20	450.000	NORSK HYDRO ASA 1.125% 11/04/2025	EUR	444.367,65	0,09
3.740.000	FCA BANK SPA/IRELAND 0.500% 13/09/2024 EMTN	EUR	3.696.499,05	0,75	2.800.000	STATNETT SF 0.875% 08/03/2025 EMTN	EUR	2.787.189,02	0,58
1.505.000	FCA BANK SPA/IRELAND 0.625% 24/11/2022 EMTN	EUR	1.511.103,17	0,31				<b>3.231.556,67</b>	<b>0,67</b>
2.477.000	ITALGAS SPA 0.250% 24/06/2025 EMTN	EUR	2.396.934,32	0,49		<b>Spanien</b>			
525.000	SNAM SPA 1.375% 25/10/2027 EMTN	EUR	524.589,69	0,11	1.500.000	CELLNEX FINANCE CO SA 2.250% 12/04/2026	EUR	1.488.931,80	0,31
			<b>15.519.881,88</b>	<b>3,19</b>	500.000	IBERDROLA FINANZAS SA FRN PERP	EUR	461.462,44	0,09
								<b>1.950.394,24</b>	<b>0,40</b>
	<b>Portugal</b>					<b>Mexiko</b>			
500.000	BRISA CONCESSAO RODOVIARIA SA 1.875% 30/04/2025 EMTN	EUR	506.725,75	0,10	500.000	AMERICA MOVIL SAB DE CV 3.259% 22/07/2023	EUR	517.918,79	0,11
1.900.000	BRISA-CONCESSAO RODOVIARIA SA 2.000% 22/03/2023 EMTN	EUR	1.933.089,18	0,40				<b>517.918,79</b>	<b>0,11</b>
6.400.000	BRISA-CONCESSAO RODOVIARIA SA 2.375% 10/05/2027 EMTN	EUR	6.655.982,91	1,37				<b>459.118.662,27</b>	<b>94,50</b>
1.000.000	EDP - ENERGIAS DE PORTUGAL SA 1.625% 15/04/2027 EMTN	EUR	1.006.320,11	0,21					
4.000.000	EDP - ENERGIAS DE PORTUGAL SA 20/07/2080 FRN	EUR	3.824.256,16	0,79					
1.000.000	EDP - ENERGIAS DE PORTUGAL SA 30/04/2079 FRN	EUR	1.039.297,33	0,21					
			<b>14.965.671,44</b>	<b>3,08</b>					
	<b>Jersey</b>					<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>		<b>459.118.662,27</b>	<b>94,50</b>
7.008.000	APTIV PLC 1.500% 10/03/2025	EUR	7.016.250,66	1,44					
3.000.000	HEATHROW FUNDING LTD 1.125% 08/10/2030 EMTN	EUR	2.725.165,80	0,56					

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Euro Sustainable Credit (excluding Financials)

(ausgedrückt in EUR)

### Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022

Bezeichnung	Verkauf / Kauf	Zinssatz (%)	Fälligkeitsdatum	Währung	Nennwert	Swap-Wert in EUR
<b>Credit Default Swap</b>						
CDS MICHELIN LUXEMBOURG SCS 2.7500% 20/06/2019	Verkauf	1,000	20/12/2023	EUR	1.050.000,00	14.373,07
						<b>14.373,07</b>

Zu erhalten (%)	Zu zahlen (%)	Fälligkeitsdatum	Währung	Nennwert	Swap-Wert in EUR	
<b>Zinsswaps</b>						
	Floating	2.747	06/12/2022	USD	4.000.000,00	(30.716,98)
0,432	Floating		25/02/2025	EUR	5.000.000,00	(48.916,80)
0,886	Floating		17/02/2032	EUR	6.000.000,00	(165.982,56)
-0,148	Floating		16/11/2024	EUR	10.000.000,00	(227.670,80)
						<b>(473.287,14)</b>

Zu erhalten	Zu zahlen	Fälligkeitsdatum	Engagement in EUR	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR			
<b>Devisentermingeschäfte</b>							
23.244.493,90	NOK	2.353.269,16	EUR	19/04/2022	2.353.269,16	34.430,64	
2.587.506,00	EUR	2.190.226,54	GBP	30/06/2022	2.587.506,00	5.592,92	
23.736,90	USD	21.397,70	EUR	30/06/2022	21.397,70	(139,68)	
55.518,38	EUR	544.940,83	NOK	19/04/2022	55.518,38	(458,54)	
						<b>5.017.691,24</b>	<b>39.425,34</b>

Stückzahl	Bezeichnung	Währung	Engagement in EUR	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR	
<b>Zins-Futures</b>					
(38)	EURO-BOBL FUTURE 08/06/2022	EUR	4.896.680,00	79.497,27	
(39)	EURO-BUND FUTURE 08/06/2022	EUR	6.187.740,00	78.676,98	
25	EURO-BUXL 30Y BOND 08/06/2022	EUR	4.655.000,00	(410.000,00)	
(3)	LONG GILT FUTURE 28/06/2022	GBP	430.371,10	6.461,07	
(4)	US 10YR ULTRA FUTURE 21/06/2022	USD	487.012,99	15.559,70	
12	US 5YR NOTE (CBT) 30/06/2022	USD	1.236.911,88	(31.933,90)	
				<b>17.893.715,97</b>	<b>(261.738,88)</b>

**Derivative Finanzinstrumente Gesamt** (681.227,61)

### Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick

		% NIW
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	<b>459.118.662,27</b>	<b>94,50</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	<b>(681.227,61)</b>	<b>(0,14)</b>
<b>Bankguthaben</b>	<b>28.362.577,66</b>	<b>5,84</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>	<b>(985.467,79)</b>	<b>(0,20)</b>
<b>Nettovermögen Gesamt</b>	<b>485.814.544,53</b>	<b>100,00</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Euromix Bond

(ausgedrückt in EUR)

### Statistische Angaben

<b>Nettovermögen</b>	31.03.2022	EUR	357.758.679,24	<b>Anzahl der Anteile</b>			
	30.09.2021	EUR	293.630.997,74				
	30.09.2020	EUR	299.499.945,22		Capitalisation V (EUR)	31.03.2022	1.018.613
<b>Nettoinventarwert pro Anteil**</b>					30.09.2021	318.486	
					30.09.2020	936.632	
Capitalisation I (EUR)	31.03.2022	EUR	3.447,81	Capitalisation X (EUR)	31.03.2022	10.273	
	30.09.2021	EUR	3.592,80		30.09.2021	12.935	
	30.09.2020	EUR	3.655,46		30.09.2020	16.600	
Capitalisation N (EUR)	31.03.2022	EUR	167,34	Distribution P (EUR)	31.03.2022	26.110	
	30.09.2021	EUR	174,34		30.09.2021	33.523	
	30.09.2020	EUR	177,31		30.09.2020	44.251	
Capitalisation P (EUR)	31.03.2022	EUR	161,80	Distribution R (EUR)	31.03.2022	3.614	
	30.09.2021	EUR	168,90		30.09.2021	4.644	
	30.09.2020	EUR	172,46		30.09.2020	4.644	
Capitalisation R (EUR)	31.03.2022	EUR	163,80	<b>Laufende Kosten in %*</b>			
	30.09.2021	EUR	170,75		Capitalisation I (EUR)	31.03.2022	0,49%
	30.09.2020	EUR	173,79		Capitalisation N (EUR)	31.03.2022	0,46%
Capitalisation V (EUR)	31.03.2022	EUR	105,73	Capitalisation P (EUR)	31.03.2022	0,85%	
	30.09.2021	EUR	110,34	Capitalisation R (EUR)	31.03.2022	0,57%	
	30.09.2020	EUR	112,59	Capitalisation V (EUR)	31.03.2022	0,78%	
Capitalisation X (EUR)	31.03.2022	EUR	158,30	Capitalisation X (EUR)	31.03.2022	0,95%	
	30.09.2021	EUR	165,33	Distribution P (EUR)	31.03.2022	0,85%	
	30.09.2020	EUR	168,98	Distribution R (EUR)	31.03.2022	0,56%	
Distribution P (EUR)	31.03.2022	EUR	52,81	<b>Portfolioumsatz in %*</b>	31.03.2022	20,46%	
	30.09.2021	EUR	55,13				
	30.09.2020	EUR	56,29				
Distribution R (EUR)	31.03.2022	EUR	53,46				
	30.09.2021	EUR	55,73				
	30.09.2020	EUR	56,74				
<b>Anzahl der Anteile</b>							
Capitalisation I (EUR)	31.03.2022		68.590				
	30.09.2021		67.906				
	30.09.2020		48.472				
Capitalisation N (EUR)	31.03.2022		16.464				
	30.09.2021		9.381				
	30.09.2020		10.709				
Capitalisation P (EUR)	31.03.2022		47.005				
	30.09.2021		51.042				
	30.09.2020		54.076				
Capitalisation R (EUR)	31.03.2022		80				
	30.09.2021		80				
	30.09.2020		430				

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

## NN (L) Euromix Bond

(ausgedrückt in EUR)

### Finanzabschlüsse

#### Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022

	Erläuterungen	
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	2	<b>355.820.147,28</b>
Organismen für gemeinsame Anlagen		21.150.995,78
Anleihen und andere Schuldtitel		334.669.151,50
<b>Bankguthaben</b>		<b>84.289,86</b>
<b>Hinterlegte Sicherheiten</b>		<b>2.206.088,23</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte</b>	4	<b>1.634.506,36</b>
<b>Vermögenswerte Gesamt</b>		<b>359.745.031,73</b>
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>	4	<b>(668.879,68)</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	2	<b>(1.317.472,81)</b>
Futures		(1.317.472,81)
<b>Verbindlichkeiten Gesamt</b>		<b>(1.986.352,49)</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Berichtszeitraums</b>		<b>357.758.679,24</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Euromix Bond

(ausgedrückt in EUR)

## Wertpapierbestand zum 31.03.2022

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW	Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
<b>Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>									
<b>Anleihen und andere Schuldtitel</b>									
<b>Deutschland</b>									
9.500.000	BUNDES OblIGATION ZCP 05/04/2024	EUR	9.516.093,48	2,66	45.320.000	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND ZCP 15/07/2031	EUR	42.511.493,77	11,88
1.815.000	BUNDES OblIGATION ZCP 07/10/2022	EUR	1.821.055,48	0,51	4.400.000	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 0.250% 15/07/2025	EUR	4.398.582,72	1,23
7.150.000	BUNDES OblIGATION ZCP 09/10/2026	EUR	7.041.546,30	1,97	3.100.000	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 0.250% 15/07/2029	EUR	3.024.911,83	0,85
7.320.000	BUNDES OblIGATION ZCP 10/04/2026	EUR	7.240.314,92	2,02	6.321.000	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 0.500% 15/07/2026	EUR	6.356.890,13	1,78
1.470.000	BUNDES OblIGATION ZCP 10/10/2025	EUR	1.462.152,18	0,41	4.500.000	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 0.750% 15/07/2027	EUR	4.566.081,24	1,28
4.000.000	BUNDES OblIGATION ZCP 10/10/2025	EUR	3.971.201,72	1,11	4.000.000	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 0.750% 15/07/2028	EUR	4.055.256,48	1,13
1.340.000	BUNDES OblIGATION ZCP 11/04/2025	EUR	1.334.344,26	0,37	5.910.000	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 1.750% 15/07/2023	EUR	6.070.914,70	1,70
4.500.000	BUNDES OblIGATION ZCP 18/10/2024	EUR	4.495.158,77	1,26	3.000.000	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 2.000% 15/07/2024	EUR	3.134.682,84	0,88
8.306.000	BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE ZCP 15/08/2026	EUR	8.200.429,41	2,29	2.576.000	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 3.750% 15/01/2023	EUR	2.663.838,28	0,74
6.180.000	BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE ZCP 15/11/2027	EUR	6.044.421,24	1,69	3.360.000	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 5.500% 15/01/2028	EUR	4.320.589,80	1,21
7.900.000	BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE ZCP 15/11/2028	EUR	7.684.318,70	2,15	4.247.000	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 7.500% 15/01/2023	EUR	4.516.880,24	1,26
9.000.000	BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE 0.250% 15/02/2027	EUR	8.966.401,11	2,51				<b>102.493.172,50</b>	<b>28,65</b>
7.500.000	BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE 0.250% 15/02/2029	EUR	7.414.018,73	2,07				<b>334.669.151,50</b>	<b>93,55</b>
7.160.000	BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE 0.250% 15/08/2028	EUR	7.082.160,42	1,98	<b>Organismen für gemeinsame Anlagen</b>				
12.090.000	BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE 0.500% 15/02/2025	EUR	12.232.123,63	3,42	<b>Offene Fonds</b>				
10.500.000	BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE 0.500% 15/02/2026	EUR	10.600.656,15	2,96	<b>Luxemburg</b>				
8.000.000	BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE 0.500% 15/02/2028	EUR	8.047.678,00	2,25	21.414	NN (L) LIQUID EUR - Z CAP EUR	EUR	21.150.995,78	5,91
8.290.000	BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE 0.500% 15/08/2027	EUR	8.341.441,36	2,33				<b>21.150.995,78</b>	<b>5,91</b>
4.730.000	BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE 1.000% 15/08/2024	EUR	4.842.578,54	1,35	<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>				
8.200.000	BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE 1.000% 15/08/2025	EUR	8.425.566,17	2,36				<b>355.820.147,28</b>	<b>99,46</b>
7.251.000	BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE 1.500% 04/09/2022	EUR	7.316.491,47	2,05	<b>Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022</b>				
12.000.000	BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE 1.500% 15/02/2023	EUR	12.213.976,44	3,41	Stückzahl	Bezeichnung	Währung	Engagement in EUR	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR
7.773.000	BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE 1.500% 15/05/2023	EUR	7.941.595,28	2,22	<b>Zins-Futures</b>				
7.500.000	BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE 1.500% 15/05/2024	EUR	7.744.596,00	2,16	45	EURO-BOBL FUTURE 08/06/2022	EUR	5.798.700,00	(211.950,00)
11.650.000	BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE 1.750% 04/07/2022	EUR	11.721.577,95	3,28	106	EURO-BUND FUTURE 08/06/2022	EUR	16.817.960,00	(936.828,61)
5.583.000	BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE 1.750% 15/02/2024	EUR	5.779.127,83	1,62	8	EURO-BUXL 30Y BOND 08/06/2022	EUR	1.489.600,00	(130.560,00)
7.200.000	BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE 2.000% 15/08/2023	EUR	7.437.398,33	2,08	76	EURO-SCHATZ FUTURE 08/06/2022	EUR	8.415.860,00	(38.134,20)
3.620.000	BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE 4.750% 04/07/2028	EUR	4.596.463,54	1,28				<b>32.522.120,00</b>	<b>(1.317.472,81)</b>
5.770.000	BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE 6.250% 04/01/2024	EUR	6.428.424,11	1,80	<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>				
5.000.000	BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE 6.500% 04/07/2027	EUR	6.594.347,10	1,84				<b>(1.317.472,81)</b>	
5.330.000	BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND 5.625% 04/01/2028	EUR	6.926.049,42	1,94					
6.770.000	BUNDESSCHATZANWEISUNGEN ZCP 10/03/2023	EUR	6.798.740,41	1,90					
4.280.000	BUNDESSCHATZANWEISUNGEN ZCP 15/09/2023	EUR	4.298.182,60	1,20					
1.610.000	BUNDESSCHATZANWEISUNGEN ZCP 15/12/2023	EUR	1.615.347,95	0,45					
			<b>232.175.979,00</b>	<b>64,90</b>					
<b>Niederlande</b>									
5.100.000	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND ZCP 15/01/2024	EUR	5.105.864,85	1,43					
5.100.000	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND ZCP 15/01/2027	EUR	4.989.253,35	1,39					
3.110.000	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND ZCP 15/01/2029	EUR	2.984.484,51	0,83					
4.000.000	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND ZCP 15/07/2030	EUR	3.793.447,76	1,06					

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Euromix Bond

(ausgedrückt in EUR)

### Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick

		% NIW
Wertpapierbestand Gesamt	355.820.147,28	99,46
Derivative Finanzinstrumente Gesamt	(1.317.472,81)	(0,37)
Bankguthaben	84.289,86	0,02
Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	3.171.714,91	0,89
Nettovermögen Gesamt	357.758.679,24	100,00

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) European ABS

(ausgedrückt in EUR)

### Statistische Angaben

<b>Nettovermögen</b>	31.03.2022	EUR	258.695.691,99
	30.09.2021	EUR	266.634.309,02
	30.09.2020	EUR	247.264.205,01
<b>Nettoinventarwert pro Anteil**</b>			
Capitalisation I (EUR)	31.03.2022	EUR	5.242,72
	30.09.2021	EUR	5.273,51
	30.09.2020	EUR	5.133,48
Capitalisation N (EUR)	31.03.2022	EUR	26,03
	30.09.2021	EUR	26,16
	30.09.2020	EUR	25,43
Capitalisation Z (EUR)	31.03.2022	EUR	5.449,74
	30.09.2021	EUR	5.469,97
	30.09.2020	EUR	5.301,87
<b>Anzahl der Anteile</b>			
Capitalisation I (EUR)	31.03.2022		1.977
	30.09.2021		648
	30.09.2020		614
Capitalisation N (EUR)	31.03.2022		4.908.061
	30.09.2021		4.807.329
	30.09.2020		3.896.641
Capitalisation Z (EUR)	31.03.2022		22.128
	30.09.2021		25.129
	30.09.2020		27.353
<b>Laufende Kosten in %*</b>			
Capitalisation I (EUR)	31.03.2022		0,49%
Capitalisation N (EUR)	31.03.2022		0,35%
Capitalisation Z (EUR)	31.03.2022		0,06%
<b>Portfolioumsatz in %*</b>	31.03.2022		78,33%

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

## NN (L) European ABS

(ausgedrückt in EUR)

### Finanzabschlüsse

#### Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022

	Erläuterungen	
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	2	<b>262.321.744,81</b>
Organismen für gemeinsame Anlagen		11.681.084,16
Anleihen und andere Schuldtitel		250.640.660,65
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	2	<b>126.414,39</b>
Devisentermingeschäfte		126.414,39
<b>Bankguthaben</b>		<b>113.050,45</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte</b>	4	<b>1.033.719,13</b>
<b>Vermögenswerte Gesamt</b>		<b>263.594.928,78</b>
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>	4	<b>(4.899.236,79)</b>
<b>Verbindlichkeiten Gesamt</b>		<b>(4.899.236,79)</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Berichtszeitraums</b>		<b>258.695.691,99</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.



# NN (L) European ABS

(ausgedrückt in EUR)

## Wertpapierbestand zum 31.03.2022

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW	Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
<b>Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>									
<b>Anleihen und andere Schuldtitel</b>									
<b>Vereinigtes Königreich</b>									
1.714.000	BARLEY HILL NO 2 PLC -2 A 27/08/2058 FRN	GBP	2.027.924,75	0,78	4.500.000	FORTUNA CONSUMER LOAN ABS 2021 DAC 2021 C 15/10/2030 FRN	EUR	4.447.736,19	1,72
2.881.000	CASTELL PLC -2020-1 B 25/09/2052 FRN	GBP	3.435.885,90	1,33	4.315.763	GLENBEIGH 2 ISSUER DAC -1X A 24/03/2046 FRN	EUR	4.283.734,91	1,66
1.720.000	CASTELL 2020-1 PLC -2020-1 C 25/09/2052 FRN	GBP	2.043.485,76	0,79	3.001.005	GLENBEIGH 2 ISSUER 2021-2 DAC 2021-2X A 24/06/2050 FRN	EUR	2.983.552,37	1,15
3.990.000	CHESTER B1 ISSUER PLC B1 C 17/04/2023 FRN	GBP	4.710.576,82	1,82	650.000	HARVEST CLO IX DAC-9X CR 15/02/2030 FRN	EUR	630.589,31	0,24
2.997.000	CHESTER B1 ISSUER PLC B1 D 17/04/2023 FRN	GBP	3.543.451,86	1,37	599.827	HAUS EUROPEAN LOAN CONDUIT NO 39 DAC 39X C 28/06/2026 FRN	EUR	589.577,88	0,23
2.644.000	CMF 2020-1 PLC 2020-1 D 16/03/2024 FRN	GBP	3.125.893,82	1,21	599.827	HAUS EUROPEAN LOAN CONDUIT NO 39 DAC 39X D 28/06/2026 FRN	EUR	600.286,42	0,23
2.800.000	DOWSON 2021-2 PLC 2021-2 C 20/10/2028 FRN	GBP	3.291.498,76	1,27	5.000.000	INVESCO EURO CLO V DAC -5X D 15/01/2034 FRN	EUR	4.881.619,00	1,90
5.731.160	EUROSAIL 2006-3NC PLC 2006-3X B1A 10/09/2044 FRN	EUR	5.680.262,49	2,20	1.380.000	JUBILEE CLO 2015-XV DAC 12/07/2028 FRN	EUR	1.357.566,44	0,52
3.500.000	FORMENTERA ISSUER PLC 2022-1 A 28/07/2047 FRN	GBP	4.125.900,87	1,59	2.000.000	MACKAY SHIELDS EURO CLO 1 DAC-1X B 20/10/2032 FRN	EUR	1.953.803,60	0,76
1.848.991	GENESIS MORTGAGE FUNDING 2019-1 PLC 2019-1 D 1.600% 22/01/2033 FRN	GBP	2.191.513,15	0,85	2.000.000	NORTHWOODS CAPITAL 19 EURO DAC 2019-19X B1 25/11/2033 FRN	EUR	1.988.136,20	0,77
3.386.983	GENESIS MORTGAGE FUNDING 2019-1 PLC 2019-1 E 15/06/2056 FRN	GBP	4.026.986,74	1,56	2.000.000	NORTHWOODS CAPITAL 19 EURO DAC 2019-19X D 25/11/2033 FRN	EUR	1.965.276,80	0,76
3.549.869	GRIFONAS FINANCE NO 1 PLC A 28/08/2039 FRN	EUR	3.483.669,29	1,35	2.000.000	OCP EURO CLO 2017-2X B DAC 15/01/2032 FRN	EUR	1.978.290,20	0,76
2.899.885	HOPS HILL NO 1 PLC -1 C 27/05/2054 FRN	GBP	3.435.321,21	1,33	1.249.870	ORANJE EUROPEAN LOAN CONDUIT NO 32 DAC -32 C 22/11/2028 FRN	EUR	1.251.631,98	0,48
1.499.962	HOPS HILL NO 1 PLC -1 D 27/05/2054 FRN	GBP	1.778.613,99	0,69	2.000.000	PEMBROKE PROPERTY FINANCE -2 A 01/06/2040 FRN	EUR	1.996.673,00	0,77
1.739.830	LONDON WALL MORTGAGE CAPITAL PLC 2018-FL1 C 15/05/2050 FRN	GBP	2.052.001,46	0,79	1.500.000	PEPPER IBERIA UNSECURED 2019 DAC 2019-1 C 07/04/2028 FRN	EUR	1.500.932,51	0,58
621.368	LONDON WALL MORTGAGE CAPITAL PLC 2018-FL1 D 15/05/2050 FRN	GBP	732.885,09	0,28	4.474.842	PRIMROSE RESIDENTIAL 2021-1 DAC 2021-1 A 24/03/2061 FRN	EUR	4.451.724,24	1,72
952.000	NEWDAY FUNDING 2019-2 PLC 2019-2X D 15/09/2027 FRN	GBP	1.129.931,48	0,44	3.024.000	PRIMROSE RESIDENTIAL 2021-1 DAC 2021-1 C 24/03/2061 FRN	EUR	3.035.087,62	1,17
2.460.000	PAVILLION POINT OF SALE 2021-1 LTD 2021-1 D 30/12/2031 FRN	GBP	2.817.633,62	1,09	1.286.000	PRIMROSE RESIDENTIAL 2021-1 DAC 2021-1 D 24/03/2061 FRN	EUR	1.287.277,01	0,50
3.250.000	PRECISE MORTGAGE FUNDING PLC -2019-1B D 12/12/2055 FRN	GBP	3.870.929,58	1,50	1.000.000	SCF RAHOITUSPALVELUX X DAC-10 B 25/10/2031 FRN	EUR	996.621,38	0,39
2.000.000	RESIDENTIAL MORTGAGE SECURITIES PLC -32X D 20/06/2070 FRN	GBP	2.384.283,06	0,92	1.585.573	TAURUS DAC -2019-1FR C 02/02/2031 FRN	EUR	1.584.782,84	0,61
993.509	RMAC SECURITIES NO 1 PLC 2006-NS1X B1C 16/08/2005 FRN	EUR	976.718,56	0,38	2.362.397	TAURUS 2019-4 FIN DAC 2019-FIN4 B 18/11/2031 FRN	EUR	2.351.533,06	0,91
3.149.120	RMAC SECURITIES NO 1 PLC 2006-NS2X M1C 12/06/2044 FRN	EUR	3.045.728,37	1,18	3.100.000	TORO EUROPEAN CLO 4 DAC -1X CRE 15/07/2030 FRN	EUR	3.056.040,45	1,18
1.872.383	RMAC SECURITIES PLC -2006-NS1X M1C 12/06/2044 FRN	EUR	1.797.661,68	0,69	<b>71.623.387,97 27,69</b>				
3.150.000	STRATTON MORTGAGE FUNDING 2021-3 PLC 2021-3 C 12/06/2024 FRN	GBP	3.680.857,69	1,42	<b>Luxemburg</b>				
1.300.000	STRATTON MORTGAGE FUNDING 2021-3 PLC 2021-3 D 12/06/2024 FRN	GBP	1.509.417,57	0,58	3.500.000	CARTESIAN RESIDENTIAL MORTGAGAGES -4 C 25/11/2054 FRN	EUR	3.476.797,77	1,34
2.353.686	TOWD POINT MORTGAGE FUNDING PLC -2019-V2X A 20/02/2054 FRN	GBP	2.789.710,70	1,08	1.750.000	CARTESIAN RESIDENTIAL MORTGAGAGES -4 D 25/11/2054 FRN	EUR	1.743.737,22	0,67
3.200.000	TOWD POINT MORTGAGE FUNDING 2019 - GRAN 2019-GR4X ER 20/10/2051 FRN	GBP	3.706.701,10	1,43	3.242.232	MIRAVET SARL - COMPARTMENT 2020-1 2020-1 A 26/05/2065 FRN	EUR	3.241.569,95	1,25
2.465.065	TRINIDAD MORTGAGE SECURITIES 2018-1 PLC 2018-1 D 24/01/2059 FRN	GBP	2.921.259,41	1,13	1.000.000	MIRAVET SARL - COMPARTMENT 2020-1 2020-1 B 26/05/2065 FRN	EUR	989.569,07	0,38
2.500.000	TWIN BRIDGES 2019-2 PLC 2019-2 D 12/09/2044 FRN	GBP	2.965.121,51	1,15	1.871.703	MIRAVET SARL 2019-1 A 26/05/2065 FRN	EUR	1.865.223,57	0,72
2.745.000	TWIN BRIDGES 2021-1 PLC 2021-1 D 12/03/2026 FRN	GBP	3.201.362,43	1,24	4.200.000	MIRAVET SARL 2019-1 B 26/05/2065 FRN	EUR	4.171.893,60	1,61
<b>86.483.188,72 33,44</b>					3.900.000	PBD GERMANY AUTO LEASE MASTER SA - COMPAR 2021-GE2 D 26/11/2030 FRN	EUR	3.874.425,17	1,50
<b>Irland</b>									
1.500.000	ALME LOAN FUNDING V DAC-5X C1R 15/07/2031 FRN	EUR	1.486.865,70	0,57	1.830.796	SC GERMANY SA COMPARTMENT CONSUMER 2020-1 2020-1 C 14/11/2031 FRN	EUR	1.832.009,87	0,71
3.000.000	AVOCA CLO XVII DAC-17X B1RR 15/10/2032 FRN	EUR	2.954.097,30	1,14	1.331.488	SC GERMANY SA COMPARTMENT CONSUMER 2020-1 2020-1 D 14/11/2031 FRN	EUR	1.337.035,76	0,52
1.000.000	BLACKROCK EUROPEAN CLO VI DAC 15/07/2032 FRN	EUR	944.939,80	0,37	4.200.000	SC GERMANY SA COMPARTMENT CONSUMER 2021-1 2021-1 D 14/11/2026 FRN	EUR	4.128.989,97	1,60
5.000.000	BNPP AM EURO CLO 2018 DAC 2018-1X CR 15/04/2031 FRN	EUR	4.909.392,00	1,91	3.700.000	SILVER ARROW SA COMPARTMENT -10 D 15/03/2027 FRN	EUR	3.695.646,95	1,43
1.730.000	CITIZEN IRISH AUTO RECEIVABLES TRUST 2020-1 D 15/12/2029 FRN	EUR	1.716.039,70	0,66	<b>30.356.898,90 11,73</b>				
2.500.000	DRYDEN 51 EURO CLO 2017 DAC 15/07/2031 FRN	EUR	2.477.034,75	0,96	<b>Niederlande</b>				
1.458.000	FASTNET SECURITIES 13 DAC-13 C 18/04/2057 FRN	EUR	1.459.481,85	0,56	2.500.000	DUTCH PROPERTY FINANCE BV -2020-1 D 28/07/2054 FRN	EUR	2.489.378,63	0,96
4.750.000	FASTNET SECURITIES 13 DAC-13 D 18/04/2057 FRN	EUR	4.759.676,13	1,84	2.375.000	DUTCH PROPERTY FINANCE 2020-1 BV 2020-1 D 28/07/2054 FRN	EUR	2.332.879,00	0,90
1.750.000	FINANCE IRELAND RMBS NO 3 DAC 3 D 24/06/2061 FRN	EUR	1.743.387,33	0,67	2.339.000	DUTCH PROPERTY FINANCE 2021-1 BV 2021-1 D 28/07/2058 FRN	EUR	2.291.701,14	0,89
<b>527.228 E-MAC DE 2006-II BV DE06-II B 25/02/2058 FRN</b>									
<b>3.900.000 GREEN STORM 2017 BV 2017-GRN A 22/04/2064 FRN</b>									
<b>323.358 MAGOI 2019 BV 2019-1 D 27/07/2039 FRN</b>									
<b>323.365 MAGOI 2019 BV 2019-1 E 27/07/2039 FRN</b>									

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) European ABS

(ausgedrückt in EUR)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
7.500.000	STORM 2017-II BV 2017-2 A 22/05/2064 FRN	EUR	7.504.592,33	2,90
			<b>22.763.213,53</b>	<b>8,80</b>
<b>Italien</b>				
1.368.832	ASSET-BACKED EUROPEAN SECURITISATION TRANSACT 17 C 15/04/2032 FRN	EUR	1.368.810,45	0,53
1.263.594	AUTOFLORENCE -1 C 25/12/2042 FRN	EUR	1.267.290,46	0,49
1.551.170	AUTOFLORENCE 1 SRL 1 D 25/12/2042 FRN	EUR	1.560.229,75	0,60
1.170.000	BRIGNOLE CQ 2022 SRL 2022-1 B 24/03/2038 FRN	EUR	1.170.437,83	0,45
4.000.000	CASSIA 2022-1 SRL 2022-1X A 22/05/2034 FRN	EUR	4.000.630,88	1,55
4.100.000	CORDUSIO RMBS 3 D - UBCASA 1 SRL -3 D 31/12/2042 FRN	EUR	3.863.687,40	1,49
			<b>13.231.086,77</b>	<b>5,11</b>
<b>Spanien</b>				
1.872.134	AUTONORIA SPAIN 2019-SP D 25/12/2035 FRN	EUR	1.857.971,37	0,72
5.000.000	AUTONORIA SPAIN 2021 FT 2021-SP D 31/01/2039 FRN	EUR	4.932.812,85	1,91
2.338.551	FT SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO -2020-1 C 20/03/2033 FRN	EUR	2.327.820,36	0,90
1.835.067	SABADELL CONSUMO FDT -1 B 24/03/2031 FRN	EUR	1.820.658,53	0,70
			<b>10.939.263,11</b>	<b>4,23</b>
<b>Frankreich</b>				
2.553.409	FCT AUTONORIA -2019-1 D 25/09/2035 FRN	EUR	2.537.033,31	0,98
2.000.000	FCT NORIA 2021 2021-1 D 25/10/2049 FRN	EUR	1.971.736,28	0,76
3.200.000	FCT PIXEL 2021 2021-1 D 25/02/2038 FRN	EUR	3.157.451,71	1,22
			<b>7.666.221,30</b>	<b>2,96</b>
<b>Deutschland</b>				
2.400.000	RED & BLACK AUTO GERMANY 7 UG 7 D 15/11/2024 FRN	EUR	2.411.011,54	0,93
2.000.000	RED & BLACK AUTO GERMANY 8 UG 15/09/2030 FRN	EUR	1.990.775,44	0,77
			<b>4.401.786,98</b>	<b>1,70</b>
<b>Portugal</b>				
1.629.973	ARES LUSITANI-STC SA / PELICAN FINANCE 2-PELLI- 2 C 25/01/2035 FRN	EUR	1.603.331,83	0,62
1.600.000	TAGUS - SOCIEDADE DE TITULARIZACAO DE CREDI 2 C 23/09/2038 FRN	EUR	1.572.281,54	0,61
			<b>3.175.613,37</b>	<b>1,23</b>
			<b>250.640.660,65</b>	<b>96,89</b>

### Organismen für gemeinsame Anlagen

#### Offene Fonds

##### Luxemburg

11.826	NN (L) LIQUID EUR - Z CAP EUR	EUR	11.681.084,16	4,51
			<b>11.681.084,16</b>	<b>4,51</b>
			<b>11.681.084,16</b>	<b>4,51</b>

**Wertpapierbestand Gesamt** **262.321.744,81** **101,40**

### Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022

Zu erhalten	Zu zahlen	Fälligkeits- datum	Engagement in EUR	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR
-------------	-----------	-----------------------	----------------------	---

#### Devisentermingeschäfte

72.036.362,26	EUR	61.001.162,35	GBP	30/06/2022	72.036.362,26	126.130,04
72.826,37	GBP	85.565,84	EUR	30/06/2022	85.565,84	284,35
					<b>72.121.928,10</b>	<b>126.414,39</b>

**Derivative Finanzinstrumente Gesamt** **126.414,39**

### Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick

		% NIW
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	<b>262.321.744,81</b>	<b>101,40</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	<b>126.414,39</b>	<b>0,05</b>
<b>Bankguthaben</b>	<b>113.050,45</b>	<b>0,04</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>	<b>(3.865.517,66)</b>	<b>(1,49)</b>
<b>Nettovermögen Gesamt</b>	<b>258.695.691,99</b>	<b>100,00</b>

## NN (L) European Enhanced Index Sustainable Equity

(ausgedrückt in EUR)

### Statistische Angaben

<b>Nettovermögen</b>	31.03.2022	EUR	352.700.180,80	Capitalisation P (EUR)	31.03.2022	0,55%
	30.09.2021	EUR	137.376.357,52	Capitalisation R (EUR)	31.03.2022	0,25%
	30.09.2020	EUR	23.794.410,91	Capitalisation X (EUR)	31.03.2022	1,05%
<b>Nettoinventarwert pro Anteil</b>				Distribution Z (EUR)	31.03.2022	0,11%
	31.03.2022	EUR	6.307,73	<b>Portfolioumsatz in %*</b>	31.03.2022	43,21%
	30.09.2021	EUR	6.209,77			
30.09.2020	EUR	4.745,34				
Capitalisation I (EUR)	31.03.2022	EUR	312,59			
	30.09.2021	EUR	308,29			
	30.09.2020	EUR	236,42			
Capitalisation P (EUR)	31.03.2022	EUR	314,72			
	30.09.2021	EUR	309,94			
	30.09.2020	EUR	237,00			
Capitalisation R (EUR)	31.03.2022	EUR	266,59			
	30.09.2021	EUR	263,58			
	30.09.2020	EUR	-			
Capitalisation X (EUR)	31.03.2022	EUR	6.049,09			
	30.09.2021	EUR	6.083,98			
	30.09.2020	EUR	4.749,19			
Distribution Z (EUR)						
	31.03.2022	EUR	47.847			
	30.09.2021		16.938			
<b>Anzahl der Anteile</b>	30.09.2020		7			
	31.03.2022		3.715			
	30.09.2021		5.353			
Capitalisation I (EUR)	30.09.2020		29			
	31.03.2022		9			
	30.09.2021		9			
Capitalisation P (EUR)	30.09.2020		29			
	31.03.2022		9			
	30.09.2021		9			
Capitalisation R (EUR)	30.09.2020		29			
	31.03.2022		690			
	30.09.2021		473			
Capitalisation X (EUR)	30.09.2020		-			
	31.03.2022		8.190			
	30.09.2021		5.000			
Distribution Z (EUR)	30.09.2020		5.000			
	31.03.2022					
	30.09.2021					
<b>Dividende</b>	30.09.2020					
	14.12.2021	EUR	137,00			
<b>Laufende Kosten in %*</b>						
	31.03.2022		0,19%			

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

## NN (L) European Enhanced Index Sustainable Equity

(ausgedrückt in EUR)

### Finanzabschlüsse

#### Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022

	Erläuterungen	
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	2	<b>350.449.550,24</b>
Aktien		350.449.550,24
<b>Bankguthaben</b>		<b>1.510.187,96</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte</b>	4	<b>798.864,72</b>
<b>Vermögenswerte Gesamt</b>		<b>352.758.602,92</b>
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>	4, 12	<b>(58.422,12)</b>
<b>Verbindlichkeiten Gesamt</b>		<b>(58.422,12)</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Berichtszeitraums</b>		<b>352.700.180,80</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) European Enhanced Index Sustainable Equity

(ausgedrückt in EUR)

## Wertpapierbestand zum 31.03.2022

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW	Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
<b>Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>									
<b>Aktien</b>									
<b>Vereinigtes Königreich</b>									
170.797	ABRDN PLC	GBP	434.338,57	0,12	59.415	3I GROUP PLC	GBP	976.233,56	0,28
67.335	ASTRAZENECA PLC	GBP	8.073.238,64	2,29				<b>74.970.412,95</b>	<b>21,26</b>
5.205	AUTO TRADER GROUP PLC	GBP	38.976,15	0,01	<b>Schweiz</b>				
9.211	AVEVA GROUP PLC	GBP	267.045,10	0,08	115.002	ABB LTD - REG	CHF	3.388.568,70	0,96
291.278	AVIVA PLC	GBP	1.558.310,28	0,44	15.077	ADECCO GROUP AG - REG	CHF	618.590,45	0,18
871.840	BARCLAYS PLC	GBP	1.529.993,85	0,43	381	BARRY CALLEBAUT AG - REG	CHF	807.458,67	0,23
109.983	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	GBP	679.892,85	0,19	24.464	CIE FINANCIERE RICHEMONT SA - REG	CHF	2.819.324,51	0,80
12.290	BERKELEY GROUP HOLDINGS PLC	GBP	543.920,25	0,15	44.127	CLARIANT AG - REG	CHF	693.419,48	0,20
85.864	BRITISH LAND CO PLC/THE	GBP	538.922,58	0,15	30.154	COCA-COLA HBC AG -DI	GBP	570.743,43	0,16
445.796	BT GROUP PLC	GBP	961.161,32	0,27	1.309	GEBERIT AG - REG	CHF	731.514,76	0,21
17.228	BUNZL PLC	GBP	605.076,80	0,17	678	GIVAUDAN SA - REG	CHF	2.534.100,00	0,72
23.324	BURBERRY GROUP PLC	GBP	462.030,06	0,13	5.703	LOGITECH INTERNATIONAL SA - REG	CHF	385.429,59	0,11
17.743	COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC	USD	775.164,90	0,22	128.620	NESTLE SA - REG	CHF	15.099.013,21	4,28
117.866	COMPASS GROUP PLC	GBP	2.301.358,27	0,65	85.423	NOVARTIS AG - REG	CHF	6.778.502,82	1,92
13.278	CRODA INTERNATIONAL PLC	GBP	1.238.142,49	0,35	649	PARTNERS GROUP HOLDING AG	CHF	731.135,53	0,21
117.993	DIAGEO PLC	GBP	5.394.471,52	1,53	29.760	ROCHE HOLDING AG - GENUSSSCHEIN	CHF	10.650.824,90	3,02
303.221	GLAXOSMITHKLINE PLC	GBP	5.910.406,53	1,68	3.149	SCHINDLER HOLDING AG - REG	CHF	608.630,97	0,17
4.532	HALMA PLC	GBP	134.609,39	0,04	168	SGS SA - REG	CHF	422.659,59	0,12
837.021	HSBC HOLDINGS PLC	GBP	5.204.010,53	1,48	10.460	SIKA AG - REG	CHF	3.140.300,00	0,89
114.669	INFORMA PLC	GBP	816.601,08	0,23	3.074	SONOVA HOLDING AG - REG	CHF	1.163.652,28	0,33
9.027	INTERTEK GROUP PLC	GBP	558.031,04	0,16	669	STRAUMANN HOLDING AG - REG	CHF	971.240,14	0,28
137.051	J SAINSBURY PLC	GBP	409.825,71	0,12	2.005	SWISS LIFE HOLDING AG - REG	CHF	1.163.543,48	0,33
145.604	JD SPORTS FASHION PLC	GBP	255.434,62	0,07	16.842	SWISS RE AG	CHF	1.449.451,69	0,41
37.629	JOHNSON MATTHEY PLC	GBP	836.460,86	0,24	3.854	TEMENOS AG - REG	CHF	334.994,22	0,09
109.124	KINGFISHER PLC	GBP	329.801,72	0,09	155.828	UBS GROUP AG - REG	CHF	2.761.455,58	0,78
60.353	LAND SECURITIES GROUP PLC	GBP	561.063,59	0,16	806	VAT GROUP AG	CHF	278.974,40	0,08
440.407	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	GBP	1.417.538,50	0,40	4.692	VIFOR PHARMA AG	CHF	750.598,16	0,21
4.007.665	LLOYDS BANKING GROUP PLC	GBP	2.231.561,88	0,62	6.576	ZURICH INSURANCE GROUP AG	CHF	2.933.752,63	0,83
13.056	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	GBP	1.230.728,30	0,35				<b>61.787.879,19</b>	<b>17,52</b>
228.044	M&G PLC	GBP	596.919,16	0,17	<b>Frankreich</b>				
79.120	MONDI PLC	GBP	1.396.436,79	0,40	4.948	AEROPORTS DE PARIS	EUR	672.928,00	0,19
394.186	NATWEST GROUP PLC	GBP	1.007.083,73	0,29	16.898	ALSTOM SA	EUR	359.420,46	0,10
6.715	NEXT PLC	GBP	479.312,87	0,14	98.401	AXA SA	EUR	2.614.022,57	0,75
662	NMC HEALTH PLC	GBP	0,08	0,00	2.362	BIOMERIEUX	EUR	228.499,88	0,06
46.112	PEARSON PLC	GBP	409.575,77	0,12	59.180	BNP PARIBAS SA	EUR	3.073.217,40	0,88
29.575	PERSIMMON PLC	GBP	752.795,32	0,21	11.896	BUREAU VERITAS SA	EUR	308.582,24	0,09
62.874	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	GBP	456.826,41	0,13	8.384	CAPGEMINI SE	EUR	1.697.760,00	0,48
126.686	PRUDENTIAL PLC	GBP	1.700.017,62	0,48	39.542	CARREFOUR SA	EUR	776.802,59	0,22
30.101	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	GBP	2.077.352,44	0,59	11.003	CIE GENERALE DES ETABLISSEMENTS MICHELIN SCA	EUR	1.352.818,85	0,38
88.814	RELX PLC	GBP	2.504.477,98	0,71	32.403	COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	EUR	1.758.510,81	0,50
87.327	RENTOKIL INITIAL PLC	GBP	543.558,17	0,15	6.526	COVIVIO	EUR	470.785,64	0,13
42.244	SAGE GROUP PLC/THE	GBP	350.524,75	0,10	56.507	CREDIT AGRICOLE SA	EUR	615.135,20	0,17
42.548	SEGRO PLC	GBP	677.445,87	0,19	34.455	DANONE SA	EUR	1.723.783,65	0,49
57.070	SEVERN TRENT PLC	GBP	2.078.682,85	0,59	22.917	DASSAULT SYSTEMES SE	EUR	1.024.733,66	0,29
57.472	SMITH & NEPHEW PLC	GBP	829.712,98	0,24	10.353	EDENRED	EUR	465.056,76	0,13
1.592	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	GBP	236.145,21	0,07	9.661	EIFFAGE SA	EUR	900.791,64	0,26
10.118	ST JAMES'S PLACE PLC	GBP	173.430,28	0,05	4.619	GECINA SA	EUR	527.951,70	0,15
114.382	STANDARD CHARTERED PLC	GBP	690.573,46	0,20	1.316	HERMES INTERNATIONAL	EUR	1.699.614,00	0,48
404.339	TAYLOR WIMPEY PLC	GBP	625.364,12	0,18	3.086	KERING SA	EUR	1.776.610,20	0,50
529.302	TESCO PLC	GBP	1.728.718,83	0,49	19.426	KLEPIERRE SA	EUR	469.720,68	0,13
113.896	UNILEVER PLC	GBP	4.656.592,86	1,32	11.646	LEGRAND SA	EUR	1.005.981,48	0,29
167.782	UNITED UTILITIES GROUP PLC	GBP	2.232.629,05	0,63	11.035	L'OREAL SA	EUR	4.015.084,75	1,14
1.686.796	VODAFONE GROUP PLC	GBP	2.491.885,41	0,71	11.567	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	EUR	7.511.609,80	2,13
					43.569	ORANGE SA	EUR	466.362,58	0,13
					4.166	ORPEA	EUR	164.057,08	0,05
					12.566	PERNOD RICARD SA	EUR	2.504.403,80	0,71
					12.111	PUBLICIS GROUPE SA	EUR	669.253,86	0,19
					28.515	SCHNEIDER ELECTRIC SE	EUR	4.338.842,40	1,23

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) European Enhanced Index Sustainable Equity

(ausgedrückt in EUR)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW	Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
865	SEB SA	EUR	109.509,00	0,03	117.516	ING GROEP NV	EUR	1.117.694,68	0,33
57.954	SOCIETE GENERALE SA	EUR	1.417.554,84	0,40	8.209	JDE PEET'S NV	EUR	212.859,37	0,06
13.303	SODEXO SA	EUR	981.761,40	0,28	15.137	KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	EUR	440.713,76	0,12
2.102	TELEPERFORMANCE	EUR	727.922,60	0,21	9.822	KONINKLIJKE DSM NV	EUR	1.596.075,00	0,45
2.272	UBISOFT ENTERTAINMENT SA	EUR	90.766,40	0,03	102.392	KONINKLIJKE KPN NV	EUR	321.818,06	0,09
19.529	VALEO	EUR	327.208,40	0,09	13.451	NN GROUP NV	EUR	616.862,86	0,17
33.399	VINCI SA	EUR	3.105.773,01	0,88	37.021	PROSUS NV	EUR	1.798.295,08	0,51
24.520	VIVENDI SE	EUR	290.316,80	0,08	14.108	QIAGEN NV	EUR	628.229,24	0,18
12.667	WORLDLINE SA/FRANCE	EUR	500.156,50	0,14	5.467	RANDSTAD NV	EUR	298.716,88	0,08
			<b>50.743.310,63</b>	<b>14,39</b>	122.126	STELLANTIS NV	EUR	1.807.464,80	0,52
					41.892	STMICROELECTRONICS NV	EUR	1.658.504,28	0,47
					6.958	WOLTERS KLUWER NV	EUR	672.003,64	0,19
							<b>29.468.304,62</b>	<b>8,36</b>	
	<b>Deutschland</b>					<b>Spanien</b>			
8.362	ADIDAS AG	EUR	1.771.907,80	0,50	5.899	AENA SME SA	EUR	891.043,95	0,25
20.906	ALLIANZ SE - REG	EUR	4.527.194,30	1,28	22.814	AMADEUS IT GROUP SA	EUR	1.350.132,52	0,38
3.284	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	EUR	230.865,20	0,07	284.444	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA	EUR	1.481.953,24	0,42
19.326	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	EUR	1.519.023,60	0,43	721.007	BANCO SANTANDER SA	EUR	2.235.121,70	0,64
5.051	BECHTLE AG	EUR	258.611,20	0,07	73.371	CAIXABANK SA	EUR	225.762,57	0,06
3.882	BEIERSDORF AG	EUR	369.566,40	0,10	133.379	ENAGAS SA	EUR	2.687.586,85	0,76
11.252	BRENTTAG SE	EUR	825.221,68	0,23	11.672	GRIFOLS SA	EUR	192.354,56	0,05
34.545	COMMERZBANK AG	EUR	239.293,22	0,07	53.420	INDUSTRIA DE DISEÑO TEXTIL SA	EUR	1.056.647,60	0,30
8.737	DELIVERY HERO SE	EUR	348.256,82	0,10	69.763	RED ELECTRICA CORP SA	EUR	1.298.289,43	0,37
5.791	DEUTSCHE BOERSE AG	EUR	943.933,00	0,27	525.772	REPSOL SA	EUR	6.269.305,33	1,78
205.843	DEUTSCHE TELEKOM AG - REG	EUR	3.485.333,68	1,00	13.216	SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY SA	EUR	211.125,60	0,06
83.883	EVONIK INDUSTRIES AG	EUR	2.112.173,94	0,60	264.380	TELEFONICA SA	EUR	1.160.231,63	0,33
15.745	FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	EUR	956.666,20	0,27			<b>19.059.554,98</b>	<b>5,40</b>	
32.898	FRESENIUS SE & CO KGAA	EUR	1.096.983,81	0,31		<b>Dänemark</b>			
15.647	GEA GROUP AG	EUR	583.789,57	0,17	7.496	AMBU AS - B	DKK	100.773,62	0,03
723	HANNOVER RUECK SE	EUR	111.595,05	0,03	9.499	CHR HANSEN HOLDING AS	DKK	634.292,12	0,18
7.261	HELLOFRESH SE	EUR	297.410,56	0,08	1.119	COLOPLAST AS - B	DKK	154.120,11	0,04
13.055	HENKEL AG & CO KGAA	EUR	782.647,25	0,22	6.933	DEMANT AS	DKK	285.206,81	0,08
9.782	HENKEL AG & CO KGAA - REG	EUR	593.571,76	0,17	10.800	DSV A/S	DKK	1.888.214,73	0,54
1.702	KNORR-BREMSE AG	EUR	118.527,28	0,03	3.248	GENMAB AS	DKK	1.076.341,82	0,31
43.410	MERCEDES-BENZ GROUP AG	EUR	2.769.992,10	0,79	4.717	GN STORE NORD AS	DKK	210.977,41	0,06
10.626	MERCK KGAA	EUR	2.017.346,10	0,57	74.271	NOVO NORDISK AS - B	DKK	7.477.568,01	2,12
7.723	MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGSGESELLSCHAFT AG IN MUENCHEN - REG	EUR	1.876.689,00	0,53	17.388	ORSTED AS	DKK	1.985.074,85	0,56
4.610	PUMA AG	EUR	356.998,40	0,10	394	PANDORA AS	DKK	34.302,07	0,01
49.267	SAP SE	EUR	4.981.879,04	1,41	47.406	VESTAS WIND SYSTEMS AS	DKK	1.273.026,28	0,36
1.440	SARTORIUS AG	EUR	578.448,00	0,16			<b>15.119.897,83</b>	<b>4,29</b>	
1.935	SCOUT24 AG	EUR	100.620,00	0,03		<b>Schweden</b>			
38.702	SIEMENS AG - REG	EUR	4.863.293,32	1,38	24.882	ALFA LAVAL AB	SEK	780.589,69	0,22
36.768	SIEMENS ENERGY AG	EUR	761.832,96	0,22	58.308	ASSA ABLOY AB - B	SEK	1.433.347,33	0,41
11.257	SIEMENS HEALTHINEERS AG	EUR	633.093,68	0,18	25.737	ATLAS COPCO AB - A	SEK	1.220.426,40	0,35
5.637	SYMRISE AG - A	EUR	613.587,45	0,17	29.161	ATLAS COPCO AB - B	SEK	1.207.866,79	0,34
116.631	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	EUR	287.961,94	0,09	5.032	EPIROC AB	SEK	98.124,00	0,03
28.351	VONOVIA SE	EUR	1.199.530,81	0,34	30.627	EPIROC AB	SEK	503.743,72	0,14
8.472	ZALANDO SE	EUR	389.712,00	0,11	7.037	FASTIGHETS AB BALDER - B	SEK	421.708,41	0,12
			<b>42.603.557,12</b>	<b>12,08</b>	7.106	GETINGE AB	SEK	258.356,87	0,07
	<b>Niederlande</b>				53.993	H & M HENNES & MAURITZ AB - B	SEK	657.024,32	0,19
26.061	ABN AMRO BANK NV - CVA	EUR	303.402,16	0,09	36.354	HUSQVARNA AB - B	SEK	345.896,98	0,10
837	ADYEN NV	EUR	1.514.133,00	0,43	8.928	INVESTMENT AB LATOUR - B	SEK	259.163,68	0,07
117.277	AEGON NV	EUR	563.164,15	0,16	16.246	INVESTOR AB	SEK	345.311,86	0,10
15.206	AERCAP HOLDINGS NV	USD	687.150,21	0,19	25.402	INVESTOR AB	SEK	505.015,51	0,14
21.369	AKZO NOBEL NV	EUR	1.671.483,18	0,47	2.660	KINNEVIK AB - B	SEK	63.490,73	0,02
2.955	ARGENX SE	EUR	834.787,50	0,24	88.971	SANDVIK AB	SEK	1.724.638,16	0,49
2.624	ASM INTERNATIONAL NV	EUR	871.430,40	0,25	32.220	SECURITAS AB - B	SEK	330.768,90	0,09
17.052	ASML HOLDING NV	EUR	10.401.720,00	2,95	22.463	SINCH AB	SEK	139.640,54	0,04
83.787	CNH INDUSTRIAL NV	EUR	1.206.113,87	0,34					
3.535	EXOR NV	EUR	245.682,50	0,07					

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) European Enhanced Index Sustainable Equity

(ausgedrückt in EUR)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
65.445	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB - A	SEK	646.609,22	0,18
30.650	SKANSKA AB - B	SEK	624.868,92	0,18
24.751	SVENSKA HANDELSBANKEN AB - A	SEK	207.427,34	0,06
29.560	TELE2 AB - B	SEK	405.660,56	0,12
153.421	TELIA CO AB	SEK	558.393,26	0,15
29.425	VOLVO AB - A SHS	SEK	513.627,78	0,15
67.262	VOLVO AB - B	SEK	1.145.549,70	0,32
			<b>14.397.250,67</b>	<b>4,08</b>
<b>Italien</b>				
23.394	ASSICURAZIONI GENERALI SPA	EUR	485.893,38	0,14
84	DIASORIN SPA	EUR	11.919,60	0,00
623.560	INTESA SANPAOLO SPA	EUR	1.299.187,26	0,37
8.145	MEDIOBANCA BANCA DI CREDITO FINANZIARIO SPA	EUR	75.096,90	0,02
6.116	MONCLER SPA	EUR	310.325,84	0,09
35.907	NEXI SPA	EUR	377.023,50	0,11
26.733	POSTE ITALIANE SPA	EUR	275.884,56	0,08
7.436	RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA E FARMACEUTICA SPA	EUR	339.379,04	0,10
927.572	TELECOM ITALIA SPA/MILANO	EUR	309.345,26	0,08
448.572	TERNA - RETE ELETTRICA NAZIONALE	EUR	3.492.581,59	0,99
91.032	UNICREDIT SPA	EUR	897.120,36	0,25
			<b>7.873.757,29</b>	<b>2,23</b>
<b>Österreich</b>				
125.219	OMV AG	EUR	5.433.252,41	1,55
9.306	VERBUND AG	EUR	888.723,00	0,25
46.236	VOESTALPINE AG	EUR	1.249.296,72	0,35
			<b>7.571.272,13</b>	<b>2,15</b>
<b>Norwegen</b>				
35.379	ADEVINTA ASA - B	NOK	294.042,80	0,08
41.120	DNB BANK ASA	NOK	845.729,46	0,24
498.762	NORSK HYDRO ASA	NOK	4.413.953,68	1,25
112.877	ORKLA ASA	NOK	909.140,80	0,26
11.039	SCHIBSTED ASA - A	NOK	247.466,64	0,07
2.245	SCHIBSTED ASA - B	NOK	43.473,89	0,01
			<b>6.753.807,27</b>	<b>1,91</b>
<b>Finnland</b>				
16.882	KESKO OYJ - B	EUR	422.218,82	0,12
63.659	NESTE OYJ	EUR	2.640.575,32	0,75
237.469	NOKIA OYJ	EUR	1.183.901,70	0,33
143.055	NORDEA BANK ABP	SEK	1.342.361,05	0,38
1.885	ORION OYJ - B	EUR	77.567,75	0,02
15.225	SAMPO OYJ - A	EUR	675.685,50	0,19
36.398	WARTSILA OYJ	EUR	302.321,79	0,09
			<b>6.644.631,93</b>	<b>1,88</b>
<b>Belgien</b>				
11.234	AGEAS SA/NV	EUR	514.966,56	0,15
6.956	KBC GROUP NV	EUR	454.783,28	0,13
8.622	PROXIMUS SADP	EUR	145.280,70	0,04
13.858	UCB SA	EUR	1.502.900,10	0,43
36.308	UMICORE SA	EUR	1.429.082,88	0,40
			<b>4.047.013,52</b>	<b>1,15</b>
<b>Jersey</b>				
39.646	EXPERIAN PLC	GBP	1.384.459,74	0,39
12.790	FERGUSON PLC	GBP	1.571.012,51	0,45

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
90.054	WPP PLC	GBP	1.068.847,35	0,30
			<b>4.024.319,60</b>	<b>1,14</b>
<b>Irland</b>				
7.932	DCC PLC	GBP	556.232,16	0,16
9.179	KINGSPAN GROUP PLC	EUR	817.298,16	0,23
38.250	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	EUR	1.547.212,50	0,44
			<b>2.920.742,82</b>	<b>0,83</b>
<b>Luxemburg</b>				
111.970	AROUNDTOWN SA	EUR	581.572,18	0,16
6.942	EUROFINS SCIENTIFIC SE	EUR	624.155,22	0,18
			<b>1.205.727,40</b>	<b>0,34</b>
<b>Supranational-Multinational</b>				
2.105	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	EUR	143.518,90	0,04
7.382	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	EUR	503.304,76	0,14
			<b>646.823,66</b>	<b>0,18</b>
<b>Portugal</b>				
28.131	JERONIMO MARTINS SGPS SA	EUR	611.286,63	0,17
			<b>611.286,63</b>	<b>0,17</b>
			<b>350.449.550,24</b>	<b>99,36</b>

**Wertpapierbestand Gesamt 350.449.550,24 99,36**

### Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick

		% NIW
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	<b>350.449.550,24</b>	<b>99,36</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>
<b>Bankguthaben</b>	<b>1.510.187,96</b>	<b>0,43</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>	<b>740.442,60</b>	<b>0,21</b>
<b>Nettovermögen Gesamt</b>	<b>352.700.180,80</b>	<b>100,00</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) European Equity

(ausgedrückt in EUR)

### Statistische Angaben

<b>Nettovermögen</b>	31.03.2022	EUR	206.909.968,84	<b>Anzahl der Anteile</b>				
	30.09.2021	EUR	201.580.980,03					
	30.09.2020	EUR	143.042.056,03					
<b>Nettoinventarwert pro Anteil**</b>				Capitalisation P (EUR)	31.03.2022		1.038.911	
					30.09.2021		1.080.407	
					30.09.2020		1.240.655	
Capitalisation I (EUR)	31.03.2022	EUR	93,07	Capitalisation X (EUR)	31.03.2022		50.416	
	30.09.2021	EUR	90,79		30.09.2021		54.963	
	30.09.2020	EUR	68,96		30.09.2020		56.548	
Capitalisation N (EUR)	31.03.2022	EUR	86,09	Capitalisation X Hedged (i) (CZK)	31.03.2022		13.600	
	30.09.2021	EUR	84,09		30.09.2021		14.368	
	30.09.2020	EUR	64,03		30.09.2020		14.327	
Capitalisation O (EUR)	31.03.2022	EUR	84,60	Capitalisation Z (EUR)	31.03.2022		4.190	
	30.09.2021	EUR	82,53		30.09.2021		2.592	
	30.09.2020	EUR	62,68		30.09.2020		-	
Capitalisation P (EUR)	31.03.2022	EUR	81,46	Distribution P (EUR)	31.03.2022		114.048	
	30.09.2021	EUR	79,83		30.09.2021		119.264	
	30.09.2020	EUR	61,19		30.09.2020		137.803	
Capitalisation X (EUR)	31.03.2022	EUR	73,02	Distribution R (EUR)	31.03.2022		597	
	30.09.2021	EUR	71,74		30.09.2021		597	
	30.09.2020	EUR	55,26		30.09.2020		597	
Capitalisation X Hedged (i) (CZK)	31.03.2022	CZK	17.556,76	<b>Dividende</b>				
	30.09.2021	CZK	17.053,17		Distribution P (EUR)	14.12.2021	EUR	0,80
	30.09.2020	CZK	13.111,76		Distribution R (EUR)	14.12.2021	EUR	6,40
Capitalisation Z (EUR)	31.03.2022	EUR	5.287,05	<b>Laufende Kosten in %*</b>				
	30.09.2021	EUR	5.145,35		Capitalisation I (EUR)	31.03.2022		0,69%
	30.09.2020	EUR	-		Capitalisation N (EUR)	31.03.2022		0,95%
Distribution P (EUR)	31.03.2022	EUR	51,04	Capitalisation O (EUR)	31.03.2022		0,69%	
	30.09.2021	EUR	50,79	Capitalisation P (EUR)	31.03.2022		1,60%	
	30.09.2020	EUR	39,40	Capitalisation X (EUR)	31.03.2022		2,10%	
Distribution R (EUR)	31.03.2022	EUR	292,77	Capitalisation X Hedged (i) (CZK)	31.03.2022		2,12%	
	30.09.2021	EUR	292,15	Capitalisation Z (EUR)	31.03.2022		0,21%	
	30.09.2020	EUR	226,61	Distribution P (EUR)	31.03.2022		1,60%	
<b>Anzahl der Anteile</b>				Distribution R (EUR)	31.03.2022		0,95%	
	31.03.2022		849.276					
	30.09.2021		887.348					
Capitalisation I (EUR)	30.09.2020		724.131					
	31.03.2022		6.124					
	30.09.2021		5.289					
Capitalisation N (EUR)	30.09.2020		10.345					
	31.03.2022		13.136					
	30.09.2021		13.949					
Capitalisation O (EUR)	30.09.2020		14.552					
	31.03.2022							
	30.09.2021							
30.09.2020								

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.



## NN (L) European Equity

(ausgedrückt in EUR)

### Statistische Angaben (Fortsetzung)

Portfolioumsatz in %*	31.03.2022	152,63%
-----------------------	------------	---------

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

## NN (L) European Equity

(ausgedrückt in EUR)

### Finanzabschlüsse

#### Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022

	Erläuterungen	
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	2	<b>203.676.681,20</b>
Aktien		203.676.681,20
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	2	<b>324.975,40</b>
Devisentermingeschäfte		324.975,40
<b>Bankguthaben</b>		<b>2.154.688,79</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte</b>	4	<b>1.279.996,89</b>
<b>Vermögenswerte Gesamt</b>		<b>207.436.342,28</b>
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>	4, 12	<b>(526.373,44)</b>
<b>Verbindlichkeiten Gesamt</b>		<b>(526.373,44)</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Berichtszeitraums</b>		<b>206.909.968,84</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) European Equity

(ausgedrückt in EUR)

## Wertpapierbestand zum 31.03.2022

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW	Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
<b>Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>									
<b>Aktien</b>									
<b>Frankreich</b>									
15.989	AMUNDI SA	EUR	994.515,80	0,48	46.718	SAP SE	EUR	4.724.124,16	2,28
79.183	AXA SA	EUR	2.103.496,40	1,02	24.990	SIEMENS AG - REG	EUR	3.140.243,40	1,52
56.536	BNP PARIBAS SA	EUR	2.935.914,48	1,42	18.006	SIEMENS HEALTHINEERS AG	EUR	1.012.657,44	0,49
13.642	CAPGEMINI SE	EUR	2.762.505,00	1,34				<b>23.625.394,05</b>	<b>11,42</b>
104.048	COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	EUR	5.646.684,96	2,72	<b>Schweden</b>				
32.536	EIFFAGE SA	EUR	3.033.656,64	1,47	32.867	BOLIDEN AB	SEK	1.515.417,40	0,73
103.413	ENGIE SA	EUR	1.234.130,74	0,59	103.033	GETINGE AB	SEK	3.746.029,19	1,81
4.622	KERING SA	EUR	2.660.885,40	1,29	87.462	HUSQVARNA AB - B	SEK	832.173,68	0,40
12.996	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	EUR	8.439.602,40	4,08	324.438	TELE2 AB - B	SEK	4.452.358,00	2,16
122.292	REXEL SA	EUR	2.376.133,56	1,14				<b>10.545.978,27</b>	<b>5,10</b>
73.744	SANOFI	EUR	6.822.057,44	3,30	<b>Italien</b>				
2.840	TELEPERFORMANCE	EUR	983.492,00	0,48	404.510	ENI SPA	EUR	5.377.555,94	2,60
45.692	VEOLIA ENVIRONNEMENT SA	EUR	1.329.180,28	0,64	643.358	INTESA SANPAOLO SPA	EUR	1.340.436,39	0,65
			<b>41.322.255,10</b>	<b>19,97</b>				<b>6.717.992,33</b>	<b>3,25</b>
<b>Vereinigtes Königreich</b>					<b>Dänemark</b>				
26.227	ASTRAZENECA PLC	GBP	3.144.528,55	1,52	1.014	AP MOLLER - MAERSK AS - B	DKK	2.776.810,57	1,34
1.232.597	BARCLAYS PLC	GBP	2.163.087,07	1,05	31.779	NOVO NORDISK AS - B	DKK	3.199.494,20	1,55
323.864	GLAXOSMITHKLINE PLC	GBP	6.312.781,44	3,05				<b>5.976.304,77</b>	<b>2,89</b>
1.167.096	NATWEST GROUP PLC	GBP	2.981.748,21	1,44	<b>Finnland</b>				
125.839	PERSIMMON PLC	GBP	3.203.077,25	1,55	542.169	NORDEA BANK ABP	SEK	5.087.459,72	2,46
176.792	RELX PLC	EUR	4.992.606,08	2,41				<b>5.087.459,72</b>	<b>2,46</b>
405.218	SHELL PLC	EUR	10.112.215,19	4,89	<b>Australien</b>				
1.326.392	TESCO PLC	GBP	4.332.042,62	2,09	132.652	BHP GROUP LTD	GBP	4.633.849,24	2,24
129.192	3I GROUP PLC	GBP	2.122.722,63	1,03				<b>4.633.849,24</b>	<b>2,24</b>
			<b>39.364.809,04</b>	<b>19,03</b>	<b>Irland</b>				
<b>Schweiz</b>					7.426	LINDE PLC	EUR	2.157.253,00	1,04
5.466	KUEHNE + NAGEL INTERNATIONAL AG - REG	CHF	1.404.513,98	0,68	20.552	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	EUR	831.328,40	0,40
89.826	NESTLE SA - REG	CHF	10.544.891,62	5,10				<b>2.988.581,40</b>	<b>1,44</b>
2.743	ROCHE HOLDING AG	CHF	1.084.966,73	0,52	<b>Norwegen</b>				
12.121	ROCHE HOLDING AG - GENUSSSCHEIN	CHF	4.337.992,23	2,10	42.872	EQUINOR ASA	NOK	1.459.470,54	0,71
7.863	SWISS LIFE HOLDING AG - REG	CHF	4.563.063,53	2,21	52.828	MOWI ASA	NOK	1.292.326,91	0,62
226.070	UBS GROUP AG - REG	CHF	4.006.226,50	1,93				<b>2.751.797,45</b>	<b>1,33</b>
4.867	ZURICH INSURANCE GROUP AG	CHF	2.171.316,00	1,05	<b>Österreich</b>				
			<b>28.112.970,59</b>	<b>13,59</b>	28.295	ERSTE GROUP BANK AG	EUR	936.281,55	0,45
<b>Niederlande</b>					43.446	WIENERBERGER AG	EUR	1.190.420,40	0,58
534.908	AEGON NV	EUR	2.568.628,22	1,25				<b>2.126.701,95</b>	<b>1,03</b>
18.526	ASML HOLDING NV	EUR	11.300.860,00	5,46	<b>Jersey</b>				
59.449	ASR NEDERLAND NV	EUR	2.510.531,27	1,21	161.173	WPP PLC	GBP	1.912.955,94	0,92
22.579	HEINEKEN NV	EUR	1.954.889,82	0,94				<b>1.912.955,94</b>	<b>0,92</b>
175.391	KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	EUR	5.106.508,97	2,47	<b>Luxemburg</b>				
190.426	STELLANTIS NV	EUR	2.817.923,95	1,36	29.562	APERAM SA	EUR	1.188.688,02	0,57
			<b>26.259.342,23</b>	<b>12,69</b>				<b>1.188.688,02</b>	<b>0,57</b>
<b>Deutschland</b>					<b>Spanien</b>				
45.726	COVESTRO AG	EUR	2.096.079,84	1,01	53.684	ENDESA SA	EUR	1.061.601,10	0,51
34.762	DAIMLER TRUCK HOLDING AG	EUR	877.045,26	0,42				<b>1.061.601,10</b>	<b>0,51</b>
113.467	DEUTSCHE POST AG - REG	EUR	4.941.487,85	2,39				<b>203.676.681,20</b>	<b>98,44</b>
141.395	DEUTSCHE TELEKOM AG - REG	EUR	2.394.100,14	1,16	<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>				
68.514	INFINEON TECHNOLOGIES AG	EUR	2.122.906,29	1,03				<b>203.676.681,20</b>	<b>98,44</b>
36.307	MERCEDES-BENZ GROUP AG	EUR	2.316.749,67	1,12					

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) European Equity

(ausgedrückt in EUR)

### Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022

Zu erhalten	Zu zahlen	Fälligkeits- datum	Engagement in EUR	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR
<b>Devisentermingeschäfte</b>				
256.179.559,39 CZK	10.101.556,07 EUR	19/04/2022	10.101.556,07	363.721,44
804.271,37 EUR	20.636.225,61 CZK	19/04/2022	804.271,37	(38.746,04)
			<b>10.905.827,44</b>	<b>324.975,40</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>				<b>324.975,40</b>

### Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick

		% NIW
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	<b>203.676.681,20</b>	<b>98,44</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	<b>324.975,40</b>	<b>0,16</b>
<b>Bankguthaben</b>	<b>2.154.688,79</b>	<b>1,04</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>	<b>753.623,45</b>	<b>0,36</b>
<b>Nettovermögen Gesamt</b>	<b>206.909.968,84</b>	<b>100,00</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) European High Dividend

(ausgedrückt in EUR)

### Statistische Angaben

### Anzahl der Anteile

<b>Nettovermögen</b>	31.03.2022	EUR	208.167.801,38	Capitalisation I (EUR)	31.03.2022	157.564		
	30.09.2021	EUR	209.640.445,70		30.09.2021	166.068		
	30.09.2020	EUR	194.649.872,62		30.09.2020	215.817		
<b>Nettoinventarwert pro Anteil**</b>				Capitalisation I Hedged (i) (PLN)	31.03.2022	2.488		
					30.09.2021	2.262		
					30.09.2020	2.238		
Capitalisation I (EUR)	31.03.2022	EUR	589,22	Capitalisation N (EUR)	31.03.2022	76.590		
	30.09.2021	EUR	559,14		30.09.2021	93.528		
	30.09.2020	EUR	439,42		30.09.2020	101.022		
Capitalisation I Hedged (i) (PLN)	31.03.2022	PLN	53.396,06	Capitalisation P (EUR)	31.03.2022	53.389		
	30.09.2021	PLN	50.325,68		30.09.2021	53.681		
	30.09.2020	PLN	39.396,91		30.09.2020	57.524		
Capitalisation N (EUR)	31.03.2022	EUR	536,82	Capitalisation P Hedged (ii) (USD)	31.03.2022	12.379		
	30.09.2021	EUR	509,64		30.09.2021	12.300		
	30.09.2020	EUR	400,89		30.09.2020	12.487		
Capitalisation P (EUR)	31.03.2022	EUR	497,57	Capitalisation R (EUR)	31.03.2022	4.625		
	30.09.2021	EUR	474,51		30.09.2021	4.650		
	30.09.2020	EUR	376,62		30.09.2020	8.064		
Capitalisation P Hedged (ii) (USD)	31.03.2022	USD	385,83	Capitalisation S (EUR)	31.03.2022	-		
	30.09.2021	USD	369,95		30.09.2021	-		
	30.09.2020	USD	294,41		30.09.2020	0.24		
Capitalisation R (EUR)	31.03.2022	EUR	308,33	Capitalisation V (EUR)	31.03.2022	5.896		
	30.09.2021	EUR	292,95		30.09.2021	7.901		
	30.09.2020	EUR	230,77		30.09.2020	15.953		
Capitalisation S (EUR)	31.03.2022	EUR	-	Capitalisation X (EUR)	31.03.2022	14.427		
	30.09.2021	EUR	-		30.09.2021	14.956		
	30.09.2020	EUR	435,85		30.09.2020	16.362		
Capitalisation V (EUR)	31.03.2022	EUR	184,07	Capitalisation X Hedged (ii) (USD)	31.03.2022	20		
	30.09.2021	EUR	175,46		30.09.2021	84		
	30.09.2020	EUR	139,14		30.09.2020	-		
Capitalisation X (EUR)	31.03.2022	EUR	456,47	Distribution N (EUR)	31.03.2022	4.135		
	30.09.2021	EUR	436,40		30.09.2021	3.592		
	30.09.2020	EUR	348,11		30.09.2020	3.155		
Capitalisation X Hedged (ii) (USD)	31.03.2022	USD	363,22	Distribution P (EUR)	31.03.2022	12.495		
	30.09.2021	USD	349,00		30.09.2021	13.796		
	30.09.2020	USD	-		30.09.2020	17.571		
Distribution N (EUR)	31.03.2022	EUR	302,72	Distribution R (EUR)	31.03.2022	3.083		
	30.09.2021	EUR	296,48		30.09.2021	3.019		
	30.09.2020	EUR	240,20		30.09.2020	2.608		
Distribution P (EUR)	31.03.2022	EUR	280,34	<b>Dividende</b>				
	30.09.2021	EUR	275,82		Distribution N (EUR)	14.12.2021	EUR	9,40
	30.09.2020	EUR	225,49		Distribution P (EUR)	14.12.2021	EUR	8,75
Distribution R (EUR)	31.03.2022	EUR	275,41					
	30.09.2021	EUR	269,93					
	30.09.2020	EUR	219,02					

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

## NN (L) European High Dividend

(ausgedrückt in EUR)

### Statistische Angaben (Fortsetzung)

Distribution R (EUR)	14.12.2021	EUR	8,55
----------------------	------------	-----	------

#### Laufende Kosten in %\*

Capitalisation I (EUR)	31.03.2022		0,81%
------------------------	------------	--	-------

Capitalisation I Hedged (i) (PLN)	31.03.2022		0,83%
-----------------------------------	------------	--	-------

Capitalisation N (EUR)	31.03.2022		0,90%
------------------------	------------	--	-------

Capitalisation P (EUR)	31.03.2022		1,80%
------------------------	------------	--	-------

Capitalisation P Hedged (ii) (USD)	31.03.2022		1,82%
------------------------------------	------------	--	-------

Capitalisation R (EUR)	31.03.2022		1,05%
------------------------	------------	--	-------

Capitalisation V (EUR)	31.03.2022		1,71%
------------------------	------------	--	-------

Capitalisation X (EUR)	31.03.2022		2,30%
------------------------	------------	--	-------

Capitalisation X Hedged (ii) (USD)	31.03.2022		2,32%
------------------------------------	------------	--	-------

Distribution N (EUR)	31.03.2022		0,90%
----------------------	------------	--	-------

Distribution P (EUR)	31.03.2022		1,80%
----------------------	------------	--	-------

Distribution R (EUR)	31.03.2022		1,05%
----------------------	------------	--	-------

<b>Portfolioumsatz in %*</b>	31.03.2022		150,88%
------------------------------	------------	--	---------

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

## NN (L) European High Dividend

(ausgedrückt in EUR)

### Finanzabschlüsse

#### Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022

	Erläuterungen	
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	2	<b>202.726.415,69</b>
Aktien		202.726.415,69
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	2	<b>419.360,64</b>
Devisentermingeschäfte		419.360,64
<b>Bankguthaben</b>		<b>4.690.169,50</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte</b>	4	<b>919.317,30</b>
<b>Vermögenswerte Gesamt</b>		<b>208.755.263,13</b>
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>	4, 12	<b>(587.461,75)</b>
<b>Verbindlichkeiten Gesamt</b>		<b>(587.461,75)</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Berichtszeitraums</b>		<b>208.167.801,38</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) European High Dividend

(ausgedrückt in EUR)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
<b>Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>				
<b>Aktien</b>				
<b>Frankreich</b>				
85.028	BNP PARIBAS SA	EUR	4.415.504,04	2,12
31.072	BOUYGUES SA	EUR	982.807,36	0,47
11.722	CAPGEMINI SE	EUR	2.373.705,00	1,14
24.841	CIE GENERALE DES ETABLISSEMENTS MICHELIN SCA	EUR	3.054.200,95	1,47
45.416	COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	EUR	2.464.726,32	1,18
347.720	ENGIE SA	EUR	4.149.690,48	2,00
27.367	FAURECIA SE	EUR	647.229,55	0,31
7.515	KERING SA	EUR	4.326.385,50	2,08
13.670	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	EUR	8.877.298,00	4,26
22.661	PERNOD RICARD SA	EUR	4.516.337,30	2,17
104.094	REXEL SA	EUR	2.022.546,42	0,98
16.868	SANOFI	EUR	1.560.458,68	0,75
98.045	TOTALENERGIES SE	EUR	4.513.011,35	2,17
44.651	VINCI SA	EUR	4.152.096,49	1,99
			<b>48.055.997,44</b>	<b>23,09</b>
<b>Deutschland</b>				
22.174	ALLIANZ SE - REG	EUR	4.801.779,70	2,31
32.338	COVESTRO AG	EUR	1.482.373,92	0,71
102.960	DAIMLER TRUCK HOLDING AG	EUR	2.597.680,80	1,25
23.993	DEUTSCHE BOERSE AG	EUR	3.910.859,00	1,88
43.352	DEUTSCHE POST AG - REG	EUR	1.887.979,60	0,91
279.716	DEUTSCHE TELEKOM AG - REG	EUR	4.736.151,31	2,28
394.511	E.ON SE	EUR	4.158.934,96	2,00
57.296	INFINEON TECHNOLOGIES AG	EUR	1.775.316,56	0,85
22.462	LEG IMMOBILIEN SE	EUR	2.319.201,50	1,11
10.624	MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGSGESSELLSCHAFT AG IN MUENCHEN - REG	EUR	2.581.632,00	1,24
31.974	SAP SE	EUR	3.233.210,88	1,55
51.983	SIEMENS AG - REG	EUR	6.532.183,78	3,14
80.717	SIEMENS HEALTHINEERS AG	EUR	4.539.524,08	2,18
14.678	STROER SE & CO KGAA	EUR	918.842,80	0,44
			<b>45.475.670,89</b>	<b>21,85</b>
<b>Schweiz</b>				
79.021	NESTLE SA - REG	CHF	9.276.466,51	4,46
138.523	NOVARTIS AG - REG	CHF	10.992.104,54	5,28
21.403	ROCHE HOLDING AG - GENUSSCHEIN	CHF	7.659.932,98	3,68
118.940	UBS GROUP AG - REG	CHF	2.107.756,80	1,01
16.612	ZURICH INSURANCE GROUP AG	CHF	7.411.115,98	3,56
			<b>37.447.376,81</b>	<b>17,99</b>
<b>Vereinigtes Königreich</b>				
59.956	ASTRAZENECA PLC	GBP	7.188.521,51	3,45
767.503	HSBC HOLDINGS PLC	GBP	4.771.796,28	2,29
1.160.104	NATWEST GROUP PLC	GBP	2.963.884,75	1,43
74.483	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	GBP	5.140.275,79	2,47
480.062	SHELL PLC	GBP	11.977.955,08	5,75
100.548	UNILEVER PLC	GBP	4.110.865,17	1,97
			<b>36.153.298,58</b>	<b>17,36</b>

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
<b>Niederlande</b>				
230.172	AEGON NV	EUR	1.105.285,94	0,52
36.920	AIRBUS SE	EUR	4.074.491,20	1,96
2.084	ASML HOLDING NV	EUR	1.271.240,00	0,61
41.765	HEINEKEN NV	EUR	3.616.013,70	1,74
137.058	KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	EUR	3.990.443,67	1,92
			<b>14.057.474,51</b>	<b>6,75</b>
<b>Finnland</b>				
283.140	NORDEA BANK ABP	SEK	2.656.853,02	1,27
100.245	UPM-KYMMENE OYJ	EUR	2.973.266,70	1,43
			<b>5.630.119,72</b>	<b>2,70</b>
<b>Australien</b>				
148.981	BHP GROUP LTD	GBP	5.204.259,97	2,50
			<b>5.204.259,97</b>	<b>2,50</b>
<b>Schweden</b>				
344.192	TELE2 AB - B	SEK	4.723.447,94	2,27
			<b>4.723.447,94</b>	<b>2,27</b>
<b>Irland</b>				
62.047	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	EUR	2.509.801,15	1,21
			<b>2.509.801,15</b>	<b>1,21</b>
<b>Belgien</b>				
17.255	UCB SA	EUR	1.871.304,75	0,90
			<b>1.871.304,75</b>	<b>0,90</b>
<b>Luxemburg</b>				
39.733	APERAM SA	EUR	1.597.663,93	0,77
			<b>1.597.663,93</b>	<b>0,77</b>
			<b>202.726.415,69</b>	<b>97,39</b>
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>			<b>202.726.415,69</b>	<b>97,39</b>

### Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022

Zu erhalten	Zu zahlen	Fälligkeits- datum	Engagement in EUR	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR		
<b>Devisentermingeschäfte</b>						
147.612.527,64	PLN	31.200.295,14	EUR	19/04/2022	31.200.295,14	577.759,51
1.046.569,15	USD	781.862,38	GBP	20/04/2022	932.090,56	15.491,38
3.083.219,46	USD	2.760.787,73	EUR	20/04/2022	2.760.787,73	8.984,87
278.570,35	EUR	306.382,88	USD	20/04/2022	278.570,35	3.335,03
843.137,33	USD	773.583,49	CHF	20/04/2022	750.657,22	1.857,36
83.944,59	SEK	8.435,86	USD	20/04/2022	7.743,51	515,80
54.943,30	GBP	72.014,68	USD	20/04/2022	66.360,88	286,01
2,05	USD	13,63	DKK	20/04/2022	1,83	0,01
21,40	USD	188,96	NOK	20/04/2022	19,05	(0,18)

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.



## NN (L) European High Dividend

(ausgedrückt in EUR)

### Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Zu erhalten	Zu zahlen	Fälligkeits- datum	Engagement in EUR	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR
165.436,49 USD	1.584.995,16 SEK	20/04/2022	148.001,39	(4.209,64)
3.530.952,36 EUR	17.259.422,12 PLN	19/04/2022	3.530.952,36	(184.659,51)
			<b>39.675.480,02</b>	<b>419.360,64</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>				<b>419.360,64</b>

### Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick

		% NIW
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	<b>202.726.415,69</b>	<b>97,39</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	<b>419.360,64</b>	<b>0,20</b>
<b>Bankguthaben</b>	<b>4.690.169,50</b>	<b>2,25</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>	<b>331.855,55</b>	<b>0,16</b>
<b>Nettovermögen Gesamt</b>	<b>208.167.801,38</b>	<b>100,00</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) European High Yield

(ausgedrückt in EUR)

### Statistische Angaben

<b>Nettovermögen</b>	31.03.2022	EUR	152.933.490,62	Distribution I (Q) Hedged (ii) (EUR)	31.03.2022	EUR	5.019,45
	30.09.2021	EUR	139.908.509,31		30.09.2021	EUR	5.300,80
	30.09.2020	EUR	106.174.848,60		30.09.2020	EUR	5.000,87
<b>Nettoinventarwert pro Anteil**</b>				Distribution P (EUR)	31.03.2022	EUR	1.289,48
					30.09.2021	EUR	1.372,66
					30.09.2020	EUR	1.280,99
Capitalisation I (EUR)	31.03.2022	EUR	6.068,08	Distribution R (EUR)	31.03.2022	EUR	1.290,13
	30.09.2021	EUR	6.309,91		30.09.2021	EUR	1.376,23
	30.09.2020	EUR	5.731,19		30.09.2020	EUR	1.284,18
Capitalisation I Hedged (i) (USD)	31.03.2022	USD	7.530,35	Distribution X (EUR)	31.03.2022	EUR	245,61
	30.09.2021	USD	7.788,04		30.09.2021	EUR	260,78
	30.09.2020	USD	7.011,63		30.09.2020	EUR	243,43
Capitalisation I Hedged (ii) (CHF)	31.03.2022	CHF	5.998,06	Distribution Z (M) Hedged (ii) (JPY)	31.03.2022	JPY	10.260,00
	30.09.2021	CHF	6.259,60		30.09.2021	JPY	10.739,00
	30.09.2020	CHF	5.730,99		30.09.2020	JPY	-
Capitalisation I Hedged (ii) (EUR)	31.03.2022	EUR	9.588,88	<b>Anzahl der Anteile</b>			
	30.09.2021	EUR	9.995,18		Capitalisation I (EUR)	31.03.2022	617
	30.09.2020	EUR	9.137,42		30.09.2021	553	
Capitalisation N (EUR)	31.03.2022	EUR	459,00	30.09.2020	255		
	30.09.2021	EUR	477,09	Capitalisation I Hedged (i) (USD)	31.03.2022	159	
	30.09.2020	EUR	433,00	30.09.2021	186		
Capitalisation P (EUR)	31.03.2022	EUR	440,31	30.09.2020	239		
	30.09.2021	EUR	458,82	Capitalisation I Hedged (ii) (CHF)	31.03.2022	36	
	30.09.2020	EUR	418,48	30.09.2021	36		
Capitalisation P Hedged (ii) (CHF)	31.03.2022	CHF	288,65	30.09.2020	36		
	30.09.2021	CHF	301,86	Capitalisation I Hedged (ii) (EUR)	31.03.2022	4.215	
	30.09.2020	CHF	277,52	30.09.2021	3.450		
Capitalisation P Hedged (ii) (USD)	31.03.2022	USD	349,63	30.09.2020	3.232		
	30.09.2021	USD	363,09	Capitalisation N (EUR)	31.03.2022	3.099	
	30.09.2020	USD	330,30	30.09.2021	3.449		
Capitalisation R (EUR)	31.03.2022	EUR	-	30.09.2020	2.387		
	30.09.2021	EUR	-	Capitalisation P (EUR)	31.03.2022	11.979	
	30.09.2020	EUR	262,55	30.09.2021	12.733		
Capitalisation S (EUR)	31.03.2022	EUR	-	30.09.2020	17.422		
	30.09.2021	EUR	6.527,30	Capitalisation P Hedged (ii) (CHF)	31.03.2022	616	
	30.09.2020	EUR	5.931,00	30.09.2021	616		
Capitalisation X (EUR)	31.03.2022	EUR	421,46	30.09.2020	616		
	30.09.2021	EUR	440,27	Capitalisation P Hedged (ii) (USD)	31.03.2022	2.987	
	30.09.2020	EUR	403,61	30.09.2021	4.129		
Capitalisation Z (EUR)	31.03.2022	EUR	9.130,79	30.09.2020	5.845		
	30.09.2021	EUR	9.460,75	Capitalisation R (EUR)	31.03.2022	-	
	30.09.2020	EUR	8.531,49	30.09.2021	-		
Capitalisation Zz (EUR)	31.03.2022	EUR	286.106,28	30.09.2020	224		
	30.09.2021	EUR	296.222,85				
	30.09.2020	EUR	266.726,37				

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

## NN (L) European High Yield

(ausgedrückt in EUR)

### Statistische Angaben (Fortsetzung)

#### Anzahl der Anteile

Capitalisation S (EUR)	31.03.2022	-
	30.09.2021	8
	30.09.2020	8
Capitalisation X (EUR)	31.03.2022	2.778
	30.09.2021	4.008
	30.09.2020	1.431
Capitalisation Z (EUR)	31.03.2022	7.648
	30.09.2021	6.203
	30.09.2020	4.700
Capitalisation Zz (EUR)	31.03.2022	7
	30.09.2021	7
	30.09.2020	8
Distribution I (Q) Hedged (ii) (EUR)	31.03.2022	1.268
	30.09.2021	1.223
	30.09.2020	943
Distribution P (EUR)	31.03.2022	10.727
	30.09.2021	11.104
	30.09.2020	11.040
Distribution R (EUR)	31.03.2022	731
	30.09.2021	831
	30.09.2020	1.040
Distribution X (EUR)	31.03.2022	2.078
	30.09.2021	2.511
	30.09.2020	1.348
Distribution Z (M) Hedged (ii) (JPY)	31.03.2022	66.097
	30.09.2021	65.429
	30.09.2020	-

#### Dividende

Distribution I (Q) Hedged (ii) (EUR)	11.02.2022	EUR	31,03
Distribution I (Q) Hedged (ii) (EUR)	11.11.2021	EUR	36,80
Distribution P (EUR)	14.12.2021	EUR	28,95
Distribution R (EUR)	14.12.2021	EUR	34,55
Distribution X (EUR)	14.12.2021	EUR	4,20
Distribution Z (M) Hedged (ii) (JPY)	02.03.2022	JPY	17,00
Distribution Z (M) Hedged (ii) (JPY)	02.02.2022	JPY	17,00
Distribution Z (M) Hedged (ii) (JPY)	04.01.2022	JPY	17,00

Distribution Z (M) Hedged (ii) (JPY)	02.12.2021	JPY	18,90
Distribution Z (M) Hedged (ii) (JPY)	02.11.2021	JPY	18,90
Distribution Z (M) Hedged (ii) (JPY)	04.10.2021	JPY	18,90

#### Laufende Kosten in %\*

Capitalisation I (EUR)	31.03.2022	0,88%
Capitalisation I Hedged (i) (USD)	31.03.2022	0,90%
Capitalisation I Hedged (ii) (CHF)	31.03.2022	0,90%
Capitalisation I Hedged (ii) (EUR)	31.03.2022	0,90%
Capitalisation N (EUR)	31.03.2022	0,80%
Capitalisation P (EUR)	31.03.2022	1,30%
Capitalisation P Hedged (ii) (CHF)	31.03.2022	1,32%
Capitalisation P Hedged (ii) (USD)	31.03.2022	1,32%
Capitalisation X (EUR)	31.03.2022	1,80%
Capitalisation Z (EUR)	31.03.2022	0,16%
Capitalisation Zz (EUR)	31.03.2022	0,01%
Distribution I (Q) Hedged (ii) (EUR)	31.03.2022	0,90%
Distribution P (EUR)	31.03.2022	1,30%
Distribution R (EUR)	31.03.2022	0,90%
Distribution X (EUR)	31.03.2022	1,80%
Distribution Z (M) Hedged (ii) (JPY)	31.03.2022	0,18%

<b>Portfolioumsatz in %*</b>	31.03.2022	51,57%
------------------------------	------------	--------

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

## NN (L) European High Yield

(ausgedrückt in EUR)

### Finanzabschlüsse

#### Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022

	Erläuterungen	
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	2	<b>146.366.826,28</b>
Aktien		479.668,80
Organismen für gemeinsame Anlagen		1.982.620,41
Anleihen und andere Schuldtitel		143.904.537,07
<b>Bankguthaben</b>		<b>3.728.352,00</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte</b>	4, 12	<b>7.177.492,19</b>
<b>Vermögenswerte Gesamt</b>		<b>157.272.670,47</b>
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>	4	<b>(4.207.903,29)</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	2	<b>(131.276,56)</b>
Devisentermingeschäfte		(131.276,56)
<b>Verbindlichkeiten Gesamt</b>		<b>(4.339.179,85)</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Berichtszeitraums</b>		<b>152.933.490,62</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) European High Yield

(ausgedrückt in EUR)

## Wertpapierbestand zum 31.03.2022

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW	Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
<b>Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>									
<b>Aktien</b>									
<b>Kroatien</b>									
245.984	FORTENOVA EQUITY	EUR	479.668,80	0,31					
			<b>479.668,80</b>	<b>0,31</b>					
<b>Anleihen und andere Schuldtitel</b>									
<b>Frankreich</b>									
300.000	ACCOR SA FRN PERP	EUR	284.376,67	0,19					
400.000	ACCOR SA FRN PERP	EUR	401.952,15	0,26					
1.200.000	ALTICE FRANCE SA 2.125% 15/02/2025	EUR	1.141.350,54	0,75					
500.000	ALTICE FRANCE SA 3.375% 15/01/2028	EUR	454.123,61	0,30					
245.000	ALTICE FRANCE SA 4.125% 15/01/2029	EUR	221.872,63	0,15					
293.000	ALTICE FRANCE SA/FRANCE 4.000% 15/07/2029	EUR	263.854,38	0,17					
850.000	CASINO GUICHARD PERRACHO 5.250% 15/04/2027	EUR	724.273,01	0,47					
400.000	CASINO GUICHARD PERRACHON SA FRN PERP EMTN	EUR	184.309,87	0,12					
3.500.000	CASINO GUICHARD PERRACHON SA 1.865% 13/06/2022 EMTN	EUR	3.495.893,28	2,29					
400.000	CASINO GUICHARD PERRACHON SA 2.798% 05/08/2026 EMTN	EUR	339.143,70	0,22					
400.000	CASINO GUICHARD PERRACHON SA 4.498% 07/03/2024 EMTN	EUR	373.693,58	0,24					
930.000	CONSTELLUM SE 3.125% 15/07/2029	EUR	852.339,39	0,56					
900.000	CONSTELLUM SE 4.250% 15/02/2026	EUR	901.219,94	0,59					
2.000.000	ELECTRICITE DE FRANCE SA FRN PERP	EUR	1.793.325,50	1,17					
775.000	FAURECIA SE 2.375% 15/06/2027	EUR	691.409,10	0,45					
800.000	FAURECIA SE 2.375% 15/06/2029	EUR	691.215,70	0,45					
1.355.000	FAURECIA SE 2.750% 15/02/2027	EUR	1.239.437,04	0,81					
500.000	FAURECIA SE 3.125% 15/06/2026	EUR	477.339,61	0,31					
230.000	FAURECIA SE 3.750% 15/06/2028	EUR	215.988,44	0,14					
1.000.000	KAPLA HOLDING SAS 3.375% 15/12/2026	EUR	955.910,84	0,63					
600.000	LA FINANCIERE ATALIAN SASU 4.000% 15/05/2024	EUR	545.741,32	0,36					
1.000.000	LOXAM SAS 3.250% 14/01/2025	EUR	985.798,02	0,64					
675.000	LOXAM SAS 4.500% 15/02/2027	EUR	668.590,12	0,44					
1.000.000	PAPREC HOLDING SA 3.500% 01/07/2028	EUR	952.812,51	0,62					
1.500.000	PICARD GROUPE SAS 3.875% 01/07/2026	EUR	1.455.390,36	0,95					
805.000	QUATRIM SASU 5.875% 15/01/2024	EUR	804.299,88	0,53					
1.000.000	VALLOUREC SA 8.500% 30/06/2026	EUR	1.023.413,69	0,67					
1.700.000	VEOLIA ENVIRONNEMENT SA FRN PERP	EUR	1.567.064,18	1,02					
			<b>23.706.139,06</b>	<b>15,50</b>					
<b>Niederlande</b>									
700.000	ABERTIS INFRASTRUCTURAS FINANCE BV FRN PERP	EUR	642.381,83	0,42					
700.000	ABERTIS INFRASTRUCTURAS FINANCE BV FRN PERP	EUR	685.011,47	0,45					
2.000.000	AXALTA COATING SYSTEMS DUTCH HOLDING B BV 3.750% 15/01/2025	EUR	1.965.003,42	1,28					
1.100.000	DIEBOLD NIXDORF DUTCH HOLDING BV 9.000% 15/07/2025	EUR	1.136.211,12	0,74					
600.000	METINVEST BV 5.625% 17/06/2025	EUR	262.087,10	0,17					
1.212.000	NOBEL BIDCO BV 3.125% 15/06/2028	EUR	1.079.606,72	0,71					
1.500.000	NOBIAN FINANCE BV 3.625% 15/07/2026	EUR	1.365.946,65	0,89					
1.250.000	REPSOL INTERNATIONAL FINANCE BV FRN PERP	EUR	1.256.729,60	0,82					
750.000	REPSOL INTERNATIONAL FINANCE BV 25/03/2075 FRN	EUR	780.234,02	0,51					
					150.000	SAIPEM FINANCE INTERNATIONAL BV 2.625% 07/01/2025 EMTN	EUR	140.443,40	0,09
					620.000	SAIPEM FINANCE INTERNATIONAL BV 3.750% 08/09/2023 EMTN	EUR	605.144,06	0,40
					2.700.000	SIGMA HOLDCO BV 5.750% 15/05/2026	EUR	2.202.869,25	1,44
					525.000	STICHTING AK RABOBANK CERTIFICATEN 19.436% PERP STEP-UP	EUR	613.130,58	0,40
					1.500.000	TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE NETHERLANDS II BV 3.750% 09/05/2027	EUR	1.415.993,39	0,93
					835.000	TRIVIUM PACKAGING FINANCE BV 3.750% 15/08/2026	EUR	818.559,48	0,54
					1.000.000	VZ VENDOR FINANCING II BV 2.875% 15/01/2029	EUR	903.208,91	0,59
					1.319.000	WP/AP TELECOM HOLDINGS IV BV 3.750% 15/01/2029	EUR	1.254.998,84	0,82
					600.000	ZF EUROPE FINANCE BV 2.500% 23/10/2027	EUR	545.303,84	0,36
					1.000.000	ZF EUROPE FINANCE BV 3.000% 23/10/2029	EUR	894.207,25	0,58
					600.000	ZIGGO BV 2.875% 15/01/2030	EUR	547.904,89	0,36
								<b>19.114.975,82</b>	<b>12,50</b>
<b>Vereinigtes Königreich</b>									
					1.250.000	BCP V MODULAR SERVICES FINANCE II PLC 4.750% 30/11/2028	EUR	1.197.710,16	0,78
					1.600.000	BELLIS ACQUISITION CO PLC 3.250% 16/02/2026	GBP	1.748.590,52	1,14
					587.000	BELLIS ACQUISITION CO PLC 4.500% 16/02/2026	GBP	665.482,16	0,44
					206.000	BELLIS FINCO PLC 4.000% 16/02/2027	GBP	216.584,59	0,14
					900.000	CARNIVAL PLC 1.000% 28/10/2029	EUR	654.875,55	0,43
					2.000.000	EC FINANCE PLC 3.000% 15/10/2026	EUR	1.964.710,50	1,29
					1.000.000	INEOS QUATTRO FINANCE 1 PLC 3.750% 15/07/2026	EUR	940.000,00	0,61
					1.500.000	INEOS QUATTRO FINANCE 2 PLC 2.500% 15/01/2026	EUR	1.417.500,00	0,93
					300.000	JAGUAR LAND ROVER AUTOMOIVE 4.500% 15/01/2026	EUR	288.999,46	0,19
					650.000	JAGUAR LAND ROVER AUTOMOTIVE PLC 2.200% 15/01/2024	EUR	627.410,62	0,41
					300.000	JAGUAR LAND ROVER AUTOMOTIVE PLC 5.875% 15/11/2024	EUR	304.912,83	0,20
					950.000	MATALAN FINANCE PLC 6.750% 31/01/2023	GBP	1.068.076,53	0,70
					1.000.000	STONEGATE PUB CO FINANCING 2019 PLC 8.250% 31/07/2025	GBP	1.204.355,59	0,79
					1.500.000	VMED O2 UK FINANCING I PLC 3.250% 31/01/2031	EUR	1.380.269,06	0,90
					1.615.000	VODAFONE GROUP PLC 03/01/2079 FRN	EUR	1.627.333,64	1,07
					750.000	WILLIAM HILL LTD 4.750% 01/05/2026	GBP	893.945,32	0,58
					1.275.000	ZENITH FINCO PLC 6.500% 30/06/2027	GBP	1.380.537,92	0,90
								<b>17.581.294,45</b>	<b>11,50</b>
<b>Luxemburg</b>									
					300.000	ADLER GROUP SA 1.875% 14/01/2026	EUR	248.778,03	0,16
					500.000	ADLER GROUP SA 2.250% 14/01/2029	EUR	406.589,56	0,27
					500.000	ADLER GROUP SA 2.250% 27/04/2027	EUR	410.726,47	0,27
					1.400.000	ALTICE FINANCING SA 2.250% 15/01/2025	EUR	1.335.329,59	0,87
					1.250.000	ALTICE FRANCE HOLDING SA 8.000% 15/05/2027	EUR	1.291.485,05	0,84
					807.620	ARD FINANCE SA 5.000% 30/06/2027	EUR	734.449,97	0,48
					5.500.000	GALAPAGOS HOLDING SA 7.000% 15/06/2022 - DEFAULTED	EUR	55,00	(0,01)
					1.350.000	GAMMA BONDSCO SARL 8.125% 15/11/2026	EUR	1.316.578,58	0,86
					1.200.000	KLEOPATRA FINCO SARL 4.250% 01/03/2026	EUR	1.070.684,12	0,70
					450.000	KLEOPATRA HOLDINGS 2 SCA 6.500% 01/09/2026	EUR	338.159,32	0,22
					3.000.000	LINCOLN FINANCING SARL 3.625% 01/04/2024	EUR	2.996.545,23	1,96
					1.500.000	LUNE HOLDINGS SARL 5.625% 15/11/2028	EUR	1.342.724,49	0,88
					800.000	MITSUBISHI UFJ INVESTOR SERVICES & BANKING LUXEMBOURG SA 15/12/2050 FRN EMTN	EUR	315.437,82	0,21
					315.368	SUMMER BC HOLDCO A SARL 9.250% 31/10/2027	EUR	324.674,28	0,21
					2.000.000	SUMMER BC HOLDCO B SARL 5.750% 31/10/2026	EUR	2.028.887,04	1,33
					600.000	VIVION INVESTMENTS SARL 3.000% 08/08/2024	EUR	577.037,67	0,38
					700.000	VIVION INVESTMENTS SARL 3.500% 01/11/2025	EUR	669.791,20	0,44
								<b>15.407.933,42</b>	<b>10,07</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) European High Yield

(ausgedrückt in EUR)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW	Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
<b>Deutschland</b>					<b>Spanien</b>				
1.250.000	ADLER PELZER HOLDING GMBH 4.125% 01/04/2024	EUR	1.139.068,91	0,74	900.000	CELLNEX FINANCE CO SA 2.250% 12/04/2026	EUR	893.359,08	0,58
800.000	ADLER REAL ESTATE AG 1.500% 17/04/2022	EUR	791.094,37	0,52	1.018.000	EDREAMS ODIGEO SA 5.500% 15/07/2027	EUR	992.778,50	0,65
900.000	ADLER REAL ESTATE AG 1.875% 27/04/2023	EUR	853.621,78	0,56	1.200.000	GRIFOLS ESCROW ISSUER SA 3.875% 15/10/2028	EUR	1.141.150,37	0,75
550.000	APCOA PARKING HOLDINGS GMBH 4.625% 15/01/2027	EUR	516.348,69	0,34	600.000	INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP SA 0.500% 04/07/2023	EUR	582.865,69	0,38
1.000.000	CONSUS REAL ESTATE AG 4.000% 29/11/2022	EUR	943.566,74	0,62	500.000	INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP SA 2.750% 25/03/2025	EUR	475.983,07	0,31
800.000	CTEC II GMBH 5.250% 15/02/2030	EUR	737.486,93	0,48	400.000	INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP SA 3.750% 25/03/2029	EUR	360.351,39	0,24
800.000	DEUTSCHE LUFTHANSA AG 12/08/2075 FRN	EUR	744.000,00	0,49	2.185.000	LORCA TELECOM BOND CO SA 4.000% 18/09/2027	EUR	2.104.319,40	1,38
1.300.000	DEUTSCHE LUFTHANSA AG 3.000% 29/05/2026 EMTN	EUR	1.250.270,05	0,82	475.000	NH HOTEL GROUP SA 4.000% 02/07/2026	EUR	463.403,05	0,30
700.000	DEUTSCHE LUFTHANSA AG 3.750% 11/02/2028 EMTN	EUR	672.000,00	0,44				<b>7.014.210,55</b>	<b>4,59</b>
1.300.000	HT TROPLAST GMBH 9.250% 15/07/2025	EUR	1.297.070,72	0,85	<b>Jersey</b>				
1.500.000	IHO VERWALTUNGS GMBH 3.625% 15/05/2025	EUR	1.480.548,56	0,96	1.392.000	ADIANT GLOBAL HOLDINGS LTD 3.500% 15/08/2024	EUR	1.367.807,96	0,88
1.500.000	SCHAEFFLER AG 3.375% 12/10/2028 EMTN	EUR	1.469.930,52	0,96	450.000	AVIS BUDGET FINANCE PLC 4.125% 15/11/2024	EUR	451.814,45	0,30
400.000	SGL CARBON SE 4.625% 30/09/2024	EUR	394.640,55	0,26	250.000	AVIS BUDGET FINANCE PLC 4.500% 15/05/2025	EUR	253.202,93	0,17
1.000.000	TUI CRUISES GMBH 6.500% 15/05/2026	EUR	947.076,17	0,62	1.250.000	AVIS BUDGET FINANCE PLC 4.750% 30/01/2026	EUR	1.254.776,20	0,82
1.300.000	ZF FINANCE GMBH 2.750% 25/05/2027 EMTN	EUR	1.209.367,73	0,79	750.000	WHEEL BIDCO LTD 6.750% 15/07/2026	GBP	834.446,20	0,55
500.000	ZF FINANCE GMBH 3.000% 21/09/2025 EMTN	EUR	490.811,89	0,32				<b>4.162.047,74</b>	<b>2,72</b>
			<b>14.936.903,61</b>	<b>9,77</b>	<b>Schweden</b>				
<b>Vereinigte Staaten</b>					1.159.000	HEIMSTADEN BOSTAD AB FRN PERP	EUR	978.694,08	0,64
500.000	AMC ENTERTAINMENT HOLDINGS INC 12.000% 15/06/2026	USD	403.196,35	0,26	500.000	SAMHALLSBYGGNADSBOLAGET I NORDEN AB FRN PERP	EUR	410.375,16	0,27
1.500.000	BOXER PARENT CO INC 6.500% 02/10/2025	EUR	1.514.047,16	0,99	800.000	SAMHALLSBYGGNADSBOLAGET I NORDEN AB FRN PERP	EUR	672.696,21	0,44
1.000.000	CHEMOURS CO/THE 4.000% 15/05/2026	EUR	962.481,96	0,63	1.500.000	VERISURE HOLDING AB 3.250% 15/02/2027	EUR	1.408.615,13	0,92
929.000	COTY INC 3.875% 15/04/2026	EUR	904.137,25	0,59				<b>3.470.380,58</b>	<b>2,27</b>
1.500.000	FORD MOTOR CREDIT CO LLC 1.744% 19/07/2024 EMTN	EUR	1.474.977,80	0,96	<b>Dänemark</b>				
250.000	FORD MOTOR CREDIT CO LLC 2.386% 17/02/2026	EUR	245.124,12	0,16	700.000	DKT FINANCE APS 7.000% 17/06/2023	EUR	702.592,56	0,46
500.000	FORD MOTOR CREDIT CO LLC 2.748% 14/06/2024 EMTN	GBP	573.567,48	0,38	2.000.000	DKT FINANCE APS 9.375% 17/06/2023	USD	1.796.606,35	1,17
500.000	HEXION INC 7.875% 15/07/2027	USD	475.683,44	0,31				<b>2.499.198,91</b>	<b>1,63</b>
2.500.000	NETFLIX INC 3.625% 15/06/2030	EUR	2.644.107,48	1,73	<b>Griechenland</b>				
3.205.000	NOKIA OF AMERICA CORP 6.450% 15/03/2029	USD	3.020.557,97	1,98	1.000.000	PIRAEUS BANK SA 03/11/2027 FRN EMTN	EUR	901.733,03	0,59
1.300.000	RAIN CII CARBON LLC / CII CARBON CORP 7.250% 01/04/2025	USD	1.148.223,54	0,75	1.200.000	PIRAEUS FINANCIAL HOLDINGS SA FRN PERP	EUR	1.098.205,48	0,72
701.000	SCIL IV LLC / SCIL USA HOLDINGS LLC 4.375% 01/11/2026	USD	672.327,37	0,44				<b>1.999.938,51</b>	<b>1,31</b>
200.000	SCIL IV LLC / SCIL USA HOLDINGS LLC 5.375% 01/11/2026	USD	165.311,54	0,11	<b>Mexiko</b>				
			<b>14.203.743,46</b>	<b>9,29</b>	1.120.000	PETROLEOS MEXICANOS 4.875% 21/02/2028 EMTN	EUR	1.066.205,71	0,70
<b>Italien</b>					500.000	PETROLEOS MEXICANOS 5.350% 12/02/2028	USD	427.810,23	0,28
750.000	ATLANTIA SPA 1.625% 03/02/2025 EMTN	EUR	738.301,67	0,48	431.000	PETROLEOS MEXICANOS 6.700% 16/02/2032	USD	368.558,51	0,24
846.000	ATLANTIA SPA 1.875% 12/02/2028	EUR	801.563,47	0,52				<b>1.862.574,45</b>	<b>1,22</b>
350.000	ATLANTIA SPA 1.875% 13/07/2027 EMTN	EUR	333.291,97	0,22	<b>Supranational-Multinational</b>				
901.000	AUTOSTRADA PER L'ITALIA SPA 1.625% 25/01/2028 EMTN	EUR	865.291,66	0,57	1.750.000	ARDAGH PACKAGING FINANCE PLC / ARDAGH HOLDINGS USA INC 2.125% 15/08/2026	EUR	1.645.312,74	1,07
500.000	AUTOSTRADA PER L'ITALIA SPA 1.750% 26/06/2026 EMTN	EUR	490.844,24	0,32				<b>1.645.312,74</b>	<b>1,07</b>
400.000	AUTOSTRADA PER L'ITALIA SPA 1.875% 26/09/2029 EMTN	EUR	377.843,32	0,25	<b>Österreich</b>				
2.250.000	AUTOSTRADA PER L'ITALIA SPA 2.000% 15/01/2030	EUR	2.121.343,61	1,39	600.000	AMS-OSRAM AG ZCP 05/03/2025	EUR	507.448,22	0,33
500.000	BANCA MONTE DEI PASCHI DI SIENA SPA 1.875% 09/01/2026	EUR	453.412,99	0,30	800.000	AMS-OSRAM AG 0.875% 28/09/2022	USD	706.897,28	0,47
1.000.000	BANCA MONTE DEI PASCHI DI SIENA SPA 2.625% 28/04/2025 EMTN	EUR	942.824,58	0,62	300.000	AMS-OSRAM AG 6.000% 31/07/2025	EUR	307.735,07	0,20
500.000	BANCO BPM SPA FRN PERP	EUR	496.632,10	0,32				<b>1.522.080,57</b>	<b>1,00</b>
1.125.000	CASTOR SPA 6.000% 15/02/2029	EUR	1.106.976,47	0,72	<b>Finnland</b>				
1.750.000	PRO-GEST SPA 3.250% 15/12/2024	EUR	1.329.594,26	0,87	100.000	TEOLLISUUUDEN VOIMA OYJ 1.375% 23/06/2028 EMTN	EUR	91.719,00	0,06
495.000	TELECOM ITALIA SPA/MILANO 1.625% 18/01/2029 EMTN	EUR	418.455,82	0,27					
500.000	TELECOM ITALIA SPA/MILANO 2.375% 12/10/2027 EMTN	EUR	455.652,48	0,30					
300.000	TELECOM ITALIA SPA/MILANO 5.250% 17/03/2055 EMTN	EUR	292.062,88	0,19					
			<b>11.224.091,52</b>	<b>7,34</b>					

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) European High Yield

(ausgedrückt in EUR)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
895.000	TEOLLISUUJEN VOIMA OYJ 2.625% 31/03/2027 EMTN	EUR	893.415,78	0,58
			<b>985.134,78</b>	<b>0,64</b>
<b>Portugal</b>				
900.000	TRANSPORTES AEREOS PORTUGUESES SA 5.625% 02/12/2024	EUR	819.839,01	0,54
			<b>819.839,01</b>	<b>0,54</b>
<b>Irland</b>				
670.000	VIRGIN MEDIA VENDOR FINANCING NOTES III DAC 4.875% 15/07/2028	GBP	748.361,37	0,49
			<b>748.361,37</b>	<b>0,49</b>
<b>Panama</b>				
644.000	CARNIVAL CORP 10.125% 01/02/2026	EUR	720.383,53	0,47
			<b>720.383,53</b>	<b>0,47</b>
<b>Jungferninseln</b>				
250.000	HUARONG UNIVERSE INVESTMENT HOLDING LTD 1.625% 05/12/2022	EUR	233.008,65	0,15
			<b>233.008,65</b>	<b>0,15</b>
<b>Südafrika</b>				
9.385.417	K2016470219 SOUTH AFRICA LTD 3.000% 31/12/2022	USD	6.759,12	0,00
15.282.831	K2016470219 SOUTH AFRICA LTD 8.000% 31/12/2022	EUR	35.456,47	0,03
			<b>42.215,59</b>	<b>0,03</b>
<b>Kroatien</b>				
983.000	AGROKOR BOND CONVERTIBLE ZCP 15/07/2031	EUR	0,01	0,00
			<b>0,01</b>	<b>0,00</b>
			<b>143.899.768,33</b>	<b>94,10</b>

### Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente

<b>Aktien</b>				
<b>Südafrika</b>				
109.923.295	HOLDCO 2 ORDINARY A SHARES	USD	0,00	0,00
20.560.053	HOLDCO 2 ORDINARY B SHARES	USD	0,00	0,00
			<b>0,00</b>	<b>0,00</b>
			<b>0,00</b>	<b>0,00</b>
<b>Anleihen und andere Schuldtitel</b>				
<b>Luxemburg</b>				
148.295	HELIX HOLDCO SA 10.000% 19/04/2026	EUR	3.568,59	0,00
			<b>3.568,59</b>	<b>0,00</b>
<b>Südafrika</b>				
7.010.793	K2016470260 SOUTH AFRICA LTD 25.000% 31/12/2022	USD	1.200,15	0,00
			<b>1.200,15</b>	<b>0,00</b>
			<b>4.768,74</b>	<b>0,00</b>

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
<b>Organismen für gemeinsame Anlagen</b>				
<b>Offene Fonds</b>				
<b>Luxemburg</b>				
2.007	NN (L) LIQUID EUR - Z CAP EUR	EUR	1.982.620,41	1,30
			<b>1.982.620,41</b>	<b>1,30</b>
			<b>1.982.620,41</b>	<b>1,30</b>
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>			<b>146.366.826,28</b>	<b>95,71</b>

### Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022

Zu erhalten	Zu zahlen	Fälligkeits- datum	Engagement in EUR	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR		
<b>Devisentermingeschäfte</b>						
5.359.705,81	EUR	4.471.222,02	GBP	20/04/2022	5.359.705,81	71.748,15
8.669.500,91	EUR	9.619.541,23	USD	30/06/2022	8.669.500,91	54.541,48
555.370,83	EUR	613.233,18	USD	20/04/2022	555.370,83	4.480,28
1.208.509,75	USD	1.082.749,13	EUR	19/04/2022	1.082.749,13	2.934,03
1.517.618,09	USD	1.360.620,33	EUR	20/04/2022	1.360.620,33	2.713,37
159.190,38	USD	118.803,18	GBP	20/04/2022	141.754,43	2.502,38
21.275,15	GBP	3.239.916,00	JPY	20/04/2022	25.642,64	1.174,56
34.295,06	USD	4.038.191,00	JPY	18/04/2022	31.120,68	912,98
45.937,62	CHF	37.361,45	GBP	20/04/2022	44.578,87	681,54
350.041,87	CHF	341.292,12	EUR	20/04/2022	341.292,12	596,39
22.865,95	EUR	24.901,75	USD	19/04/2022	22.865,95	495,08
4.372,39	EUR	555.387,00	JPY	20/04/2022	4.372,39	260,57
2.219,57	CHF	2.374,00	USD	20/04/2022	2.136,57	35,22
31.916,88	GBP	42.002,26	USD	20/04/2022	38.113,49	14,79
1.285,56	EUR	1.318,55	CHF	20/04/2022	1.285,56	(2,28)
20.646,00	JPY	165,00	CHF	20/04/2022	159,60	(8,31)
1.521,51	GBP	1.854,06	CHF	20/04/2022	1.833,85	(11,44)
2.415,79	USD	2.262,78	CHF	20/04/2022	2.202,49	(39,88)
19.952,26	USD	18.000,00	EUR	30/06/2022	18.000,00	(131,38)
2.698,01	EUR	46.654,45	ZAR	20/04/2022	2.698,01	(164,36)
4.217.424,00	JPY	35.433,90	USD	18/04/2022	32.029,15	(609,12)
165.391,42	GBP	197.828,34	EUR	20/04/2022	197.828,34	(2.225,71)
6.360.765,18	GBP	7.514.527,73	EUR	30/06/2022	7.514.527,73	(16.242,72)
78.678.992,00	JPY	511.396,34	GBP	20/04/2022	608.195,87	(22.308,28)
598.982.697,00	JPY	4.667.210,16	EUR	20/04/2022	4.667.210,16	(232.623,90)
					<b>30.725.794,91</b>	<b>(131.276,56)</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>						<b>(131.276,56)</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) European High Yield

(ausgedrückt in EUR)

### Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick

		% NIW
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	146.366.826,28	95,71
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	(131.276,56)	(0,09)
<b>Bankguthaben</b>	3.728.352,00	2,44
<b>Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>	2.969.588,90	1,94
<b>Nettovermögen Gesamt</b>	152.933.490,62	100,00

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.



## NN (L) European Participation Equity

(ausgedrückt in EUR)

### Statistische Angaben

<b>Nettovermögen</b>	31.03.2022	EUR	1.628.688,83
	30.09.2021	EUR	1.866.523,00
	30.09.2020	EUR	34.192.768,73
<b>Nettoinventarwert pro Anteil**</b>			
Capitalisation I (EUR)	31.03.2022	EUR	3.276,32
	30.09.2021	EUR	3.460,93
	30.09.2020	EUR	2.236,97
Capitalisation P (EUR)	31.03.2022	EUR	29,66
	30.09.2021	EUR	31,49
	30.09.2020	EUR	20,59
Distribution P (EUR)	31.03.2022	EUR	26,04
	30.09.2021	EUR	27,65
	30.09.2020	EUR	18,08
<b>Anzahl der Anteile</b>			
Capitalisation I (EUR)	31.03.2022		2
	30.09.2021		2
	30.09.2020		14.621
Capitalisation P (EUR)	31.03.2022		52.521
	30.09.2021		56.779
	30.09.2020		69.485
Distribution P (EUR)	31.03.2022		2.517
	30.09.2021		2.642
	30.09.2020		3.112
<b>Laufende Kosten in %*</b>			
Capitalisation I (EUR)	31.03.2022		0,79%
Capitalisation P (EUR)	31.03.2022		1,80%
Distribution P (EUR)	31.03.2022		1,80%
<b>Portfolioumsatz in %*</b>	31.03.2022		36,21%

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

## NN (L) European Participation Equity

(ausgedrückt in EUR)

### Finanzabschlüsse

#### Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022

	Erläuterungen	
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	2	1.558.593,94
Aktien		1.558.593,94
<b>Bankguthaben</b>		25.982,27
<b>Sonstige Vermögenswerte</b>	4	92.826,77
<b>Vermögenswerte Gesamt</b>		1.677.402,98
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>	4	(48.714,15)
<b>Verbindlichkeiten Gesamt</b>		(48.714,15)
<b>Nettovermögen am Ende des Berichtszeitraums</b>		1.628.688,83

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) European Participation Equity

(ausgedrückt in EUR)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW	Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
<b>Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>									
<b>Aktien</b>									
<b>Vereinigtes Königreich</b>									
449	DECHRA PHARMACEUTICALS PLC	GBP	21.550,43	1,32					
15.913	ELEMENTIS PLC	GBP	22.408,40	1,37					
3.451	HEADLAM GROUP PLC	GBP	15.518,16	0,95					
2.465	HOWDEN JOINERY GROUP PLC	GBP	22.396,33	1,38					
9.151	JOHN WOOD GROUP PLC	GBP	17.510,17	1,08					
5.215	KIN & CARTA PLC	GBP	15.736,43	0,97					
15.614	MCBRIDE PLC	GBP	7.871,10	0,48					
6.571	REDROW PLC	GBP	40.651,71	2,50					
2.870	RENEWI PLC	GBP	22.448,90	1,38					
3.490	RICARDO PLC	GBP	16.230,42	1,00					
9.678	TT ELECTRONICS PLC	GBP	23.534,73	1,45					
1.479	UNITE GROUP PLC/THE	GBP	20.266,95	1,24					
1.075	VITEC GROUP PLC/THE	GBP	17.173,31	1,05					
1.832	WEIR GROUP PLC/THE	GBP	35.575,07	2,18					
			<b>298.872,11</b>	<b>18,35</b>					
<b>Niederlande</b>									
654	ACCELL GROUP NV	EUR	37.539,60	2,30					
416	AMG ADVANCED METALLURGICAL GROUP NV	EUR	16.282,24	1,00					
808	ARCADIS NV	EUR	33.047,20	2,03					
457	ASR NEDERLAND NV	EUR	19.299,11	1,18					
100	EURONEXT NV	EUR	8.270,00	0,51					
834	KENDRION NV	EUR	16.296,36	1,00					
462	NEDAP NV	EUR	29.568,00	1,82					
850	NX FILTRATION NV	EUR	9.350,00	0,57					
681	RHI MAGNESITA NV	GBP	19.630,72	1,21					
996	TKH GROUP NV - DUTCH CERT	EUR	50.397,60	3,10					
			<b>239.680,83</b>	<b>14,72</b>					
<b>Frankreich</b>									
231	ALTEN SA	EUR	31.762,50	1,95					
438	ANTIN INFRASTRUCTURE PARTNERS SA	EUR	12.702,00	0,78					
261	GAZTRANSPORT ET TECHNIGAZ SA	EUR	26.491,50	1,63					
936	IPSOS	EUR	42.307,20	2,60					
753	LECTRA	EUR	32.454,30	1,99					
960	QUADIENT SA	EUR	16.358,40	1,00					
1.983	REXEL SA	EUR	38.529,69	2,36					
745	RUBIS SCA	EUR	19.869,15	1,22					
821	VERALLIA SA	EUR	17.684,34	1,09					
			<b>238.159,08</b>	<b>14,62</b>					
<b>Deutschland</b>									
459	DUERR AG	EUR	12.310,38	0,76					
199	MORPHOSYS AG	EUR	4.927,24	0,30					
2.186	PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	EUR	25.335,74	1,56					
2.145	SAF-HOLLAND SE	EUR	16.355,63	1,00					
528	SOFTWARE AG	EUR	16.484,16	1,01					
1.134	TAG IMMOBILIEN AG	EUR	23.303,70	1,43					
985	TAKKT AG	EUR	16.154,00	0,99					
301	VERBIO VEREINIGTE BIOENERGIE AG	EUR	21.100,10	1,30					
			<b>135.970,95</b>	<b>8,35</b>					
<b>Belgien</b>									
267	AEDIFICA SA	EUR	30.438,00	1,87					
779	BARCO NV	EUR	15.580,00	0,96					
478	BEKAERT SA	EUR	16.959,44	1,04					
191	D'IETEREN GROUP	EUR	29.242,10	1,80					
1.470	FAGRON	EUR	24.284,40	1,48					
55	VGP NV	EUR	12.815,00	0,79					
			<b>129.318,94</b>	<b>7,94</b>					
<b>Italien</b>									
7.500	ANIMA HOLDING SPA	EUR	30.615,00	1,88					
10.502	BPER BANCA	EUR	16.692,93	1,02					
1.740	ELEN SPA	EUR	25.160,40	1,54					
654	INTERPUMP GROUP SPA	EUR	29.887,80	1,84					
1.124	MARR SPA	EUR	16.871,24	1,04					
			<b>119.227,37</b>	<b>7,32</b>					
<b>Luxemburg</b>									
459	APERAM SA	EUR	18.456,39	1,13					
526	BEFESA SA	EUR	37.556,40	2,31					
533	STABILUS SA	EUR	23.995,66	1,47					
			<b>80.008,45</b>	<b>4,91</b>					
<b>Österreich</b>									
615	BAWAG GROUP AG	EUR	28.265,40	1,74					
166	LENZING AG	EUR	15.305,20	0,94					
635	PALFINGER AG	EUR	14.382,75	0,88					
712	WIENERBERGER AG	EUR	19.508,80	1,21					
			<b>77.462,15</b>	<b>4,77</b>					
<b>Spanien</b>									
5.209	BANKINTER SA	EUR	27.732,72	1,70					
605	CONSTRUCCIONES Y AUXILIAR DE FERROCARRILES SA	EUR	18.029,00	1,11					
3.838	LINEA DIRECTA ASEGURADORA SA CIA DE SEGUROS Y REASEGUROS	EUR	5.354,01	0,33					
4.517	TALGO SA	EUR	17.616,30	1,08					
			<b>68.732,03</b>	<b>4,22</b>					
<b>Bermuda</b>									
2.255	HISCOX LTD	GBP	26.246,83	1,61					
4.430	LANCASHIRE HOLDINGS LTD	GBP	22.646,40	1,39					
			<b>48.893,23</b>	<b>3,00</b>					
<b>Schweden</b>									
1.111	ALIMAK GROUP AB	SEK	11.314,40	0,69					
2.093	FABEGE AB	SEK	28.157,68	1,73					
			<b>39.472,08</b>	<b>2,42</b>					
<b>Schweiz</b>									
808	SOFTWAREONE HOLDING AG	CHF	10.306,00	0,63					
39	TECAN GROUP AG	CHF	14.016,77	0,86					
			<b>24.322,77</b>	<b>1,49</b>					
<b>Dänemark</b>									
306	SCHOUW & CO AS	DKK	23.942,07	1,47					
			<b>23.942,07</b>	<b>1,47</b>					
<b>Irland</b>									
2.000	GLANBIA PLC	EUR	20.980,00	1,29					
			<b>20.980,00</b>	<b>1,29</b>					

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) European Participation Equity

(ausgedrückt in EUR)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
<b>Norwegen</b>				
756	BORREGAARD ASA	NOK	13.551,88	0,83
			<b>13.551,88</b>	<b>0,83</b>
			<b>1.558.593,94</b>	<b>95,70</b>
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>			<b>1.558.593,94</b>	<b>95,70</b>

### Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick

		% NIW
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	<b>1.558.593,94</b>	<b>95,70</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>
<b>Bankguthaben</b>	<b>25.982,27</b>	<b>1,60</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>	<b>44.112,62</b>	<b>2,70</b>
<b>Nettovermögen Gesamt</b>	<b>1.628.688,83</b>	<b>100,00</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) European Real Estate

(ausgedrückt in EUR)

### Statistische Angaben

<b>Nettovermögen</b>	31.03.2022	EUR	109.051.075,25	<b>Anzahl der Anteile</b>			
	30.09.2021	EUR	166.015.606,94				
	30.09.2020	EUR	149.774.324,26				
<b>Nettoinventarwert pro Anteil**</b>				Capitalisation P (EUR)	31.03.2022		32.464
					30.09.2021		36.508
					30.09.2020		38.141
Capitalisation I (EUR)	31.03.2022	EUR	1.467,09	Capitalisation R (EUR)	31.03.2022		5.487
	30.09.2021	EUR	1.453,48		30.09.2021		5.487
	30.09.2020	EUR	1.224,09		30.09.2020		6.897
Capitalisation N (EUR)	31.03.2022	EUR	1.336,19	Capitalisation X (EUR)	31.03.2022		5.021
	30.09.2021	EUR	1.325,51		30.09.2021		5.629
	30.09.2020	EUR	1.119,23		30.09.2020		6.663
Capitalisation P (EUR)	31.03.2022	EUR	1.253,91	Capitalisation X Hedged (i) (CZK)	31.03.2022		2.715
	30.09.2021	EUR	1.247,93		30.09.2021		2.965
	30.09.2020	EUR	1.060,58		30.09.2020		2.717
Capitalisation R (EUR)	31.03.2022	EUR	273,93	Capitalisation Z (EUR)	31.03.2022		-
	30.09.2021	EUR	271,68		30.09.2021		-
	30.09.2020	EUR	229,35		30.09.2020		1.124
Capitalisation X (EUR)	31.03.2022	EUR	1.126,94	Distribution I (EUR)	31.03.2022		2.100
	30.09.2021	EUR	1.124,37		30.09.2021		2.101
	30.09.2020	EUR	960,34		30.09.2020		7.169
Capitalisation X Hedged (i) (CZK)	31.03.2022	CZK	28.916,95	Distribution P (EUR)	31.03.2022		806
	30.09.2021	CZK	28.461,46		30.09.2021		937
	30.09.2020	CZK	24.255,59		30.09.2020		1.123
Capitalisation Z (EUR)	31.03.2022	EUR	-	Distribution R (EUR)	31.03.2022		3.455
	30.09.2021	EUR	-		30.09.2021		4.518
	30.09.2020	EUR	8.732,80		30.09.2020		7.635
Distribution I (EUR)	31.03.2022	EUR	7.328,74	<b>Dividende</b>			
	30.09.2021	EUR	7.551,89	Distribution I (EUR)	14.12.2021	EUR	302,10
	30.09.2020	EUR	6.608,99	Distribution P (EUR)	14.12.2021	EUR	107,90
Distribution P (EUR)	31.03.2022	EUR	2.605,27	Distribution R (EUR)	14.12.2021	EUR	9,65
	30.09.2021	EUR	2.697,01				
	30.09.2020	EUR	2.382,08	<b>Laufende Kosten in %*</b>			
Distribution R (EUR)	31.03.2022	EUR	233,72	Capitalisation I (EUR)	31.03.2022		0,69%
	30.09.2021	EUR	241,10	Capitalisation N (EUR)	31.03.2022		0,95%
	30.09.2020	EUR	211,50	Capitalisation P (EUR)	31.03.2022		1,60%
<b>Anzahl der Anteile</b>				Capitalisation R (EUR)	31.03.2022		0,90%
Capitalisation I (EUR)	31.03.2022		25.822	Capitalisation X (EUR)	31.03.2022		2,10%
	30.09.2021		60.478	Capitalisation X Hedged (i) (CZK)	31.03.2022		2,12%
	30.09.2020		29.331				
Capitalisation N (EUR)	31.03.2022		1.335				
	30.09.2021		1.445				
	30.09.2020		1.360				

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

## NN (L) European Real Estate

(ausgedrückt in EUR)

### Statistische Angaben (Fortsetzung)

Distribution I (EUR)	31.03.2022	0,69%
Distribution P (EUR)	31.03.2022	1,60%
Distribution R (EUR)	31.03.2022	0,91%
<b>Portfolioumsatz in %*</b>	31.03.2022	47,93%

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

## NN (L) European Real Estate

(ausgedrückt in EUR)

### Finanzabschlüsse

#### Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022

	Erläuterungen	
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	2	<b>107.781.720,41</b>
Aktien		107.781.720,41
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	2	<b>113.322,31</b>
Devisentermingeschäfte		113.322,31
<b>Bankguthaben</b>		<b>1.549.392,74</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte</b>	4	<b>287.224,89</b>
<b>Vermögenswerte Gesamt</b>		<b>109.731.660,35</b>
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>	4	<b>(680.585,10)</b>
<b>Verbindlichkeiten Gesamt</b>		<b>(680.585,10)</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Berichtszeitraums</b>		<b>109.051.075,25</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) European Real Estate

(ausgedrückt in EUR)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
<b>Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>				
<b>Aktien</b>				
<b>Vereinigtes Königreich</b>				
731.200	ASSURA PLC	GBP	578.860,67	0,53
91.767	BIG YELLOW GROUP PLC	GBP	1.667.974,84	1,53
434.386	BRITISH LAND CO PLC/THE	GBP	2.726.409,45	2,50
303.800	CAPITAL & COUNTIES PROPERTIES PLC	GBP	629.485,40	0,58
43.723	DERWENT LONDON PLC	GBP	1.660.318,53	1,52
39.039	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	GBP	328.920,11	0,30
153.326	LAND SECURITIES GROUP PLC	GBP	1.425.374,64	1,31
355.300	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	GBP	1.159.581,33	1,06
364.943	PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC	GBP	640.439,24	0,59
17.080	SAFESTORE HOLDINGS PLC	GBP	270.834,76	0,25
340.569	SEGRO PLC	GBP	5.422.512,49	4,97
146.318	SHAFTESBURY PLC	GBP	1.069.169,26	0,98
1.096.810	TRITAX BIG BOX REIT PLC	GBP	3.138.336,03	2,88
91.819	UNITE GROUP PLC/THE	GBP	1.258.209,22	1,15
			<b>21.976.425,97</b>	<b>20,15</b>
<b>Schweden</b>				
254.982	CASTELLUM AB	SEK	5.736.905,86	5,26
207.773	FABEGE AB	SEK	2.795.225,05	2,56
79.420	FASTIGHETS AB BALDER - B	SEK	4.759.426,16	4,36
121.955	HUFVUDSTADEN AB - A	SEK	1.573.065,70	1,44
110.009	NYFOSA AB	SEK	1.430.117,00	1,31
582.395	SAMHALLSBYGGNADSBOLAGET I NORDEN AB	SEK	2.373.000,41	2,19
94.300	WALLENSTAM AB	SEK	1.244.997,85	1,14
49.600	WIHLBORGS FASTIGHETER AB	SEK	943.761,43	0,87
			<b>20.856.499,46</b>	<b>19,13</b>
<b>Deutschland</b>				
64.639	LEG IMMOBILIEN SE	EUR	6.673.976,75	6,12
171.161	TAG IMMOBILIEN AG	EUR	3.517.358,55	3,23
217.279	VONOVIA SE	EUR	9.193.074,49	8,43
			<b>19.384.409,79</b>	<b>17,78</b>
<b>Frankreich</b>				
40.983	COVIVIO	EUR	2.956.513,62	2,71
26.786	GECINA SA	EUR	3.061.639,80	2,81
33.057	ICADE	EUR	1.928.875,95	1,77
64.364	KLEPIERRE SA	EUR	1.556.321,52	1,42
42.015	MERCIALYS SA	EUR	377.924,93	0,35
			<b>9.881.275,82</b>	<b>9,06</b>
<b>Schweiz</b>				
7.357	ALLREAL HOLDING AG	CHF	1.424.098,40	1,31
32.248	PSP SWISS PROPERTY AG - REG	CHF	3.829.763,47	3,51
43.465	SWISS PRIME SITE AG - REG	CHF	3.873.540,93	3,55
			<b>9.127.402,80</b>	<b>8,37</b>
<b>Belgien</b>				
25.710	AEDIFICA SA	EUR	2.930.940,00	2,69
19.613	COFINIMMO SA	EUR	2.588.916,00	2,37
68.406	WAREHOUSES DE PAUW CVA	EUR	2.674.674,60	2,45
			<b>8.194.530,60</b>	<b>7,51</b>

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
<b>Supranational-Multinational</b>				
6.900	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	EUR	470.442,00	0,43
89.798	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	EUR	6.122.427,64	5,62
			<b>6.592.869,64</b>	<b>6,05</b>
<b>Spanien</b>				
224.242	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA	EUR	1.847.754,08	1,70
206.550	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	EUR	2.186.331,75	2,00
			<b>4.034.085,83</b>	<b>3,70</b>
<b>Luxemburg</b>				
583.690	AROUNDTOWN SA	EUR	3.031.685,86	2,78
14.400	SHURGARD SELF STORAGE SA	EUR	810.720,00	0,74
			<b>3.842.405,86</b>	<b>3,52</b>
<b>Finnland</b>				
118.400	CITYCON OYJ	EUR	812.224,00	0,75
44.207	KOJAMO OYJ	EUR	962.828,46	0,88
			<b>1.775.052,46</b>	<b>1,63</b>
<b>Österreich</b>				
71.540	IMMOFINANZ AG	EUR	1.643.989,20	1,51
			<b>1.643.989,20</b>	<b>1,51</b>
<b>Jersey</b>				
92.900	IWG PLC	GBP	287.804,18	0,26
			<b>287.804,18</b>	<b>0,26</b>
<b>Niederlande</b>				
12.169	CTP NV	EUR	184.968,80	0,17
			<b>184.968,80</b>	<b>0,17</b>
			<b>107.781.720,41</b>	<b>98,84</b>

**Wertpapierbestand Gesamt 107.781.720,41 98,84**

### Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022

Zu erhalten	Zu zahlen	Fälligkeits- datum	Engagement in EUR	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR
<b>Devisentermingeschäfte</b>				
81.327.826,62	CZK	3.205.328,23	EUR 19/04/2022	3.205.328,23
105.669,10	EUR	2.677.244,23	CZK 19/04/2022	105.669,10
				<b>3.310.997,33</b>
				<b>113.322,31</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>				<b>113.322,31</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.



## NN (L) European Real Estate

(ausgedrückt in EUR)

### Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick

		%
		NIW
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	107.781.720,41	98,84
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	113.322,31	0,10
<b>Bankguthaben</b>	1.549.392,74	1,42
<b>Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>	(393.360,21)	(0,36)
<b>Nettovermögen Gesamt</b>	109.051.075,25	100,00

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) European Sustainable Equity

(ausgedrückt in EUR)

### Statistische Angaben

### Anzahl der Anteile

<b>Nettovermögen</b>	31.03.2022	EUR	590.328.577,04	Capitalisation I (EUR)	31.03.2022	17.238		
	30.09.2021	EUR	619.815.167,41		30.09.2021	18.667		
	30.09.2020	EUR	480.573.671,27		30.09.2020	32.306		
<b>Nettoinventarwert pro Anteil**</b>	Capitalisation I (EUR)	31.03.2022	EUR	10.488,08	Capitalisation I Hedged (ii) (EUR)	31.03.2022	4.162	
		30.09.2021	EUR	10.844,54		30.09.2021	4.162	
		30.09.2020	EUR	8.779,78		30.09.2020	4.161	
Capitalisation I Hedged (ii) (EUR)	31.03.2022	EUR	7.394,98	Capitalisation N (EUR)	31.03.2022	6.625		
	30.09.2021	EUR	7.754,66		30.09.2021	7.316		
	30.09.2020	EUR	6.362,60		30.09.2020	4.950		
Capitalisation N (EUR)	31.03.2022	EUR	512,22	Capitalisation P (EUR)	31.03.2022	203.384		
	30.09.2021	EUR	530,00		30.09.2021	180.968		
	30.09.2020	EUR	429,70		30.09.2020	61.649		
Capitalisation P (EUR)	31.03.2022	EUR	484,37	Capitalisation P Hedged (i) (CZK)	31.03.2022	3.050		
	30.09.2021	EUR	503,32		30.09.2021	2.528		
	30.09.2020	EUR	411,57		30.09.2020	475		
Capitalisation P Hedged (i) (CZK)	31.03.2022	CZK	8.921,41	Capitalisation R (EUR)	31.03.2022	2.763		
	30.09.2021	CZK	9.142,76		30.09.2021	6.110		
	30.09.2020	CZK	7.451,36		30.09.2020	27.421		
Capitalisation R (EUR)	31.03.2022	EUR	365,33	Capitalisation X (EUR)	31.03.2022	41.495		
	30.09.2021	EUR	378,18		30.09.2021	39.102		
	30.09.2020	EUR	306,89		30.09.2020	19.678		
Capitalisation X (EUR)	31.03.2022	EUR	519,30	Capitalisation X (USD)	31.03.2022	2.209		
	30.09.2021	EUR	540,96		30.09.2021	1.516		
	30.09.2020	EUR	444,56		30.09.2020	-		
Capitalisation X (USD)	31.03.2022	USD	224,05	Capitalisation Z (EUR)	31.03.2022	15.741		
	30.09.2021	USD	243,10		30.09.2021	15.699		
	30.09.2020	USD	-		30.09.2020	9.310		
Capitalisation Z (EUR)	31.03.2022	EUR	11.607,34	Capitalisation Zz (EUR)	31.03.2022	3.858		
	30.09.2021	EUR	11.958,81		30.09.2021	4.924		
	30.09.2020	EUR	9.612,65		30.09.2020	-		
Capitalisation Zz (EUR)	31.03.2022	EUR	5.745,60	Distribution N (EUR)	31.03.2022	119.926		
	30.09.2021	EUR	5.917,19		30.09.2021	116.805		
	30.09.2020	EUR	-		30.09.2020	131.359		
Distribution N (EUR)	31.03.2022	EUR	261,82	Distribution P (EUR)	31.03.2022	63.892		
	30.09.2021	EUR	272,83		30.09.2021	62.438		
	30.09.2020	EUR	221,63		30.09.2020	28.539		
Distribution P (EUR)	31.03.2022	EUR	257,56	Distribution R (EUR)	31.03.2022	-		
	30.09.2021	EUR	267,64		30.09.2021	-		
	30.09.2020	EUR	218,85		30.09.2020	3.174		
Distribution R (EUR)	31.03.2022	EUR	-	<b>Dividende</b>	Distribution N (EUR)	14.12.2021	EUR	2,00
	30.09.2021	EUR	-					
	30.09.2020	EUR	256,00					

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

## NN (L) European Sustainable Equity

(ausgedrückt in EUR)

### Statistische Angaben (Fortsetzung)

Laufende Kosten in %*		
Capitalisation I (EUR)	31.03.2022	0,81%
Capitalisation I Hedged (ii) (EUR)	31.03.2022	0,83%
Capitalisation N (EUR)	31.03.2022	0,95%
Capitalisation P (EUR)	31.03.2022	1,80%
Capitalisation P Hedged (i) (CZK)	31.03.2022	1,83%
Capitalisation R (EUR)	31.03.2022	1,05%
Capitalisation X (EUR)	31.03.2022	2,30%
Capitalisation X (USD)	31.03.2022	2,30%
Capitalisation Z (EUR)	31.03.2022	0,09%
Capitalisation Zz (EUR)	31.03.2022	0,01%
Distribution N (EUR)	31.03.2022	0,95%
Distribution P (EUR)	31.03.2022	1,80%
Portfolioumsatz in %*		
	31.03.2022	(9,18%)

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwasige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

## NN (L) European Sustainable Equity

(ausgedrückt in EUR)

### Finanzabschlüsse

#### Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022

	Erläuterungen	
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	2	<b>589.410.599,91</b>
Aktien		587.061.603,30
Organismen für gemeinsame Anlagen		2.348.996,61
<b>Bankguthaben</b>		<b>2.130.535,71</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte</b>	4	<b>1.867.819,47</b>
<b>Vermögenswerte Gesamt</b>		<b>593.408.955,09</b>
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>	4	<b>(3.077.200,45)</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	2	<b>(3.177,60)</b>
Devisentermingeschäfte		(3.177,60)
<b>Verbindlichkeiten Gesamt</b>		<b>(3.080.378,05)</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Berichtszeitraums</b>		<b>590.328.577,04</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) European Sustainable Equity

(ausgedrückt in EUR)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
<b>Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>				
<b>Aktien</b>				
<b>Schweiz</b>				
341.544	NESTLE SA - REG	CHF	40.094.677,09	6,79
13.369	PARTNERS GROUP HOLDING AG	CHF	15.060.941,24	2,55
78.523	ROCHE HOLDING AG - GENUSSSCHEIN	CHF	28.102.645,29	4,76
8.853	STRAUMANN HOLDING AG - REG	CHF	12.852.599,36	2,18
13.794	TECAN GROUP AG	CHF	4.957.624,53	0,84
43.958	ZURICH INSURANCE GROUP AG	CHF	19.610.994,23	3,32
			<b>120.679.481,74</b>	<b>20,44</b>
<b>Vereinigtes Königreich</b>				
526.944	COMPASS GROUP PLC	GBP	10.288.691,67	1,74
267.315	DECHRA PHARMACEUTICALS PLC	GBP	12.830.188,00	2,17
801.342	HOMESERVE PLC	GBP	7.993.872,64	1,35
1.345.852	NATIONAL GRID PLC	GBP	18.671.742,89	3,17
944.144	PRUDENTIAL PLC	GBP	12.669.603,88	2,15
665.311	RELX PLC	EUR	18.788.382,64	3,18
1.344.533	RWS HOLDINGS PLC	GBP	5.886.876,63	1,00
207.377	UNILEVER PLC	EUR	8.491.051,27	1,44
988.570	3I GROUP PLC	GBP	16.242.955,53	2,75
			<b>111.863.365,15</b>	<b>18,95</b>
<b>Frankreich</b>				
162.536	AMUNDI SA	EUR	10.109.739,20	1,70
83.607	ESSILORLUXOTTICA SA	EUR	13.903.844,10	2,36
17.696	KERING SA	EUR	10.187.587,20	1,73
60.359	L'OREAL SA	EUR	21.961.622,15	3,72
132.130	SCHNEIDER ELECTRIC SE	EUR	20.104.900,80	3,41
			<b>76.267.693,45</b>	<b>12,92</b>
<b>Deutschland</b>				
53.332	ADIDAS AG	EUR	11.301.050,80	1,91
99.572	ALLIANZ SE - REG	EUR	21.562.316,60	3,65
149.076	SAP SE	EUR	15.074.565,12	2,56
125.010	SCOUT24 AG	EUR	6.500.520,00	1,10
117.815	SIEMENS AG - REG	EUR	14.804.632,90	2,51
			<b>69.243.085,42</b>	<b>11,73</b>
<b>Niederlande</b>				
6.490	ADYEN NV	EUR	11.740.410,00	1,99
50.315	ASML HOLDING NV	EUR	30.692.150,00	5,20
132.952	EURONEXT NV	EUR	10.995.130,40	1,86
			<b>53.427.690,40</b>	<b>9,05</b>
<b>Schweden</b>				
585.230	ASSA ABLOY AB - B	SEK	14.386.325,34	2,44
296.558	ATLAS COPCO AB - A	SEK	14.062.525,20	2,38
1.275.731	SVENSKA HANDELSBANKEN AB - A	SEK	10.691.345,07	1,81
			<b>39.140.195,61</b>	<b>6,63</b>
<b>Dänemark</b>				
272.510	NOVO NORDISK AS - B	DKK	27.436.173,71	4,65
147.232	NOVOZYMES AS - B	DKK	9.164.324,78	1,55
			<b>36.600.498,49</b>	<b>6,20</b>

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
<b>Irland</b>				
53.015	LINDE PLC	EUR	15.400.857,50	2,61
			<b>15.400.857,50</b>	<b>2,61</b>
<b>Spanien</b>				
215.723	CELLNEX TELECOM SA	EUR	9.429.252,33	1,60
344.919	SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY SA	EUR	5.510.081,03	0,93
			<b>14.939.333,36</b>	<b>2,53</b>
<b>Norwegen</b>				
288.080	NORDIC SEMICONDUCTOR ASA	NOK	6.727.484,37	1,14
127.208	TOMRA SYSTEMS ASA	NOK	5.900.801,70	1,00
			<b>12.628.286,07</b>	<b>2,14</b>
<b>Italien</b>				
5.354.189	INTESA SANPAOLO SPA	EUR	11.155.452,78	1,89
			<b>11.155.452,78</b>	<b>1,89</b>
<b>Vereinigte Staaten</b>				
34.451	SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	USD	9.981.547,54	1,69
			<b>9.981.547,54</b>	<b>1,69</b>
<b>Färöer-Inseln</b>				
129.723	BAKKAFROST P/F	NOK	7.906.839,79	1,34
			<b>7.906.839,79</b>	<b>1,34</b>
<b>Finnland</b>				
188.700	NESTE OYJ	EUR	7.827.276,00	1,33
			<b>7.827.276,00</b>	<b>1,33</b>
			<b>587.061.603,30</b>	<b>99,45</b>
<b>Organismen für gemeinsame Anlagen</b>				
<b>Offene Fonds</b>				
<b>Luxemburg</b>				
2.378	NN (L) LIQUID EUR - Z CAP EUR	EUR	2.348.996,61	0,39
			<b>2.348.996,61</b>	<b>0,39</b>
			<b>2.348.996,61</b>	<b>0,39</b>
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>			<b>589.410.599,91</b>	<b>99,84</b>

### Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022

Zu erhalten	Zu zahlen	Fälligkeits- datum	Engagement in EUR	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR		
<b>Devisentermingeschäfte</b>						
4.628.151,27	EUR	3.863.473,03	GBP	20/04/2022	4.628.151,27	58.957,06
30.257.996,35	CZK	1.193.511,49	EUR	19/04/2022	1.193.511,49	42.568,11
2.694.810,63	SEK	252.642,72	EUR	20/04/2022	252.642,72	7.194,76
548.931,96	NOK	56.027,67	EUR	20/04/2022	56.027,67	356,75

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) European Sustainable Equity

(ausgedrückt in EUR)

### Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Zu erhalten	Zu zahlen	Fälligkeits- datum	Engagement in EUR	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR
618,12 EUR	15.094,45 CZK	04/04/2022	618,12	0,14
142,27 EUR	3.484,86 CZK	01/04/2022	142,27	(0,40)
1.894.753,82 EUR	14.095.542,73 DKK	20/04/2022	1.894.753,82	(185,58)
866.281,52 EUR	965.306,80 USD	20/04/2022	866.281,52	(890,07)
375.205,82 USD	338.770,31 EUR	20/04/2022	338.770,31	(1.708,74)
107.222,57 EUR	2.748.538,17 CZK	19/04/2022	107.222,57	(5.058,90)
232.661,98 GBP	280.376,44 EUR	20/04/2022	280.376,44	(5.215,27)
320.163,58 CHF	318.625,89 EUR	20/04/2022	318.625,89	(5.919,73)
1.125.171,90 EUR	11.093.069,97 NOK	20/04/2022	1.125.171,90	(14.270,38)
6.642.020,24 EUR	6.816.947,90 CHF	20/04/2022	6.642.020,24	(16.143,76)
2.254.055,69 EUR	24.029.071,18 SEK	20/04/2022	2.254.055,69	(62.861,59)
			<b>19.958.371,92</b>	<b>(3.177,60)</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>				<b>(3.177,60)</b>

### Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick

		% NIW
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	<b>589.410.599,91</b>	<b>99,84</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	<b>(3.177,60)</b>	<b>0,00</b>
<b>Bankguthaben</b>	<b>2.130.535,71</b>	<b>0,36</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>	<b>(1.209.380,98)</b>	<b>(0,20)</b>
<b>Nettovermögen Gesamt</b>	<b>590.328.577,04</b>	<b>100,00</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) First Class Multi Asset

(ausgedrückt in EUR)

### Statistische Angaben

<b>Nettovermögen</b>	31.03.2022	EUR	682.435.590,45	Capitalisation X Hedged (i) (USD)	31.03.2022	USD	275,72
	30.09.2021	EUR	824.586.642,98		30.09.2021	USD	284,93
	30.09.2020	EUR	848.172.803,31		30.09.2020	USD	269,01
<b>Nettoinventarwert pro Anteil**</b>				Capitalisation Z (EUR)	31.03.2022	EUR	-
	31.03.2022	EUR	6.556,39		30.09.2021	EUR	5.257,20
	30.09.2021	EUR	6.772,31		30.09.2020	EUR	-
Capitalisation I (EUR)	31.03.2022	EUR	6.556,39	Capitalisation Zz (EUR)	31.03.2022	EUR	5.433,86
	30.09.2021	EUR	6.772,31		30.09.2021	EUR	5.594,65
	30.09.2020	EUR	6.382,04		30.09.2020	EUR	5.238,09
Capitalisation I Hedged (i) (CZK)	31.03.2022	CZK	148.256,06	Distribution I (HY) Hedged (i) (JPY)	31.03.2022	JPY	10.216,00
	30.09.2021	CZK	150.666,29		30.09.2021	JPY	10.592,00
	30.09.2020	CZK	141.333,80		30.09.2020	JPY	10.060,00
Capitalisation I Hedged (i) (HUF)	31.03.2022	HUF	568.306,74	Distribution P (EUR)	31.03.2022	EUR	254,51
	30.09.2021	HUF	577.146,48		30.09.2021	EUR	266,85
	30.09.2020	HUF	537.624,39		30.09.2020	EUR	256,14
Capitalisation I Hedged (i) (PLN)	31.03.2022	PLN	-	Distribution P Hedged (USD)	31.03.2022	USD	-
	30.09.2021	PLN	28.067,96		30.09.2021	USD	-
	30.09.2020	PLN	26.307,32		30.09.2020	USD	254,39
Capitalisation I Hedged (i) (USD)	31.03.2022	USD	5.626,13	Distribution R (EUR)	31.03.2022	EUR	259,88
	30.09.2021	USD	5.783,61		30.09.2021	EUR	271,79
	30.09.2020	USD	5.400,50		30.09.2020	EUR	259,57
Capitalisation N (EUR)	31.03.2022	EUR	26,22	Distribution R Hedged (i) (USD)	31.03.2022	USD	261,51
	30.09.2021	EUR	27,09		30.09.2021	USD	272,26
	30.09.2020	EUR	25,55		30.09.2020	USD	257,83
Capitalisation O (EUR)	31.03.2022	EUR	26,43	Distribution X (EUR)	31.03.2022	EUR	248,46
	30.09.2021	EUR	27,28		30.09.2021	EUR	261,19
	30.09.2020	EUR	25,68		30.09.2020	EUR	251,97
Capitalisation P (EUR)	31.03.2022	EUR	283,82	Distribution X (M) Hedged (i) (AUD)	31.03.2022	AUD	192,18
	30.09.2021	EUR	294,03		30.09.2021	AUD	204,57
	30.09.2020	EUR	278,72		30.09.2020	AUD	204,63
Capitalisation P Hedged (i) (CZK)	31.03.2022	CZK	535,68	Distribution X (M) Hedged (i) (USD)	31.03.2022	USD	200,22
	30.09.2021	CZK	545,83		30.09.2021	USD	212,45
	30.09.2020	CZK	514,93		30.09.2020	USD	211,29
Capitalisation P Hedged (i) (USD)	31.03.2022	USD	1.209,50	Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD)	31.03.2022	AUD	179,44
	30.09.2021	USD	1.246,71		30.09.2021	AUD	192,02
	30.09.2020	USD	1.170,93		30.09.2020	AUD	194,12
Capitalisation R (EUR)	31.03.2022	EUR	-	Distribution Y (M) Hedged (i) (USD)	31.03.2022	USD	186,39
	30.09.2021	EUR	-		30.09.2021	USD	198,98
	30.09.2020	EUR	281,24		30.09.2020	USD	200,38
Capitalisation X (EUR)	31.03.2022	EUR	278,28	<b>Anzahl der Anteile</b>	Capitalisation I (EUR)	31.03.2022	54.423
	30.09.2021	EUR	289,01			30.09.2021	63.317
	30.09.2020	EUR	275,34			30.09.2020	71.028
Capitalisation X Hedged (i) (RON)	31.03.2022	RON	1.122,46				
	30.09.2021	RON	1.147,58				
	30.09.2020	RON	1.070,99				

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

## NN (L) First Class Multi Asset

(ausgedrückt in EUR)

### Statistische Angaben (Fortsetzung)

Anzahl der Anteile			Anzahl der Anteile			
Capitalisation I Hedged (i) (CZK)	31.03.2022	2.747	Capitalisation Zz (EUR)	31.03.2022	39.360	
	30.09.2021	2.747		30.09.2021	41.052	
	30.09.2020	2.713		30.09.2020	44.586	
Capitalisation I Hedged (i) (HUF)	31.03.2022	7.838	Distribution I (HY) Hedged (i) (JPY)	31.03.2022	113.748	
	30.09.2021	7.002		30.09.2021	256.623	
	30.09.2020	6.111		30.09.2020	309.380	
Capitalisation I Hedged (i) (PLN)	31.03.2022	-	Distribution P (EUR)	31.03.2022	2.782	
	30.09.2021	4.093		30.09.2021	3.471	
	30.09.2020	4.212		30.09.2020	4.344	
Capitalisation I Hedged (i) (USD)	31.03.2022	0,51	Distribution P Hedged (USD)	31.03.2022	-	
	30.09.2021	0,51		30.09.2021	-	
	30.09.2020	9		30.09.2020	204	
Capitalisation N (EUR)	31.03.2022	13.650	Distribution R (EUR)	31.03.2022	1.692	
	30.09.2021	12.489		30.09.2021	2.292	
	30.09.2020	15.223		30.09.2020	5.097	
Capitalisation O (EUR)	31.03.2022	59.898	Distribution R Hedged (i) (USD)	31.03.2022	49	
	30.09.2021	58.152		30.09.2021	49	
	30.09.2020	59.588		30.09.2020	49	
Capitalisation P (EUR)	31.03.2022	62.795	Distribution X (EUR)	31.03.2022	2.145	
	30.09.2021	67.243		30.09.2021	2.465	
	30.09.2020	103.629		30.09.2020	3.919	
Capitalisation P Hedged (i) (CZK)	31.03.2022	816.751	Distribution X (M) Hedged (i) (AUD)	31.03.2022	27.961	
	30.09.2021	872.914		30.09.2021	29.530	
	30.09.2020	1.070.101		30.09.2020	37.170	
Capitalisation P Hedged (i) (USD)	31.03.2022	270	Distribution X (M) Hedged (i) (USD)	31.03.2022	55.168	
	30.09.2021	270		30.09.2021	57.776	
	30.09.2020	776		30.09.2020	58.782	
Capitalisation R (EUR)	31.03.2022	-	Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD)	31.03.2022	10.736	
	30.09.2021	-		30.09.2021	8.384	
	30.09.2020	300		30.09.2020	13.648	
Capitalisation X (EUR)	31.03.2022	24.337	Distribution Y (M) Hedged (i) (USD)	31.03.2022	68.390	
	30.09.2021	25.934		30.09.2021	43.626	
	30.09.2020	30.541		30.09.2020	30.837	
Capitalisation X Hedged (i) (RON)	31.03.2022	3.028	<b>Dividende</b>	Distribution I (HY) Hedged (i) (JPY)	28.02.2022 JPY	64,00
	30.09.2021	3.249				
	30.09.2020	2.993				
Capitalisation X Hedged (i) (USD)	31.03.2022	3.620	Distribution P (EUR)	14.12.2021 EUR	3,25	
	30.09.2021	2.906				
	30.09.2020	7.924				
Capitalisation Z (EUR)	31.03.2022	-	Distribution R (EUR)	14.12.2021 EUR	3,30	
	30.09.2021	3.376				
	30.09.2020	-				
			Distribution R Hedged (i) (USD)	14.12.2021 USD	3,35	

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.



## NN (L) First Class Multi Asset

(ausgedrückt in EUR)

### Statistische Angaben (Fortsetzung)

				Laufende Kosten in %*		
Distribution X (EUR)	14.12.2021	EUR	3,20	Capitalisation I (EUR)	31.03.2022	0,67%
Distribution X (M) Hedged (i) (AUD)	02.03.2022	AUD	0,92	Capitalisation I Hedged (i) (CZK)	31.03.2022	0,70%
Distribution X (M) Hedged (i) (AUD)	02.02.2022	AUD	0,92	Capitalisation I Hedged (i) (HUF)	31.03.2022	0,70%
Distribution X (M) Hedged (i) (AUD)	04.01.2022	AUD	0,92	Capitalisation I Hedged (i) (USD)	31.03.2022	0,69%
Distribution X (M) Hedged (i) (AUD)	02.12.2021	AUD	0,92	Capitalisation N (EUR)	31.03.2022	0,76%
Distribution X (M) Hedged (i) (AUD)	02.11.2021	AUD	0,92	Capitalisation O (EUR)	31.03.2022	0,56%
Distribution X (M) Hedged (i) (AUD)	04.10.2021	AUD	0,92	Capitalisation P (EUR)	31.03.2022	1,26%
Distribution X (M) Hedged (i) (USD)	02.03.2022	USD	0,93	Capitalisation P Hedged (i) (CZK)	31.03.2022	1,28%
Distribution X (M) Hedged (i) (USD)	02.02.2022	USD	0,93	Capitalisation P Hedged (i) (USD)	31.03.2022	1,28%
Distribution X (M) Hedged (i) (USD)	04.01.2022	USD	0,93	Capitalisation X (EUR)	31.03.2022	1,76%
Distribution X (M) Hedged (i) (USD)	02.12.2021	USD	0,93	Capitalisation X Hedged (i) (RON)	31.03.2022	1,78%
Distribution X (M) Hedged (i) (USD)	02.11.2021	USD	0,93	Capitalisation X Hedged (i) (USD)	31.03.2022	1,78%
Distribution X (M) Hedged (i) (USD)	04.10.2021	USD	0,93	Capitalisation Zz (EUR)	31.03.2022	0,02%
Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD)	02.03.2022	AUD	0,88	Distribution I (HY) Hedged (i) (JPY)	31.03.2022	0,69%
Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD)	02.02.2022	AUD	0,88	Distribution P (EUR)	31.03.2022	1,26%
Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD)	04.01.2022	AUD	0,88	Distribution R (EUR)	31.03.2022	0,76%
Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD)	02.12.2021	AUD	0,88	Distribution R Hedged (i) (USD)	31.03.2022	0,79%
Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD)	02.11.2021	AUD	0,88	Distribution X (EUR)	31.03.2022	1,76%
Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD)	04.10.2021	AUD	0,88	Distribution X (M) Hedged (i) (AUD)	31.03.2022	1,78%
Distribution Y (M) Hedged (i) (USD)	02.03.2022	USD	0,90	Distribution X (M) Hedged (i) (USD)	31.03.2022	1,79%
Distribution Y (M) Hedged (i) (USD)	02.02.2022	USD	0,90	Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD)	31.03.2022	2,79%
Distribution Y (M) Hedged (i) (USD)	04.01.2022	USD	0,90	Distribution Y (M) Hedged (i) (USD)	31.03.2022	2,79%
Distribution Y (M) Hedged (i) (USD)	02.12.2021	USD	0,90			
Distribution Y (M) Hedged (i) (USD)	02.11.2021	USD	0,90	<b>Portfolioumsatz in %*</b>	31.03.2022	134,78%
Distribution Y (M) Hedged (i) (USD)	04.10.2021	USD	0,90			

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

## NN (L) First Class Multi Asset

(ausgedrückt in EUR)

### Finanzabschlüsse

#### Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022

	Erläuterungen	
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	2	<b>627.713.103,06</b>
Aktien		228.218.491,16
Organismen für gemeinsame Anlagen		26.836.466,15
Börsengehandelte Wertpapiere		5.612.293,12
Anleihen und andere Schuldtitel		367.045.852,63
<b>Bankguthaben</b>		<b>28.565.733,38</b>
<b>Hinterlegte Sicherheiten</b>		<b>8.483.583,34</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte</b>	4, 12	<b>30.815.969,43</b>
<b>Vermögenswerte Gesamt</b>		<b>695.578.389,21</b>
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>	4, 12	<b>(8.012.053,24)</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	2	<b>(5.130.745,52)</b>
Credit Default Swaps		(962.247,05)
Devisentermingeschäfte		(3.461.345,15)
Futures		(707.153,32)
<b>Verbindlichkeiten Gesamt</b>		<b>(13.142.798,76)</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Berichtszeitraums</b>		<b>682.435.590,45</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) First Class Multi Asset

(ausgedrückt in EUR)

## Wertpapierbestand zum 31.03.2022

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW	Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
<b>Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>									
<b>Aktien</b>									
<b>Vereinigte Staaten</b>									
2.334	ADOBE INC	USD	955.751,66	0,14	5.515	EDWARDS LIFESCIENCES CORP	USD	583.495,08	0,09
7.971	ADVANCED MICRO DEVICES INC	USD	783.309,34	0,11	4.438	ELECTRONIC ARTS INC	USD	504.607,36	0,07
2.388	AIR PRODUCTS AND CHEMICALS INC	USD	536.363,71	0,08	5.996	ELI LILLY & CO	USD	1.543.229,69	0,23
3.014	ALPHABET INC - C	USD	7.565.786,06	1,11	14.162	EMERSON ELECTRIC CO	USD	1.247.997,21	0,18
1.917	AMAZON.COM INC	USD	5.616.612,73	0,82	600	ENPHASE ENERGY INC	USD	108.810,50	0,02
4.801	AMERICAN EXPRESS CO	USD	806.890,76	0,12	1.509	EPAM SYSTEMS INC	USD	402.268,90	0,06
1.200	AMERICAN TOWER CORP	USD	270.942,34	0,04	6.700	ESSENTIAL UTILITIES INC	USD	307.887,48	0,05
1.997	AMERIPRISE FINANCIAL INC	USD	539.090,39	0,08	625	ESTEE LAUDER COS INC/THE - A	USD	152.968,14	0,02
1.473	AMGEN INC	USD	320.137,38	0,05	13.279	EVERSOURCE ENERGY	USD	1.052.509,78	0,15
73.216	APPLE INC	USD	11.489.907,66	1,67	3.878	EXPEDIA GROUP INC	USD	681.982,89	0,10
5.340	APPLIED MATERIALS INC	USD	632.554,71	0,09	1.200	FEDEX CORP	USD	249.555,57	0,04
2.403	AVALONBAY COMMUNITIES INC	USD	536.406,88	0,08	15.820	FIFTH THIRD BANCORP	USD	611.955,96	0,09
1.200	AVERY DENNISON CORP	USD	187.627,74	0,03	1.400	FMC CORP	USD	165.548,91	0,02
49.883	BANK OF AMERICA CORP	USD	1.848.000,05	0,26	27.054	FORD MOTOR CO	USD	411.165,36	0,06
1.300	BEST BUY CO INC	USD	106.205,90	0,02	2.603	FORTIVE CORP	USD	142.543,29	0,02
900	BILL.COM HOLDINGS INC	USD	183.445,83	0,03	10.513	GILEAD SCIENCES INC	USD	561.720,08	0,08
2.586	BIOGEN INC	USD	489.472,52	0,07	3.164	HCA HEALTHCARE INC	USD	712.678,45	0,10
2.250	BLOCK INC	AUD	281.436,66	0,04	4.943	HERSHEY CO/THE	USD	962.388,97	0,14
1.302	BLOCK INC - A	USD	158.676,31	0,02	5.994	HOME DEPOT INC/THE	USD	1.612.532,26	0,24
210	BOOKING HOLDINGS INC	USD	443.243,16	0,06	1.292	HUMANA INC	USD	505.315,81	0,07
4.827	BROWN & BROWN INC	USD	313.528,32	0,05	1.202	IDEXX LABORATORIES INC	USD	590.990,99	0,09
1.943	BURLINGTON STORES INC	USD	318.120,08	0,05	6.069	INCYTE CORP	USD	433.200,00	0,06
7.664	CARDINAL HEALTH INC	USD	390.553,00	0,06	27.553	INTEL CORP	USD	1.227.274,24	0,18
2.556	CARMAX INC	USD	221.635,63	0,03	1.452	INTUIT INC	USD	627.492,63	0,09
4.782	CATALENT INC	USD	476.631,29	0,07	4.728	INTUITIVE SURGICAL INC	USD	1.281.933,26	0,19
5.461	CBRE GROUP INC - A	USD	449.189,52	0,07	11.236	IRON MOUNTAIN INC	USD	559.553,10	0,08
8.915	CHENIERE ENERGY INC	USD	1.110.919,65	0,16	17.202	JPMORGAN CHASE & CO	USD	2.107.560,01	0,31
5.930	CIGNA CORP	USD	1.277.029,88	0,19	11.010	KEURIG DR PEPPER INC	USD	375.031,68	0,05
993	CINTAS CORP	USD	379.645,23	0,06	8.093	KROGER CO/THE	USD	417.287,93	0,06
20.523	CISCO SYSTEMS INC/DELAWARE	USD	1.028.501,76	0,15	655	LAM RESEARCH CORP	USD	316.482,77	0,05
1.700	CITRIX SYSTEMS INC	USD	154.163,48	0,02	1.963	LULULEMON ATHLETICA INC	USD	644.359,40	0,09
900	CLOUDFLARE INC - A	USD	96.822,90	0,01	3.221	MARRIOTT INTERNATIONAL INC/MD - A	USD	508.777,02	0,07
4.500	COGNEX CORP	USD	312.025,34	0,05	1.900	MARSH & MCLENNAN COS INC	USD	291.015,14	0,04
2.195	COLGATE-PALMOLIVE CO	USD	149.594,98	0,02	3.846	MCDONALD'S CORP	USD	854.751,16	0,13
27.555	COMCAST CORP - A	USD	1.159.506,67	0,17	26.516	MERCK & CO INC	USD	1.955.365,84	0,29
600	COOPER COS INC/THE	USD	225.186,72	0,03	502	METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL INC	USD	619.549,17	0,09
1.793	COPART INC	USD	202.190,90	0,03	33.924	MICROSOFT CORP	USD	9.400.178,35	1,38
2.921	COSTCO WHOLESALE CORP	USD	1.511.758,28	0,22	2.166	MOLINA HEALTHCARE INC	USD	649.400,93	0,10
900	COUPA SOFTWARE INC	USD	82.206,44	0,01	16.374	MONDELEZ INTERNATIONAL INC - A	USD	923.884,17	0,14
600	CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	USD	122.453,60	0,02	5.494	MONSTER BEVERAGE CORP	USD	394.527,12	0,06
2.702	CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	USD	448.289,40	0,07	1.554	MOODY'S CORP	USD	471.248,95	0,07
16.065	CSX CORP	USD	540.721,93	0,08	21.234	MORGAN STANLEY	USD	1.667.956,32	0,24
4.781	CUMMINS INC	USD	881.347,15	0,13	2.826	NASDAQ INC	USD	452.607,02	0,07
1.564	DANAHER CORP	USD	412.320,24	0,06	6.243	NIKE INC - B	USD	755.006,59	0,11
2.064	DEERE & CO	USD	770.691,09	0,11	4.185	NORFOLK SOUTHERN CORP	USD	1.072.795,31	0,16
2.687	DELL TECHNOLOGIES INC - C	USD	121.206,61	0,02	11.942	NVIDA CORP	USD	2.928.588,61	0,43
976	DEXCOM INC	USD	448.767,90	0,07	15.502	ONEOK INC	USD	984.052,72	0,14
4.300	DISH NETWORK CORP - A	USD	122.316,09	0,02	2.329	ORACLE CORP	USD	173.170,51	0,03
1.000	DOCUSIGN INC - A	USD	96.274,66	0,01	2.900	OTIS WORLDWIDE CORP	USD	200.561,72	0,03
534	DOMINO'S PIZZA INC	USD	195.338,46	0,03	2.223	PACKAGING CORP OF AMERICA	USD	311.897,30	0,05
4.892	DOVER CORP	USD	689.843,89	0,10	14.507	PARAMOUNT GLOBAL - B	USD	492.975,93	0,07
8.689	EBAY INC	USD	447.159,61	0,07	6.362	PAYCHEX INC	USD	780.319,18	0,11
2.053	ECOLAB INC	USD	325.778,71	0,05	7.215	PAYPAL HOLDINGS INC	USD	749.934,62	0,11
					7.528	PEPSICO INC	USD	1.132.464,51	0,17
					26.202	PFIZER INC	USD	1.219.141,28	0,18
					7.800	PINTEREST INC - A	USD	172.523,26	0,03
					4.984	PNC FINANCIAL SERVICES GROUP INC/THE	USD	826.224,60	0,12
					900	PPG INDUSTRIES INC	USD	106.019,86	0,02
					14.564	PROCTER & GAMBLE CO/THE	USD	2.000.071,18	0,29
					7.848	PROGRESSIVE CORP/THE	USD	804.020,60	0,12
					4.377	PROLOGIS INC	USD	635.238,36	0,09

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) First Class Multi Asset

(ausgedrückt in EUR)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW	Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
1.505	PTC INC	USD	145.704,94	0,02	600	FAST RETAILING CO LTD	JPY	279.856,27	0,04
7.531	PULTEGROUP INC	USD	283.601,22	0,04	20.300	HITACHI LTD	JPY	926.704,55	0,14
2.770	QORVO INC	USD	308.953,40	0,05	33.040	ITOCHU CORP	JPY	1.013.845,93	0,15
1.413	REGENERON PHARMACEUTICALS INC	USD	886.952,29	0,13	14.100	JFE HOLDINGS INC	JPY	179.893,95	0,03
1.000	RINGCENTRAL INC - A	USD	105.343,10	0,02	17.200	KAJIMA CORP	JPY	189.897,07	0,03
2.521	ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	USD	258.704,70	0,04	8.300	KDDI CORP	JPY	246.146,00	0,04
794	ROCKWELL AUTOMATION INC	USD	199.832,67	0,03	1.200	KOSE CORP	JPY	114.537,14	0,02
900	ROKU INC - A	USD	101.328,36	0,01	9.900	LION CORP	JPY	99.844,58	0,01
535	ROPER TECHNOLOGIES INC	USD	227.064,26	0,03	60.100	MARUBENI CORP	JPY	634.608,92	0,08
3.230	SALESFORCE.COM INC	USD	616.360,58	0,09	2.500	MEIJI HOLDINGS CO LTD	JPY	122.363,99	0,02
1.477	SBA COMMUNICATIONS CORP - A	USD	456.779,49	0,07	15.100	MINEBEA MITSUMI INC	JPY	301.222,02	0,04
1.555	SERVICENOW INC	USD	778.289,62	0,11	51.300	MITSUBISHI CHEMICAL HOLDINGS CORP	JPY	310.387,88	0,05
1.318	SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	USD	295.689,71	0,04	10.500	MITSUBISHI ELECTRIC CORP	JPY	109.627,77	0,02
1.400	SIMON PROPERTY GROUP INC	USD	165.536,33	0,02	54.100	MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP INC	JPY	304.575,13	0,04
1.000	SKYWORKS SOLUTIONS INC	USD	119.786,10	0,02	9.700	MITSUI CHEMICALS INC	JPY	221.943,48	0,03
14.057	SNAP INC - A	USD	454.690,54	0,07	13.400	NEXON CO LTD	JPY	290.924,93	0,04
725	SNAP-ON INC	USD	133.890,26	0,02	2.300	NIPPON EXPRESS HOLDINGS INC	JPY	143.400,98	0,02
1.000	SNOWFLAKE INC - A	USD	205.931,78	0,03	5.000	NIPPON YUSEN KK	JPY	398.377,18	0,06
6.116	S&P GLOBAL INC	USD	2.254.672,07	0,33	18.500	OBAYASHI CORP	JPY	123.289,59	0,02
3.249	STANLEY BLACK & DECKER INC	USD	408.194,59	0,06	7.000	OMRON CORP	JPY	425.760,06	0,06
6.370	STATE STREET CORP	USD	498.768,17	0,07	148	ORIX JREIT INC	JPY	181.153,51	0,03
3.300	SUNRUN INC	USD	90.074,15	0,01	39.100	PANASONIC CORP	JPY	344.102,73	0,05
4.314	TARGET CORP	USD	822.825,76	0,12	2.100	RECRUIT HOLDINGS CO LTD	JPY	84.187,91	0,01
1.700	TELADOC HEALTH INC	USD	110.206,26	0,02	2.500	ROHM CO LTD	JPY	177.529,61	0,03
2.697	TERADYNE INC	USD	286.582,76	0,04	15.800	SEKISUI CHEMICAL CO LTD	JPY	205.795,14	0,03
3.580	TESLA INC	USD	3.467.225,09	0,51	4.400	SHISEIDO CO LTD	JPY	202.588,87	0,03
8.793	TEXAS INSTRUMENTS INC	USD	1.449.997,43	0,21	48.700	SOFTBANK CORP	JPY	514.955,08	0,08
3.229	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	USD	1.714.113,92	0,25	12.400	SOMPO HOLDINGS INC	JPY	494.079,52	0,07
4.241	T-MOBILE US INC	USD	489.221,54	0,07	4.800	SONY GROUP CORP	JPY	452.461,70	0,07
4.300	TRADE DESK INC/THE - A	USD	267.626,84	0,04	2.500	SQUARE ENIX HOLDINGS CO LTD	JPY	100.519,89	0,01
800	TWILIO INC - A	USD	118.499,08	0,02	17.600	SUBARU CORP	JPY	253.871,41	0,04
10.834	TWITTER INC	USD	376.728,94	0,06	11.100	SUMITOMO DAINIPPON PHARMA CO LTD	JPY	99.289,22	0,01
355	TYLER TECHNOLOGIES INC/THE	USD	141.945,76	0,02	6.500	SUMITOMO METAL MINING CO LTD	JPY	296.631,80	0,04
2.602	UNITEDHEALTH GROUP INC	USD	1.192.596,00	0,17	5.400	TAISEI CORP	JPY	141.349,85	0,02
2.341	UNITY SOFTWARE INC	USD	208.736,45	0,03	14.500	TAKEDA PHARMACEUTICAL CO LTD	JPY	375.577,86	0,06
25.927	US BANCORP	USD	1.238.502,72	0,18	1.557	TOKYO ELECTRON LTD	JPY	729.224,62	0,11
11.756	VENTAS INC	USD	652.541,73	0,10	9.600	TOYODA GOSEI CO LTD	JPY	144.020,01	0,02
35.364	VERIZON COMMUNICATIONS INC	USD	1.619.055,55	0,23	4.600	YAMAHA CORP	JPY	182.231,64	0,03
7.427	VISA INC - A	USD	1.480.326,96	0,22	10.200	YAMAHA MOTOR CO LTD	JPY	208.157,26	0,03
5.578	VORNADO REALTY TRUST	USD	227.200,79	0,03	5.800	YAMATO HOLDINGS CO LTD	JPY	98.479,14	0,01
5.300	WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	USD	213.257,54	0,03				<b>13.497.417,35</b>	<b>1,98</b>
10.149	WALT DISNEY CO/THE	USD	1.251.100,38	0,18					
1.839	WASTE MANAGEMENT INC	USD	261.970,52	0,04					
1.100	WATERS CORP	USD	306.861,10	0,04					
11.600	WESTERN UNION CO/THE	USD	195.375,01	0,03					
3.087	WESTINGHOUSE AIR BRAKE TECHNOLOGIES CORP	USD	266.819,57	0,04					
1.741	WHIRLPOOL CORP	USD	270.354,54	0,04					
3.785	YUM! BRANDS INC	USD	403.213,99	0,06					
692	ZEBRA TECHNOLOGIES CORP - A	USD	257.296,01	0,04					
2.955	ZENDESK INC	USD	319.468,79	0,05					
881	ZOETIS INC - A	USD	149.326,19	0,02					
1.700	ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS INC - A	USD	179.113,83	0,03					
2.980	3M CO	USD	398.743,90	0,06					
			<b>133.203.159,51</b>	<b>19,52</b>					
	<b>Japan</b>								
6.500	AISIN CORP	JPY	201.909,85	0,03					
17.300	ASAHI GROUP HOLDINGS LTD	JPY	571.466,14	0,08					
47.245	ASTELLAS PHARMA INC	JPY	668.542,03	0,10					
53.300	CONCORDIA FINANCIAL GROUP LTD	JPY	180.761,05	0,03					
2.600	DENSO CORP	JPY	151.324,09	0,02					
						<b>Vereinigtes Königreich</b>			
					3.650	ASHTREAD GROUP PLC	GBP	208.747,56	0,03
					6.400	ASTRAZENECA PLC	GBP	767.338,34	0,11
					108.641	AVIVA PLC	GBP	581.219,27	0,09
					7.011	COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC	USD	306.300,01	0,04
					18.841	COMPASS GROUP PLC	GBP	367.874,46	0,05
					20.835	DIAGEO PLC	GBP	952.546,46	0,14
					13.339	HALMA PLC	GBP	396.194,77	0,06
					10.200	HARGREAVES LANSDOWN PLC	GBP	121.666,90	0,02
					26.900	INFORMA PLC	GBP	191.565,02	0,03
					5.600	JOHNSON MATTHEY PLC	GBP	124.483,27	0,02
					941.976	LLOYDS BANKING GROUP PLC	GBP	524.514,34	0,08
					4.425	NEXT PLC	GBP	315.853,98	0,05
					17.300	PEARSON PLC	GBP	153.661,97	0,02
					24.000	PRUDENTIAL PLC	GBP	322.059,45	0,05
					26.474	RENTOKIL INITIAL PLC	GBP	164.784,76	0,02
					8.956	ROYALTY PHARMA PLC - A	USD	313.598,85	0,05
					14.781	SEGRO PLC	GBP	235.341,91	0,03
					4.713	SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING PLC	USD	215.392,13	0,03

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) First Class Multi Asset

(ausgedrückt in EUR)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW	Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
9.145	SMITH & NEPHEW PLC	GBP	132.024,73	0,02	63	GIVAUDAN SA - REG	CHF	235.469,47	0,03
1.129	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	GBP	167.467,30	0,02	500	KUEHNE + NAGEL INTERNATIONAL AG - REG	CHF	128.477,31	0,02
164.822	TESCO PLC	GBP	538.314,41	0,08	15.302	NESTLE SA - REG	CHF	1.796.338,83	0,26
8.438	UNILEVER PLC	GBP	344.984,29	0,05	339	PARTNERS GROUP HOLDING AG	CHF	381.902,84	0,06
25.757	UNITED UTILITIES GROUP PLC	GBP	342.741,34	0,05	2.246	ROCHE HOLDING AG - GENUSSSCHEIN	CHF	803.822,34	0,12
27.867	3I GROUP PLC	GBP	457.875,97	0,07	2.635	SIKA AG - REG	CHF	791.079,40	0,12
			<b>8.246.551,49</b>	<b>1,21</b>	3.157	SWISS PRIME SITE AG - REG	CHF	281.347,49	0,04
					928	SWISSCOM AG - REG	CHF	503.009,92	0,07
					4.813	TE CONNECTIVITY LTD	USD	566.581,35	0,08
					32.875	UBS GROUP AG - REG	CHF	582.583,70	0,09
								<b>6.517.680,49</b>	<b>0,96</b>
	<b>Kanada</b>					<b>Frankreich</b>			
9.500	BALLARD POWER SYSTEMS INC	CAD	99.459,94	0,01	12.735	AXA SA	EUR	338.305,28	0,05
6.555	BANK OF MONTREAL	CAD	693.867,41	0,10	16.619	CARREFOUR SA	EUR	326.480,26	0,05
9.581	BANK OF NOVA SCOTIA/THE	CAD	617.704,05	0,09	3.428	CIE GENERALE DES ETABLISSEMENTS MICHELIN SCA	EUR	421.472,60	0,06
14.700	BLACKBERRY LTD	CAD	98.052,50	0,01	13.274	COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	EUR	720.379,98	0,11
11.621	CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	CAD	1.268.918,70	0,19	31.074	CREDIT AGRICOLE SA	EUR	338.271,56	0,04
3.887	CCL INDUSTRIES INC - B	CAD	157.744,87	0,02	4.088	EDENRED	EUR	183.632,96	0,03
15.604	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	CAD	485.942,40	0,07	1.600	EURAZEO SA	EUR	122.240,00	0,02
12.988	HYDRO ONE LTD	CAD	314.757,41	0,05	523	HERMES INTERNATIONAL	EUR	675.454,50	0,10
5.365	IGM FINANCIAL INC	CAD	170.513,48	0,02	247	KERING SA	EUR	142.197,90	0,02
9.276	KEYERA CORP	CAD	211.516,66	0,03	1.790	LEGRAND SA	EUR	154.620,20	0,02
3.100	LIGHTSPEED COMMERCE INC	CAD	85.053,09	0,01	1.787	L'OREAL SA	EUR	650.199,95	0,10
27.218	MANULIFE FINANCIAL CORP	CAD	522.129,16	0,08	283	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	EUR	183.780,20	0,03
14.588	PEMBINA PIPELINE CORP	CAD	493.035,18	0,07	2.323	PERNOD RICARD SA	EUR	462.973,90	0,07
8.000	RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	CAD	145.234,18	0,02	22.392	VEOLIA ENVIRONNEMENT SA	EUR	651.383,28	0,09
507	SHOPIFY INC - A	CAD	308.437,91	0,05	1.600	VINCI SA	EUR	148.784,00	0,02
14.627	SUN LIFE FINANCIAL INC	CAD	734.636,33	0,11	17.355	VIVENDI SE	EUR	205.483,20	0,03
31.352	TELUS CORP	CAD	736.788,82	0,12	1.200	WENDEL SA	EUR	111.120,00	0,02
4.336	THOMSON REUTERS CORP	CAD	423.473,97	0,06				<b>5.836.779,77</b>	<b>0,86</b>
			<b>7.567.265,86</b>	<b>1,11</b>		<b>Taiwan</b>			
	<b>Kaimaninseln</b>				19.340	ACCTON TECHNOLOGY CORP	TWD	134.983,45	0,02
2.205	AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	HKD	4.802,94	0,00	24.265	ADVANTECH CO LTD	TWD	281.247,58	0,04
81.482	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	HKD	1.048.260,72	0,15	7.920	CHINA STEEL CORP	TWD	9.676,69	0,00
1.498	ALIBABA GROUP HOLDING LTD ADR	USD	146.481,28	0,02	37.430	DELTA ELECTRONICS INC	TWD	315.252,23	0,05
19.932	ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	HKD	225.085,75	0,03	17.130	ECLAT TEXTILE CO LTD	TWD	256.581,18	0,04
990	CHAILEASE HOLDING CO LTD	TWD	7.872,40	0,00	3.060	HON HAI PRECISION INDUSTRY CO LTD	TWD	10.174,69	0,00
5.670	CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDINGS LTD	HKD	8.029,72	0,00	4.230	LITE-ON TECHNOLOGY CORP ADR	TWD	9.036,11	0,00
81.940	CHINA MENGNIU DAIRY CO LTD	HKD	396.835,42	0,07	30.050	MEDIATEK INC	TWD	853.074,79	0,13
57.500	CK ASSET HOLDINGS LTD	HKD	354.359,56	0,05	4.050	NAN YA PLASTICS CORP	TWD	11.840,36	0,00
10.350	COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD	HKD	7.162,42	0,00	540	NOVATEK MICROELECTRONICS CORP	TWD	7.224,48	0,00
15.549	ENN ENERGY HOLDINGS LTD	HKD	209.672,92	0,03	164.982	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING CO LTD	TWD	3.089.619,13	0,46
3.510	GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LTD	HKD	4.978,83	0,00	1.170	UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	TWD	9.138,59	0,00
1.885	JD.COM INC - A	HKD	50.620,83	0,01	9.420	WIWYNN CORP	TWD	301.401,30	0,04
3.240	KINGDEE INTERNATIONAL SOFTWARE GROUP CO LTD	HKD	6.477,32	0,00				<b>5.289.250,58</b>	<b>0,78</b>
810	LI NING CO LTD	HKD	6.283,96	0,00		<b>Deutschland</b>			
87.110	LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	HKD	402.879,42	0,07	1.443	ALLIANZ SE - REG	EUR	312.481,65	0,05
23.871	MEITUAN - B	HKD	426.267,50	0,06	2.800	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	EUR	220.080,00	0,03
44.769	NETEASE INC	HKD	738.819,41	0,11	21.818	DEUTSCHE POST AG - REG	EUR	950.173,90	0,14
4.810	SILERGY CORP	TWD	517.527,28	0,08	8.780	EVONIK INDUSTRIES AG	EUR	221.080,40	0,03
16.138	SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	HKD	233.542,98	0,03	2.200	HEIDELBERGCEMENT AG	EUR	113.652,00	0,02
36.500	TENCENT HOLDINGS LTD	HKD	1.567.467,94	0,23	1.800	HENKEL AG & CO KGAA	EUR	107.910,00	0,02
4.320	TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LTD	HKD	6.940,87	0,00	1.384	MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGSGESELLSCHAFT AG IN MUENCHEN - REG	EUR	336.312,00	0,05
8.460	WEIMOB INC	HKD	5.009,82	0,00	2.394	NEMETSCHKE SE	EUR	210.193,20	0,03
77.200	WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	HKD	576.323,89	0,08	4.063	PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE - PREF	EUR	357.137,70	0,05
758	XP INC	BRL	20.572,67	0,00	2.500	SCOUT24 AG	EUR	130.000,00	0,02
2.610	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING LTD	TWD	8.801,22	0,00					
1.080	ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS LTD	HKD	6.866,50	0,00					
			<b>6.987.943,57</b>	<b>1,02</b>					
	<b>Schweiz</b>								
800	GEBERIT AG - REG	CHF	447.067,84	0,07					

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) First Class Multi Asset

(ausgedrückt in EUR)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW	Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
6.947	SIEMENS AG - REG	EUR	872.960,00	0,13	1.703	ASML HOLDING NV	EUR	1.038.830,00	0,15
7.400	SIEMENS ENERGY AG	EUR	153.328,00	0,02	10.910	KONINKLIJKE PHILIPS NV	EUR	302.534,30	0,05
57.151	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	EUR	141.105,82	0,02	5.609	LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV - A	USD	518.327,76	0,08
3.489	VONOVIA SE	EUR	147.619,59	0,02	3.372	PROSUS NV	EUR	163.794,90	0,02
3.176	ZALANDO SE	EUR	146.096,00	0,02	10.778	STELLANTIS NV	EUR	159.492,84	0,02
			<b>4.420.130,28</b>	<b>0,65</b>	1.943	WOLTERS KLUWER NV	EUR	187.654,94	0,03
							<b>2.856.194,76</b>	<b>0,42</b>	
<b>Irland</b>					<b>Brasilien</b>				
4.935	ACCENTURE PLC - A	USD	1.495.735,45	0,22	10.755	BANCO BRADESCO SA - PREF	BRL	45.198,50	0,01
2.235	AON PLC - A	USD	654.098,82	0,10	50.001	BANCO SANTANDER BRASIL SA	BRL	348.770,03	0,06
8.881	CRH PLC	EUR	322.824,35	0,05	2.484	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES SA	BRL	12.008,31	0,00
5.817	JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	USD	342.803,84	0,05	2.646	BRF SA	BRL	9.303,34	0,00
1.600	LINDE PLC	USD	458.481,74	0,07	4.563	B3 SA - BRASIL BOLSA BALCAO	BRL	13.558,02	0,00
9.607	MEDTRONIC PLC	USD	957.980,18	0,13	3.897	CIA ENERGETICA DE MINAS GERAIS - PREF	BRL	11.210,61	0,00
			<b>4.231.924,38</b>	<b>0,62</b>	48.786	CPFL ENERGIA SA	BRL	297.758,21	0,04
<b>Australien</b>					<b>Schweden</b>				
21.637	AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP LTD	AUD	403.049,65	0,06	2.250	EQUATORIAL ENERGIA SA	BRL	11.579,26	0,00
1.564	COCHLEAR LTD	AUD	237.852,75	0,03	9.380	GETNET ADQUIRENCIA E SERVICOS PARA MEIOS DE PAGAMENTO SA	BRL	6.475,38	0,00
20.920	COMPUTERSHARE LTD	AUD	348.747,46	0,05	46.370	HYPERA SA	BRL	339.492,22	0,05
1.600	CSL LTD	AUD	289.567,76	0,04	131.249	ITAU UNIBANCO HOLDING SA - PREF	BRL	682.153,78	0,11
2.070	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES LTD	AUD	122.733,90	0,02	5.547	ITAUSA SA	BRL	11.278,11	0,00
47.366	FORTESCUE METALS GROUP LTD	AUD	660.464,45	0,10	26.242	LOCALIZA RENT A CAR SA	BRL	303.254,81	0,04
10.995	GOODMAN GROUP	AUD	169.860,91	0,02	1.827	LOJAS RENNER SA	BRL	9.502,56	0,00
4.237	MACQUARIE GROUP LTD	AUD	581.278,38	0,09	2.007	NATURA & CO HOLDING SA	BRL	9.888,37	0,00
2.230	REA GROUP LTD	AUD	203.892,11	0,03	1.728	TOTVS SA	BRL	11.889,84	0,00
35.579	SANTOS LTD	AUD	185.860,51	0,03				<b>2.123.321,35</b>	<b>0,31</b>
13.600	TRANSURBAN GROUP	AUD	124.374,29	0,02	<b>Schweden</b>				
8.151	WESFARMERS LTD	AUD	277.319,25	0,04	6.893	ATLAS COPCO AB - A	SEK	326.860,13	0,05
3.600	WISETECH GLOBAL LTD	AUD	124.109,72	0,02	8.441	BOLIDEN AB	SEK	389.193,97	0,06
13.729	WOOLWORTHS GROUP LTD	AUD	345.250,39	0,05	6.900	KINNEVIK AB - B	SEK	164.693,99	0,02
			<b>4.074.361,53</b>	<b>0,60</b>	14.900	SINCH AB	SEK	92.625,39	0,01
<b>Südkorea</b>					<b>Dänemark</b>				
67	AMOREPACIFIC CORP	KRW	7.949,06	0,00	40.308	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB - A	SEK	398.250,82	0,05
133	CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	KRW	6.410,41	0,00	19.157	SVENSKA CELLULOSA AB SCA - B	SEK	338.921,15	0,05
270	HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO LTD	KRW	6.737,05	0,00	12.900	TELEFONAKTIEBOLAGET LM ERICSSON - B	SEK	107.362,83	0,02
8.661	HYUNDAI ENGINEERING & CONSTRUCTION CO LTD	KRW	307.626,99	0,05	34.400	TELIA CO AB	SEK	125.202,73	0,02
100	HYUNDAI MOBIS CO LTD	KRW	15.942,61	0,00				<b>1.943.111,01</b>	<b>0,28</b>
7.491	HYUNDAI STEEL CO	KRW	230.797,82	0,03	<b>Dänemark</b>				
89	KAKAO CORP	KRW	7.028,47	0,00	5.100	AMBU AS - B	DKK	68.562,63	0,01
198	KB FINANCIAL GROUP INC	KRW	9.000,08	0,00	17.216	NOVO NORDISK AS - B	DKK	1.733.298,47	0,25
114	KOREA SHIPBUILDING & OFFSHORE ENGINEERING CO LTD	KRW	7.514,97	0,00				<b>1.801.861,10</b>	<b>0,26</b>
623	LG CHEM LTD	KRW	245.765,30	0,04	<b>Südafrika</b>				
1.489	NAVER CORP	KRW	375.952,26	0,06	32.138	BIDVEST GROUP LTD/THE	ZAR	442.182,67	0,06
83	SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO LTD	KRW	10.155,07	0,00	79	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	ZAR	11.377,51	0,00
17.656	SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	KRW	343.016,09	0,05	13.842	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	ZAR	191.582,64	0,03
25	SAMSUNG SDI CO LTD	KRW	11.048,60	0,00	60	NASPERS LTD	ZAR	6.141,19	0,00
1.481	SAMSUNG SDS CO LTD	KRW	152.098,78	0,02	1.143	REMGRO LTD	ZAR	10.532,54	0,00
234	SAMSUNG SECURITIES CO LTD	KRW	7.270,27	0,00	30.714	STANDARD BANK GROUP LTD	ZAR	344.079,34	0,05
15.199	SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD	KRW	467.717,91	0,07	42.084	VODACOM GROUP LTD	ZAR	414.146,39	0,07
3.522	SK HYNIX INC	KRW	308.171,34	0,05				<b>1.420.042,28</b>	<b>0,21</b>
2.530	SK INNOVATION CO LTD	KRW	403.347,96	0,06	<b>Norwegen</b>				
3.347	SK SQUARE CO LTD	KRW	140.969,43	0,02	4.100	AKER BP ASA	NOK	139.321,44	0,02
			<b>3.064.520,47</b>	<b>0,45</b>	25.943	EQUINOR ASA	NOK	883.164,87	0,13
<b>Niederlande</b>					43.486	NORSK HYDRO ASA	NOK	384.843,25	0,06
178	ADYEN NV	EUR	322.002,00	0,05				<b>1.407.329,56</b>	<b>0,21</b>
2.091	AKZO NOBEL NV	EUR	163.558,02	0,02					

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) First Class Multi Asset

(ausgedrückt in EUR)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW	Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
<b>Italien</b>					4.941	MALAYAN BANKING BHD	MYR	9.441,77	0,00
157.130	ENEL SPA	EUR	953.464,84	0,14	6.927	NESTLE MALAYSIA BHD	MYR	197.812,11	0,03
45.479	SNAM SPA	EUR	237.946,13	0,03	7.416	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDINGS	MYR	9.827,94	0,00
			<b>1.191.410,97</b>	<b>0,17</b>	486.181	PUBLIC BANK BHD	MYR	485.306,48	0,07
								<b>715.615,99</b>	<b>0,10</b>
<b>Spanien</b>					<b>Bermuda</b>				
6.200	EDP RENOVAVEIS SA	EUR	144.708,00	0,02	10.080	ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY LTD	HKD	5.876,60	0,00
7.100	ENAGAS SA	EUR	143.065,00	0,02	544.000	BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE HOLDINGS LTD	HKD	455.746,96	0,07
6.085	INDUSTRIA DE DISEÑO TEXTIL SA	EUR	120.361,30	0,02	1.900	BUNGE LTD	USD	189.223,03	0,03
12.400	RED ELECTRICA CORP SA	EUR	230.764,00	0,03				<b>650.846,59</b>	<b>0,10</b>
38.500	REPSOL SA	EUR	459.074,00	0,07	<b>Finnland</b>				
5.300	SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY SA	EUR	84.667,50	0,01	14.213	NESTE OYJ	EUR	589.555,24	0,09
			<b>1.182.639,80</b>	<b>0,17</b>				<b>589.555,24</b>	<b>0,09</b>
<b>Mexiko</b>					<b>Philippinen</b>				
10.188	AMERICA MOVIL SAB DE CV	MXN	9.674,45	0,00	149.671	INTERNATIONAL CONTAINER TERMINAL SERVICES INC	PHP	584.395,67	0,09
14.868	CEMEX SAB DE CV	MXN	7.122,93	0,00				<b>584.395,67</b>	<b>0,09</b>
63.898	FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB DE CV	MXN	475.567,60	0,07	<b>Curacao</b>				
155.390	WAL-MART DE MEXICO SAB DE CV	MXN	570.829,84	0,09	15.079	SCHLUMBERGER NV	USD	559.846,75	0,08
			<b>1.063.194,82</b>	<b>0,16</b>				<b>559.846,75</b>	<b>0,08</b>
<b>Hongkong</b>					<b>Chile</b>				
8.200	HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LTD	HKD	349.508,52	0,05	4.436.581	BANCO SANTANDER CHILE	CLP	224.521,65	0,03
9.180	LENOVO GROUP LTD	HKD	8.976,03	0,00	35.776	EMPRESAS COPEC SA	CLP	265.590,91	0,04
37.500	SUN HUNG KAI PROPERTIES LTD	HKD	402.818,25	0,06	154	SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHILE SA - B	CLP	11.961,94	0,00
20.000	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	HKD	291.268,58	0,04				<b>502.074,50</b>	<b>0,07</b>
			<b>1.052.571,38</b>	<b>0,15</b>	<b>Österreich</b>				
<b>Singapur</b>					2.846	VERBUND AG	EUR	271.793,00	0,03
38.300	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP LTD	SGD	314.884,08	0,04	6.329	VOESTALPINE AG	EUR	171.009,58	0,02
30.600	UNITED OVERSEAS BANK LTD	SGD	650.689,86	0,10				<b>442.802,58</b>	<b>0,05</b>
			<b>965.573,94</b>	<b>0,14</b>	<b>Neuseeland</b>				
<b>Indonesien</b>					71.397	MERIDIAN ENERGY LTD	NZD	225.393,29	0,03
912.660	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	IDR	455.460,88	0,07	64.558	SPARK NEW ZEALAND LTD	NZD	184.835,42	0,03
1.689.276	TELKOM INDONESIA PERSERO TBK PT	IDR	484.147,25	0,07				<b>410.228,71</b>	<b>0,06</b>
			<b>939.608,13</b>	<b>0,14</b>	<b>Thailand</b>				
<b>China</b>					22.437	HOME PRODUCT CENTER PCL	THB	9.642,99	0,00
540.900	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD - H	HKD	285.546,49	0,04	426.947	MINOR INTERNATIONAL PCL	THB	386.605,96	0,06
2.430	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD - H	HKD	11.238,63	0,00	2.538	SIAM COMMERCIAL BANK PCL	THB	7.820,71	0,00
225	BYD CO LTD - H	HKD	5.794,39	0,00				<b>404.069,66</b>	<b>0,06</b>
15.390	CHINA MOLYBDENUM CO LTD - H	HKD	7.223,77	0,00	<b>Belgien</b>				
1.692	FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD - H	HKD	6.252,57	0,00	4.346	AGEAS SA/NV	EUR	199.220,64	0,03
18.128	GANFENG LITHIUM CO LTD - H	HKD	233.007,52	0,03	400	SOFINA SA	EUR	132.080,00	0,02
5.940	JIANGXI COPPER CO LTD - H	HKD	8.957,44	0,00				<b>331.300,64</b>	<b>0,05</b>
902.830	PEOPLE'S INSURANCE CO GROUP - H	HKD	266.281,58	0,05	<b>Israel</b>				
468	PHARMARON BEIJING CO LTD - H	HKD	5.126,53	0,00	24.600	BANK HAPOLIM BM	ILS	219.967,96	0,04
3.645	PING AN INSURANCE GROUP CO OF CHINA LTD - H	HKD	23.279,02	0,00	1.027	WIX.COM LTD	USD	96.418,84	0,01
			<b>852.707,94</b>	<b>0,12</b>				<b>316.386,80</b>	<b>0,05</b>
<b>Jersey</b>					<b>Tschechische Republik</b>				
3.749	APTIV PLC	USD	403.354,86	0,06	56.799	MONETA MONEY BANK AS	CZK	208.239,78	0,03
1.500	NOVOCURE LTD	USD	111.692,81	0,02				<b>208.239,78</b>	<b>0,03</b>
19.668	WPP PLC	GBP	233.438,71	0,03					
			<b>748.486,38</b>	<b>0,11</b>					
<b>Malaysia</b>									
6.345	HARTALEGA HOLDINGS BHD	MYR	6.577,71	0,00					
10.134	INARI AMERTRON BHD	MYR	6.649,98	0,00					

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.



## NN (L) First Class Multi Asset

(ausgedrückt in EUR)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW	Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
<b>Katar</b>					500.000	COCA-COLA CO/THE 1.125% 09/03/2027	EUR	502.832,13	0,07
1.674	QATAR NATIONAL BANK QPSC	QAR	9.530,91	0,00	200.000	COMCAST CORP 0.750% 20/02/2032	EUR	184.002,90	0,03
			<b>9.530,91</b>	<b>0,00</b>	50.000	COMMERCIAL METALS CO 4.375% 15/03/2032	USD	41.868,59	0,01
<b>Polen</b>					329.000	CONSOLIDATED COMMUNICATIONS INC 5.000% 01/10/2028	USD	254.365,40	0,04
522	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN SA	PLN	8.558,35	0,00	386.000	CONSOLIDATED COMMUNICATIONS INC 6.500% 01/10/2028	USD	320.047,27	0,05
			<b>8.558,35</b>	<b>0,00</b>	1.050.000	CSC HOLDINGS LLC 5.375% 01/02/2028	USD	916.331,69	0,13
			<b>228.218.490,87</b>	<b>33,44</b>	550.000	DARLING INGREDIENTS INC 5.250% 15/04/2027	USD	504.005,94	0,07
					300.000	DIEBOLD NIXDORF INC 8.500% 15/04/2024	USD	260.128,71	0,04
					375.000	DIEBOLD NIXDORF INC 9.375% 15/07/2025	USD	343.754,24	0,05
					125.000	DISH DBS CORP 5.125% 01/06/2029	USD	95.644,09	0,01
					125.000	DISH DBS CORP 7.375% 01/07/2028	USD	106.599,03	0,02
					700.000	ELI LILLY & CO 1.125% 14/09/2051	EUR	569.774,78	0,08
					500.000	EMERSON ELECTRIC CO 2.000% 15/10/2029	EUR	515.811,42	0,08
					500.000	ENDEAVOR ENERGY RESOURCES LP / EER FINANCE INC 5.750% 30/01/2028	EUR	463.664,17	0,07
					600.000	ENLINK MIDSTREAM PARTNERS LP 4.850% 15/07/2026	USD	543.813,94	0,08
					875.000	EQM MIDSTREAM PARTNERS LP 5.500% 15/07/2028	USD	790.246,98	0,12
					444.000	EQUITABLE FINANCIAL LIFE GLOBAL FUNDING 0.600% 16/06/2028 EMTN	EUR	411.892,61	0,06
					263.000	FERTITTA ENTERTAINMENT LLC / FERTITTA ENTERTAINMENT FINANCE CO INC 4.625% 15/01/2029	USD	223.844,89	0,03
					325.000	FORD MOTOR CO 9.625% 22/04/2030	USD	380.852,01	0,06
					750.000	FORD MOTOR CREDIT CO LLC 2.900% 10/02/2029	USD	600.544,80	0,09
					1.100.000	FORD MOTOR CREDIT CO LLC 4.000% 13/11/2030	USD	930.331,65	0,14
					480.000	GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE 1.000% 18/03/2033 EMTN	EUR	425.507,78	0,06
					200.000	GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE 1.375% 15/05/2024 EMTN	EUR	202.052,84	0,03
					400.000	GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE 30/04/2024 FRN EMTN	EUR	397.493,95	0,06
					200.000	HAT HOLDINGS I LLC / HAT HOLDINGS II LLC 3.375% 15/06/2026	USD	170.709,50	0,03
					300.000	HAT HOLDINGS I LLC / HAT HOLDINGS II LLC 3.750% 15/09/2030	USD	245.331,54	0,04
					775.000	HB FULLER CO 4.250% 15/10/2028	USD	653.024,75	0,10
					1.705.000	HCA INC 3.500% 01/09/2030	USD	1.479.277,77	0,22
					550.000	HOLOGIC INC 4.625% 01/02/2028	USD	501.792,05	0,07
					180.000	HUGHES SATELLITE SYSTEMS CORP 5.250% 01/08/2026	USD	165.196,94	0,02
					600.000	HUGHES SATELLITE SYSTEMS CORP 6.625% 01/08/2026	USD	559.494,41	0,08
					600.000	IHEARTCOMMUNICATIONS INC 5.250% 15/08/2027	USD	533.639,76	0,08
					488.000	INGLES MARKETS INC 4.000% 15/06/2031	USD	415.188,65	0,06
					700.000	INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP 1.250% 29/01/2027	EUR	703.665,17	0,10
					500.000	INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCES INC 1.800% 25/09/2026	EUR	501.016,59	0,07
					800.000	IQUIA INC 2.250% 15/01/2028	EUR	759.532,40	0,11
					519.000	JEFFERIES FINANCE LLC / JFIN CO-ISSUER CORP 5.000% 15/08/2028	USD	447.495,33	0,07
					2.100.000	JPMORGAN CHASE & CO 11/03/2027 FRN EMTN	EUR	2.069.443,76	0,30
					300.000	JPMORGAN CHASE & CO 18/05/2028 FRN EMTN	EUR	299.809,10	0,04
					588.000	KB HOME 4.000% 15/06/2031	USD	479.007,58	0,07
					700.000	LADDER CAPITAL FINANCE HOLDINGS LLLP / LADDER CAPITAL FINANCE CORP 5.250% 01/10/2025	USD	625.552,30	0,09
					475.000	LAREDO PETROLEUM INC 7.750% 31/07/2029	USD	429.493,87	0,06
					725.000	LOGMEIN INC 5.500% 01/09/2027	USD	609.774,25	0,09
					456.000	LPL HOLDINGS INC 4.000% 15/03/2029	USD	388.869,55	0,06
					500.000	MATADOR RESOURCES CO 5.875% 15/09/2026	USD	457.867,15	0,07
					562.000	MATTEL INC 3.750% 01/04/2029	USD	485.719,62	0,07
					150.000	MATTEL INC 6.200% 01/10/2040	USD	155.145,39	0,02
					1.400.000	MCDONALD'S CORP 2.375% 27/11/2024 GMTN	EUR	1.476.045,09	0,22
					324.000	MCGRAW-HILL EDUCATION INC 5.750% 01/08/2028	USD	276.827,31	0,04
					289.000	METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING I 0.500% 25/05/2029 EMTN	EUR	268.128,39	0,04

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.



## NN (L) First Class Multi Asset

(ausgedrückt in EUR)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW	Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
200.000	METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING I 0.550% 16/06/2027 EMTN	EUR	189.935,05	0,03	300.000	TENET HEALTHCARE CORP 4.250% 01/06/2029	USD	259.317,12	0,04
800.000	MGM GROWTH PROPERTIES OPERATING PARTNERSHIP LP / MGP FINANCE CO-ISSUER INC 5.750% 01/02/2027	USD	762.648,62	0,11	1.050.000	TENET HEALTHCARE CORP 5.125% 01/11/2027	USD	948.562,99	0,14
200.000	MGM RESORTS INTERNATIONAL 5.500% 15/04/2027	USD	182.260,35	0,03	1.700.000	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC 1.950% 24/07/2029	EUR	1.742.457,28	0,26
485.000	MGM RESORTS INTERNATIONAL 5.750% 15/06/2025	USD	446.079,41	0,07	241.000	T-MOBILE USA INC 2.625% 15/02/2029	USD	197.789,04	0,03
495.000	MILLENNIUM ESCROW CORP 6.625% 01/08/2026	USD	421.392,26	0,06	103.000	T-MOBILE USA INC 2.875% 15/02/2031	USD	83.485,82	0,01
500.000	MMS USA HOLDINGS INC 0.625% 13/06/2025	EUR	491.321,11	0,07	1.300.000	T-MOBILE USA INC 4.750% 01/02/2028	USD	1.187.362,98	0,17
500.000	MOHEGAN GAMING & ENTERTAINMENT 8.000% 01/02/2026	USD	441.794,31	0,06	542.000	TTM TECHNOLOGIES INC 4.000% 01/03/2029	USD	454.053,49	0,07
500.000	MORGAN STANLEY 1.750% 30/01/2025 GMTN	EUR	511.429,41	0,07	600.000	UNITED RENTALS NORTH AMERICA INC 5.250% 15/01/2030	USD	555.986,91	0,08
166.000	MORGAN STANLEY 29/04/2033 FRN	EUR	152.501,93	0,02	10.000.000	UNITED STATES TREASURY NOTE 1.500% 15/02/2030	USD	8.425.830,23	1,22
1.900.000	MORGAN STANLEY 29/10/2027 FRN	EUR	1.800.556,22	0,26	9.000.000	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 0.625% 31/12/2027	USD	7.291.924,16	1,06
120.000	MOZART DEBT MERGER SUB INC 3.875% 01/04/2029	USD	99.756,81	0,01	8.000.000	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 2.250% 15/05/2041	USD	6.784.478,50	0,99
219.000	NESCO HOLDINGS II INC 5.500% 15/04/2029	USD	194.011,28	0,03	12.500.000	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 2.625% 15/02/2029	USD	11.369.604,66	1,66
900.000	NETFLIX INC 3.625% 15/06/2030	EUR	951.878,69	0,14	738.000	UNIVISION COMMUNICATIONS INC 4.500% 01/05/2029	USD	631.365,57	0,09
100.000	NETFLIX INC 3.875% 15/11/2029	EUR	108.494,36	0,02	1.200.000	VERIZON COMMUNICATIONS INC 1.250% 08/04/2030	EUR	1.171.636,48	0,17
350.000	NEW YORK LIFE GLOBAL FUNDING 0.250% 23/01/2027 GMTN	EUR	331.553,21	0,05	500.000	VICI PROPERTIES LP / VICI NOTE CO INC 4.125% 15/08/2030	USD	434.423,11	0,06
800.000	NEXSTAR MEDIA INC 5.625% 15/07/2027	USD	728.042,18	0,11	800.000	VICI PROPERTIES LP / VICI NOTE CO INC 4.250% 01/12/2026	USD	716.708,78	0,11
750.000	NFP CORP 6.875% 15/08/2028	USD	643.645,46	0,09	625.000	VICTORIA'S SECRET & CO 4.625% 15/07/2029	USD	506.087,26	0,07
500.000	NUSTAR LOGISTICS LP 6.000% 01/06/2026	USD	454.735,13	0,07				<b>112.207.598,43</b>	<b>16,44</b>
400.000	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 4.100% 15/02/2047	USD	332.410,54	0,05		<b>Niederlande</b>			
200.000	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 4.300% 15/08/2039	USD	169.659,57	0,02	400.000	AGCO INTERNATIONAL HOLDINGS BV 0.800% 06/10/2028	EUR	360.493,90	0,05
330.000	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 8.500% 15/07/2027	USD	351.052,78	0,05	100.000	AKELIUS RESIDENTIAL PROPERTY FINANCING BV 1.125% 11/01/2029 EMTN	EUR	90.405,51	0,01
330.000	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 8.875% 15/07/2030	USD	381.369,68	0,06	900.000	ALLIANDER NV FRN PERP	EUR	890.844,75	0,13
1.000.000	ONEMAIN FINANCE CORP 7.125% 15/03/2026 GMTN	USD	960.793,34	0,14	900.000	ARGENTUM NETHERLANDS BV FOR GIVAUDAN SA 1.125% 17/09/2025	EUR	900.345,89	0,13
800.000	OWENS-BROCKWAY GLASS CONTAINER INC 6.625% 13/05/2027	USD	718.725,57	0,11	100.000	ARGENTUM NETHERLANDS BV FOR ZURICH INSURANCE CO LTD 19/02/2049 FRN	EUR	100.854,61	0,01
300.000	PEPSICO INC 0.875% 16/10/2039	EUR	253.217,40	0,04	500.000	BRENNTAG FINANCE BV 0.500% 06/10/2029 EMTN	EUR	450.227,47	0,07
900.000	PEPSICO INC 1.125% 18/03/2031	EUR	873.418,69	0,13	500.000	COCA-COLA HBC FINANCE BV 0.625% 21/11/2029	EUR	444.227,60	0,07
647.000	PITNEY BOWES INC 6.875% 15/03/2027	USD	550.616,71	0,08	133.000	CTP NV 0.625% 27/11/2023 EMTN	EUR	131.494,81	0,02
151.000	PITNEY BOWES INC 7.250% 15/03/2029	USD	128.139,16	0,02	376.000	CTP NV 0.750% 18/02/2027 EMTN	EUR	338.517,58	0,05
950.000	PRIME SECURITY SERVICES BORROWER LLC / PRIME FINANCE INC 3.375% 31/08/2027	USD	782.929,32	0,11	193.000	CTP NV 0.875% 20/01/2026 EMTN	EUR	181.866,58	0,03
500.000	PRIMO WATER HOLDINGS INC 3.875% 31/10/2028	EUR	465.573,18	0,07	200.000	CTP NV 1.500% 27/09/2031 EMTN	EUR	168.631,11	0,02
212.000	PRIMO WATER HOLDINGS INC 4.375% 30/04/2029	USD	172.643,97	0,03	292.000	DANFOSS FINANCE I BV 0.375% 28/10/2028 EMTN	EUR	267.010,17	0,04
700.000	RAIN CII CARBON LLC / CII CARBON CORP 7.250% 01/04/2025	USD	618.274,21	0,09	219.000	DANFOSS FINANCE II BV 0.750% 28/04/2031 EMTN	EUR	195.951,79	0,03
470.000	RANGE RESOURCES CORP 8.250% 15/01/2029	USD	462.881,55	0,07	100.000	DE VOLKSBANK NV 22/10/2030 FRN EMTN	EUR	98.545,76	0,01
500.000	ROCKET SOFTWARE INC 6.500% 15/02/2029	USD	407.317,68	0,06	170.000	DIGITAL DUTCH FINCO BV 1.500% 15/03/2030	EUR	156.439,86	0,02
230.000	SENSATA TECHNOLOGIES INC 3.750% 15/02/2031	USD	191.495,47	0,03	358.000	DIGITAL INTREPID HOLDING BV 0.625% 15/07/2031	EUR	297.221,43	0,04
550.000	SENSATA TECHNOLOGIES INC 4.375% 15/02/2030	USD	473.293,79	0,07	600.000	EDP FINANCE BV 1.875% 13/10/2025 EMTN	EUR	615.425,46	0,09
850.000	SERVICE CORP INTERNATIONAL/US 4.000% 15/05/2031	USD	712.760,30	0,10	900.000	ELM BV FOR SWISS REINSURANCE CO LTD FRN PERP	EUR	900.497,85	0,13
1.050.000	SIRIUS XM RADIO INC 5.000% 01/08/2027	USD	944.132,44	0,14	1.000.000	ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV 0.875% 17/06/2036 EMTN	EUR	827.510,16	0,12
1.300.000	SPRINT CAPITAL CORP 6.875% 15/11/2028	USD	1.352.908,93	0,20	300.000	E.ON INTERNATIONAL FINANCE BV 1.500% 31/07/2029 EMTN	EUR	298.217,51	0,04
772.000	STANDARD INDUSTRIES INC/NJ 3.375% 15/01/2031	USD	609.294,61	0,09	400.000	E.ON INTERNATIONAL FINANCE BV 5.750% 14/02/2033 EMTN	EUR	540.942,06	0,08
347.000	STANDARD INDUSTRIES INC/NJ 4.750% 15/01/2028	USD	300.147,62	0,04	343.000	HEIMSTADEN BOSTAD TREASURY BV 0.750% 06/09/2029 EMTN	EUR	292.652,44	0,04
400.000	STAPLES INC 10.750% 15/04/2027	USD	320.009,98	0,05	100.000	HEIMSTADEN BOSTAD TREASURY BV 1.000% 13/04/2028 EMTN	EUR	90.257,67	0,01
600.000	STAPLES INC 7.500% 15/04/2026	USD	523.406,91	0,08	276.000	HEIMSTADEN BOSTAD TREASURY BV 1.625% 13/10/2031 EMTN	EUR	242.806,30	0,04
73.000	STARWOOD PROPERTY TRUST INC 3.625% 15/07/2026	USD	62.632,74	0,01	200.000	HEINEKEN NV 1.750% 07/05/2040 EMTN	EUR	183.578,96	0,03
845.000	STARWOOD PROPERTY TRUST INC 5.500% 01/11/2023	USD	771.159,76	0,11	600.000	IBERDROLA INTERNATIONAL BV FRN PERP	EUR	563.858,50	0,08
232.000	STONEX GROUP INC 8.625% 15/06/2025	USD	217.806,61	0,03	700.000	IBERDROLA INTERNATIONAL BV FRN PERP	EUR	705.543,53	0,10
125.000	TARGA RESOURCES PARTNERS LP / TARGA RESOURCES PARTNERS FINANCE CORP 4.000% 15/01/2032	USD	107.829,48	0,02	1.400.000	ING GROEP NV 26/05/2031 FRN EMTN	EUR	1.397.307,20	0,20
550.000	TARGA RESOURCES PARTNERS LP / TARGA RESOURCES PARTNERS FINANCE CORP 5.500% 01/03/2030	USD	513.613,03	0,08	300.000	ING GROEP NV 29/11/2030 FRN EMTN	EUR	277.779,49	0,04
					667.000	KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV 0.375% 18/03/2030	EUR	604.384,10	0,09

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) First Class Multi Asset

(ausgedrückt in EUR)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW	Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
400.000	KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV 1.750% 02/04/2027	EUR	406.522,23	0,06	300.000	FIRMENICH PRODUCTIONS PARTICIPATIONS SAS 1.375% 30/10/2026	EUR	298.173,29	0,04
165.000	KONINKLIJKE DSM NV 0.625% 23/06/2032 EMTN	EUR	147.955,07	0,02	300.000	FIRMENICH PRODUCTIONS PARTICIPATIONS SAS 1.750% 30/04/2030	EUR	297.227,76	0,04
550.000	LKQ EUROPEAN HOLDINGS BV 4.125% 01/04/2028	EUR	569.605,42	0,08	4.100.000	FRANCE GOVERNMENT BOND OAT ZCP 25/11/2030	EUR	3.811.520,15	0,56
10.410.000	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND ZCP 15/07/2030	EUR	9.872.447,80	1,46	4.400.000	FRANCE GOVERNMENT BOND OAT ZCP 25/11/2031	EUR	4.024.315,37	0,59
14.000.000	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND ZCP 15/07/2031	EUR	13.132.412,02	1,93	3.320.000	FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 0.500% 25/05/2040	EUR	2.918.861,27	0,43
4.000.000	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 4.000% 15/01/2037	EUR	5.746.030,48	0,85	4.400.000	FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 1.250% 25/05/2034	EUR	4.490.102,63	0,66
800.000	NOBIAN FINANCE BV 3.625% 15/07/2026	EUR	728.504,88	0,11	200.000	HSBC CONTINENTAL EUROPE SA 0.100% 03/09/2027 EMTN	EUR	185.837,27	0,03
400.000	SAGAX EURO MTN NL BV 0.750% 26/01/2028 EMTN	EUR	351.301,26	0,05	100.000	ICADE SANTE SACA 1.375% 17/09/2030	EUR	94.509,49	0,01
900.000	SIGMA HOLDCO BV 5.750% 15/05/2026	EUR	734.289,75	0,11	200.000	IMERY SA 1.000% 15/07/2031	EUR	171.739,02	0,03
350.000	SIGNIFY NV 2.375% 11/05/2027	EUR	357.604,68	0,05	400.000	KAPLA HOLDING SAS 3.375% 15/12/2026	EUR	382.364,34	0,06
427.000	STELLANTIS NV 2.750% 01/04/2032 EMTN	EUR	429.970,14	0,06	800.000	LOXAM SAS 4.250% 15/04/2024	EUR	801.582,82	0,12
800.000	TRIVIUM PACKAGING FINANCE BV 3.750% 15/08/2026	EUR	784.248,61	0,11	700.000	ORANGE SA 1.375% 20/03/2028 EMTN	EUR	702.479,79	0,10
127.000	VESTEDA FINANCE BV 0.750% 18/10/2031 EMTN	EUR	113.185,55	0,02	1.000.000	ORANGE SA 1.625% 07/04/2032 EMTN	EUR	1.005.700,69	0,15
100.000	VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV FRN PERP	EUR	100.618,26	0,01	379.000	PAPREC HOLDING SA 3.500% 01/07/2028	EUR	361.115,94	0,05
200.000	VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV FRN PERP	EUR	199.785,64	0,03	600.000	PICARD GROUPE SAS 3.875% 01/07/2026	EUR	582.156,14	0,09
300.000	VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV FRN PERP	EUR	302.302,13	0,04	1.000.000	PSA BANQUE FRANCE SA ZCP 22/01/2025 EMTN	EUR	965.360,26	0,14
400.000	VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV FRN PERP	EUR	402.267,69	0,06	700.000	QUATRIM SASU 5.875% 15/01/2024	EUR	699.391,20	0,10
800.000	VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV FRN PERP	EUR	787.743,42	0,12	500.000	RUBIS TERMINAL INFRA SAS 5.625% 15/05/2025	EUR	512.440,84	0,08
800.000	VONOVIA FINANCE BV 0.750% 15/01/2024	EUR	797.576,22	0,12	200.000	TOTALENERGIES SE FRN PERP	EUR	176.475,95	0,03
400.000	VONOVIA FINANCE BV 1.000% 09/07/2030 EMTN	EUR	364.481,46	0,05	100.000	TOTALENERGIES SE FRN PERP EMTN	EUR	101.762,98	0,01
200.000	VONOVIA FINANCE BV 2.250% 15/12/2023 EMTN	EUR	205.717,98	0,03	800.000	TOTALENERGIES SE FRN PERP EMTN	EUR	687.188,67	0,10
800.000	VZ VENDOR FINANCING II BV 2.875% 15/01/2029	EUR	722.567,13	0,11	700.000	TOTALENERGIES SE FRN PERP EMTN	EUR	696.905,13	0,10
500.000	ZF EUROPE FINANCE BV 2.500% 23/10/2027	EUR	454.419,87	0,07	200.000	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD SE 0.875% 29/03/2032 EMTN	EUR	172.276,76	0,03
700.000	ZF EUROPE FINANCE BV 3.000% 23/10/2029	EUR	625.945,08	0,09	500.000	VALLOUREC SA 8.500% 30/06/2026	EUR	511.706,85	0,07
200.000	ZIGGO BV 2.875% 15/01/2030	EUR	182.634,96	0,03	500.000	WPP FINANCE SA 2.375% 19/05/2027 EMTN	EUR	517.434,19	0,08
			<b>51.133.977,78</b>	<b>7,49</b>				<b>35.193.633,93</b>	<b>5,16</b>
	<b>Frankreich</b>					<b>Australien</b>			
500.000	ALTICE FRANCE SA 2.125% 15/02/2025	EUR	475.562,73	0,07	16.800.000	AUSTRALIA GOVERNMENT BOND 1.500% 21/06/2031	AUD	10.133.971,11	1,48
300.000	BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL SA 0.750% 08/06/2026 EMTN	EUR	293.901,44	0,04	5.200.000	AUSTRALIA GOVERNMENT BOND 2.250% 21/05/2028	AUD	3.420.660,29	0,50
600.000	BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL SA 0.750% 17/07/2025 EMTN	EUR	593.231,17	0,09	21.950.000	AUSTRALIA GOVERNMENT BOND 2.500% 21/05/2030	AUD	14.513.450,39	2,13
200.000	BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL SA 1.125% 19/11/2031 EMTN	EUR	178.518,49	0,03	2.800.000	AUSTRALIA GOVERNMENT BOND 3.250% 21/04/2029	AUD	1.951.185,08	0,29
600.000	BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL SA 2.375% 24/03/2026 EMTN	EUR	614.412,67	0,09	100.000	TOYOTA FINANCE AUSTRALIA LTD 2.280% 21/10/2027 EMTN	EUR	104.803,59	0,02
200.000	BNP PARIBAS SA 11/07/2030 FRN EMTN	EUR	185.188,81	0,03	1.000.000	TRANSURBAN FINANCE CO PTY LTD 1.450% 16/05/2029 EMTN	EUR	966.955,49	0,14
500.000	BNP PARIBAS SA 13/04/2027 FRN EMTN	EUR	472.803,02	0,07	174.000	WESTPAC BANKING CORP 13/05/2031 FRN	EUR	163.615,17	0,02
800.000	BNP PARIBAS SA 15/01/2032 FRN EMTN	EUR	756.820,78	0,11				<b>31.254.641,12</b>	<b>4,58</b>
300.000	BNP PARIBAS SA 19/01/2030 FRN EMTN	EUR	272.259,98	0,04		<b>Kanada</b>			
500.000	BNP PARIBAS SA 19/02/2028 FRN EMTN	EUR	469.663,17	0,07	150.000	BAUSCH HEALTH COS INC 5.750% 15/08/2027	USD	132.989,96	0,02
200.000	BNP PARIBAS SA 20/11/2030 FRN EMTN	EUR	203.192,86	0,03	252.000	BAUSCH HEALTH COS INC 6.125% 15/04/2025	USD	228.256,06	0,03
400.000	BNP PARIBAS SA 23/01/2027 FRN EMTN	EUR	408.273,81	0,06	14.100.000	CANADIAN GOVERNMENT BOND 1.250% 01/06/2030	CAD	9.298.336,84	1,37
100.000	BNP PARIBAS SA 31/03/2032 FRN EMTN	EUR	100.343,08	0,01	6.600.000	CANADIAN GOVERNMENT BOND 1.500% 01/06/2031	CAD	4.401.873,69	0,65
200.000	BPCE SA 0.250% 14/01/2031	EUR	176.471,87	0,03	13.900.000	CANADIAN GOVERNMENT BOND 2.000% 01/06/2028	CAD	9.791.560,99	1,43
400.000	BPCE SA 0.625% 15/01/2030	EUR	369.948,84	0,05	980.000	FAIRFAX FINANCIAL HOLDINGS LTD 2.750% 29/03/2028	EUR	985.599,13	0,14
1.300.000	CARREFOUR SA 2.625% 15/12/2027 EMTN	EUR	1.347.212,84	0,20	200.000	GREAT-WEST LIFECO INC 1.750% 07/12/2026	EUR	201.776,87	0,03
300.000	CASINO GUICHARD PERRACHON SA 1.865% 13/06/2022 EMTN	EUR	299.648,00	0,04				<b>25.040.393,54</b>	<b>3,67</b>
200.000	CREDIT AGRICOLE SA 05/06/2030 FRN EMTN	EUR	198.328,92	0,03		<b>Vereinigtes Königreich</b>			
300.000	CREDIT AGRICOLE SA 2.000% 25/03/2029 EMTN	EUR	295.841,99	0,04	300.000	AVIVA PLC 04/12/2045 FRN EMTN	EUR	312.397,25	0,05
200.000	CREDIT AGRICOLE SA 22/04/2026 FRN EMTN	EUR	198.004,46	0,03	190.000	BARCLAYS PLC 09/06/2025 FRN EMTN	EUR	188.019,49	0,03
500.000	CREDIT AGRICOLE SA/LONDON 1.375% 13/03/2025 EMTN	EUR	504.036,07	0,07	428.000	EC FINANCE PLC 3.000% 15/10/2026	EUR	420.448,05	0,06
100.000	CREDIT MUTUEL ARKEA SA 0.875% 07/05/2027 EMTN	EUR	97.048,39	0,01	138.000	INEOS QUATTRO FINANCE 1 PLC 3.750% 15/07/2026	EUR	129.720,00	0,02
400.000	ELO SACA 2.875% 29/01/2026 EMTN	EUR	401.399,93	0,06					
600.000	EUTELSAT SA 1.500% 13/10/2028	EUR	577.607,34	0,08					
600.000	FAURECIA SE 2.375% 15/06/2027	EUR	535.284,47	0,08					

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) First Class Multi Asset

(ausgedrückt in EUR)

## Wertpapierbestand zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW	Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
268.000	INEOS QUATTRO FINANCE 2 PLC 2.500% 15/01/2026	EUR	253.260,00	0,04	300.000	LOGICOR FINANCING SARL 1.625% 15/07/2027 EMTN	EUR	288.497,83	0,04
929.000	INTERNATIONAL GAME TECHNOLOGY PLC 3.500% 15/06/2026	EUR	935.471,02	0,14	100.000	LOGICOR FINANCING SARL 3.250% 13/11/2028 EMTN	EUR	103.160,13	0,02
165.000	LLOYDS BANK CORPORATE MARKETS PLC 2.375% 09/04/2026 EMTN	EUR	171.572,04	0,03	1.250.000	MEDTRONIC GLOBAL HOLDINGS SCA 0.250% 02/07/2025	EUR	1.222.409,58	0,18
300.000	NATWEST GROUP PLC 04/03/2025 FRN EMTN	EUR	304.913,36	0,04	1.000.000	MEDTRONIC GLOBAL HOLDINGS SCA 1.375% 15/10/2040	EUR	888.684,12	0,13
491.000	NATWEST GROUP PLC 26/02/2030 FRN EMTN	EUR	452.702,50	0,07	337.000	NESTLE FINANCE INTERNATIONAL LTD 1.500% 29/03/2035 EMTN	EUR	339.224,45	0,05
450.000	SANTANDER UK GROUP HOLDINGS PLC 13/09/2029 FRN EMTN	EUR	409.284,53	0,06	190.000	P3 GROUP SARL 1.625% 26/01/2029 EMTN	EUR	173.918,37	0,03
100.000	STANDARD CHARTERED PLC 09/09/2030 FRN	EUR	99.825,82	0,01	115.000	SEGRO CAPITAL SARL 0.500% 22/09/2031	EUR	100.818,52	0,01
1.000.000	TESCO CORPORATE TREASURY SERVICES PLC 0.375% 27/07/2029 EMTN	EUR	879.980,01	0,13	650.000	SUMMER BC HOLDCO B SARL 5.750% 31/10/2026	EUR	659.388,29	0,10
4.000.000	UNITED KINGDOM GILT 0.250% 31/07/2031	GBP	4.180.583,80	0,61	100.000	TRATON FINANCE LUXEMBOURG SA 1.250% 24/03/2033 EMTN	EUR	87.337,31	0,01
2.640.000	UNITED KINGDOM GILT 0.625% 31/07/2035	GBP	2.689.493,65	0,39				<b>9.681.028,08</b>	<b>1,42</b>
3.700.000	UNITED KINGDOM GILT 4.250% 07/06/2032	GBP	5.454.257,95	0,80					
4.740.000	UNITED KINGDOM GILT 4.500% 07/09/2034	GBP	7.330.265,02	1,07					
			<b>24.212.194,49</b>	<b>3,55</b>					
	<b>Österreich</b>					<b>Deutschland</b>			
7.600.000	AUSTRIA GOVERNMENT BOND ZCP 20/02/2030	EUR	7.130.672,11	1,04	400.000	COMMERZBANK AG 0.500% 04/12/2026 EMTN	EUR	385.031,37	0,06
12.700.000	AUSTRIA GOVERNMENT BOND ZCP 20/02/2031	EUR	11.744.079,13	1,73	169.000	COVESTRO AG 0.875% 03/02/2026 EMTN	EUR	166.771,08	0,02
100.000	ERSTE GROUP BANK AG 08/09/2031 FRN EMTN	EUR	95.802,33	0,01	169.000	COVESTRO AG 1.375% 12/06/2030 EMTN	EUR	162.713,02	0,02
500.000	ERSTE GROUP BANK AG 10/06/2030 FRN EMTN	EUR	476.226,71	0,07	500.000	DEUTSCHE TELEKOM AG 2.250% 29/03/2039 EMTN	EUR	523.707,96	0,08
100.000	ERSTE GROUP BANK AG 15/11/2032 FRN EMTN	EUR	90.275,65	0,01	500.000	HANNOVER RUECK SE 08/10/2040 FRN	EUR	463.179,72	0,07
800.000	ERSTE GROUP BANK AG 16/11/2028 FRN EMTN	EUR	730.790,08	0,11	200.000	IHO VERWALTUNGS GMBH 3.625% 15/05/2025	EUR	197.406,47	0,03
200.000	RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG 0.250% 22/01/2025 EMTN	EUR	194.685,26	0,03	300.000	MERCK FINANCIAL SERVICES GMBH 0.500% 16/07/2028 EMTN	EUR	286.425,29	0,04
			<b>20.462.531,27</b>	<b>3,00</b>	300.000	MERCK FINANCIAL SERVICES GMBH 0.875% 05/07/2031 EMTN	EUR	283.715,62	0,04
	<b>Finnland</b>				500.000	MERCK KGAA 09/09/2080 FRN	EUR	487.607,93	0,07
300.000	BALDER FINLAND OYJ 1.000% 20/01/2029 EMTN	EUR	264.131,77	0,04	600.000	MERCK KGAA 12/12/2074 FRN	EUR	629.426,33	0,09
100.000	BALDER FINLAND OYJ 2.000% 18/01/2031	EUR	90.846,79	0,01	800.000	MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS-GESELLSCHAFT AG IN MUENCHEN 26/05/2049 FRN	EUR	827.966,27	0,13
8.300.000	FINLAND GOVERNMENT BOND 0.125% 15/09/2031	EUR	7.726.069,86	1,13	700.000	O2 TELEFONICA DEUTSCHLAND FINANZIERUNGS GMBH 1.750% 05/07/2025	EUR	711.409,45	0,10
3.800.000	FINLAND GOVERNMENT BOND 0.500% 15/09/2029	EUR	3.735.767,73	0,55	700.000	SYMRISE AG 1.250% 29/11/2025	EUR	691.717,61	0,11
5.280.000	FINLAND GOVERNMENT BOND 1.125% 15/04/2034	EUR	5.357.844,94	0,79	158.000	SYMRISE AG 1.375% 01/07/2027	EUR	153.915,04	0,02
825.000	OP CORPORATE BANK PLC 09/06/2030 FRN	EUR	810.169,08	0,12	250.000	TUI CRUISES GMBH 6.500% 15/05/2026	EUR	236.769,04	0,03
467.000	SATO OYJ 1.375% 24/02/2028	EUR	433.832,50	0,06	200.000	VOLKSWAGEN BANK GMBH 1.250% 15/12/2025 EMTN	EUR	196.834,28	0,03
150.000	STORA ENSO OYJ 0.625% 02/12/2030 EMTN	EUR	132.286,69	0,02	300.000	VOLKSWAGEN BANK GMBH 1.875% 31/01/2024 EMTN	EUR	305.428,40	0,04
100.000	UPM-KYMMENE OYJ 0.125% 19/11/2028 EMTN	EUR	89.904,51	0,01	250.000	VOLKSWAGEN FINANCIAL SERVICES AG 3.375% 06/04/2028 EMTN	EUR	267.353,53	0,04
			<b>18.640.853,87</b>	<b>2,73</b>	150.000	VOLKSWAGEN LEASING GMBH 0.625% 19/07/2029 EMTN	EUR	134.374,36	0,02
	<b>Luxemburg</b>				200.000	VONOVIA SE 0.250% 01/09/2028 EMTN	EUR	179.230,17	0,03
200.000	ADLER GROUP SA 1.875% 14/01/2026	EUR	165.852,02	0,02	400.000	VONOVIA SE 0.625% 14/12/2029 EMTN	EUR	357.627,43	0,05
400.000	ADLER GROUP SA 2.250% 14/01/2029	EUR	325.271,64	0,05	300.000	VONOVIA SE 0.750% 01/09/2032 EMTN	EUR	258.005,49	0,04
300.000	ADLER GROUP SA 2.250% 27/04/2027	EUR	246.435,88	0,04				<b>7.906.615,86</b>	<b>1,16</b>
700.000	ALTICE FRANCE HOLDING SA 8.000% 15/05/2027	EUR	723.231,63	0,11		<b>Irland</b>			
100.000	AROUNDTOWN SA 1.625% 31/01/2028 EMTN	EUR	95.647,76	0,01	700.000	AIB GROUP PLC 1.250% 28/05/2024 EMTN	EUR	702.190,85	0,10
100.000	CBRE GLOBAL INVESTORS OPEN-ENDED FUND SCA SICAV-SIF PAN EUROPEAN CORE FUND 0.900% 12/10/2029	EUR	90.260,05	0,01	158.000	AIB GROUP PLC 17/11/2027 FRN EMTN	EUR	147.561,98	0,02
700.000	CNH INDUSTRIAL FINANCE EUROPE SA 1.750% 25/03/2027 EMTN	EUR	699.672,58	0,10	152.000	BANK OF IRELAND GROUP PLC 10/05/2027 FRN EMTN	EUR	141.441,08	0,02
1.000.000	DH EUROPE FINANCE II SARL 0.750% 18/09/2031	EUR	916.687,12	0,13	447.000	CCEP FINANCE IRELAND DAC 0.875% 06/05/2033	EUR	397.558,22	0,06
200.000	DH EUROPE FINANCE II SARL 1.800% 18/09/2049	EUR	186.512,93	0,03	2.600.000	IRELAND GOVERNMENT BOND ZCP 18/10/2031	EUR	2.365.231,73	0,35
200.000	GRAND CITY PROPERTIES SA FRN PERP EMTN	EUR	177.401,98	0,03	3.200.000	IRELAND GOVERNMENT BOND 0.400% 15/05/2035	EUR	2.908.040,19	0,42
100.000	GRAND CITY PROPERTIES SA 0.125% 11/01/2028 EMTN	EUR	87.532,05	0,01	200.000	PARTNERRE IRELAND FINANCE DAC 1.250% 15/09/2026	EUR	197.189,15	0,03
315.000	HOLCIM FINANCE LUXEMBOURG SA 0.500% 23/04/2031	EUR	272.424,69	0,04	100.000	SMURFIT KAPPA ACQUISITIONS ULC 2.875% 15/01/2026	EUR	104.478,22	0,02
121.000	JOHN DEERE CASH MANAGEMENT SARL 2.200% 02/04/2032 EMTN	EUR	128.354,29	0,02	100.000	SMURFIT KAPPA TREASURY ULC 0.500% 22/09/2029	EUR	89.875,76	0,01
600.000	KLEOPATRA FINCO SARL 4.250% 01/03/2026	EUR	535.342,06	0,08				<b>7.053.567,18</b>	<b>1,03</b>
1.000.000	LINCOLN FINANCING SARL 3.625% 01/04/2024	EUR	998.848,41	0,15		<b>Spanien</b>			
199.000	LOGICOR FINANCING SARL 0.875% 14/01/2031 EMTN	EUR	168.114,39	0,02	300.000	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA 16/01/2030 FRN GMTN	EUR	291.320,51	0,04
					100.000	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA 24/03/2027 FRN GMTN	EUR	94.995,59	0,01

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) First Class Multi Asset

(ausgedrückt in EUR)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl/ Nominal	Bezeich- nung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW	Stückzahl/ Nominal	Bezeich- nung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
100.000	BANCO SANTANDER SA 0.200% 11/02/2028 EMTN	EUR	92.260,18	0,01					
100.000	CAIXABANK SA 09/02/2029 FRN EMTN	EUR	91.350,61	0,01					
200.000	CAIXABANK SA 10/07/2026 FRN EMTN	EUR	195.144,15	0,03					
700.000	CAIXABANK SA 1.125% 27/03/2026 EMTN	EUR	691.204,09	0,10					
400.000	CAIXABANK SA 14/07/2028 FRN EMTN	EUR	406.372,17	0,06					
500.000	CAIXABANK SA 18/06/2031 FRN EMTN	EUR	471.820,04	0,07					
345.000	LORCA TELECOM BOND CO SA 4.000% 18/09/2027	EUR	332.260,96	0,05					
800.000	SANTANDER CONSUMER FINANCE SA 0.500% 14/11/2026 EMTN	EUR	768.320,44	0,12					
3.600.000	SPAIN GOVERNMENT BOND 1.000% 31/10/2050	EUR	2.861.550,07	0,43					
700.000	TELEFONICA EMISIONES SA 1.460% 13/04/2026 EMTN	EUR	711.021,26	0,10					
			<b>7.007.620,07</b>	<b>1,03</b>					
	<b>Italien</b>								
600.000	AUTOSTRADA PER L'ITALIA SPA 1.750% 26/06/2026 EMTN	EUR	589.013,09	0,09					
300.000	ENEL SPA 24/05/2080 FRN	EUR	307.225,37	0,05					
192.000	FCA BANK SPA/IRELAND 0.125% 16/11/2023 EMTN	EUR	190.508,12	0,03					
240.000	FCA BANK SPA/IRELAND 0.250% 28/02/2023 EMTN	EUR	240.450,49	0,04					
155.000	FCA BANK SPA/IRELAND 0.500% 18/09/2023 EMTN	EUR	155.041,61	0,02					
300.000	INTESA SANPAOLO SPA 0.750% 16/03/2028 EMTN	EUR	280.091,46	0,04					
700.000	INTESA SANPAOLO SPA 1.375% 18/01/2024 EMTN	EUR	710.583,28	0,10					
300.000	INTESA SANPAOLO SPA 1.750% 20/03/2028 EMTN	EUR	296.886,94	0,04					
700.000	ITALGAS SPA 0.875% 24/04/2030 EMTN	EUR	643.993,64	0,10					
100.000	MEDIOBANCA BANCA DI CREDITO FINANZIARIO SPA 1.000% 08/09/2027 EMTN	EUR	95.322,53	0,01					
400.000	PRO-GEST SPA 3.250% 15/12/2024	EUR	303.907,26	0,04					
223.000	UNICREDIT SPA 05/07/2029 FRN EMTN	EUR	203.010,31	0,03					
250.000	UNICREDIT SPA 0.850% 19/01/2031 EMTN	EUR	216.809,49	0,03					
214.000	UNICREDIT SPA 16/06/2026 FRN EMTN	EUR	210.162,30	0,03					
200.000	UNICREDIT SPA 25/06/2025 FRN EMTN	EUR	199.767,56	0,03					
			<b>4.642.773,45</b>	<b>0,68</b>					
	<b>Belgien</b>								
400.000	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV 2.750% 17/03/2036 EMTN	EUR	430.817,08	0,06					
344.000	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV 2.875% 02/04/2032 EMTN	EUR	380.262,80	0,06					
200.000	BELFIUS BANK SA 0.010% 15/10/2025 EMTN	EUR	192.585,42	0,03					
1.500.000	BELGIUM GOVERNMENT BOND 1.400% 22/06/2053	EUR	1.449.132,24	0,21					
100.000	KBC GROUP NV 01/03/2027 FRN EMTN	EUR	95.385,79	0,01					
500.000	KBC GROUP NV 07/12/2031 FRN EMTN	EUR	461.575,50	0,07					
			<b>3.009.758,83</b>	<b>0,44</b>					
	<b>Japan</b>								
1.300.000	ASAHI GROUP HOLDINGS LTD 0.541% 23/10/2028	EUR	1.202.425,26	0,18					
200.000	TAKEDA PHARMACEUTICAL CO LTD 3.000% 21/11/2030	EUR	217.632,80	0,03					
			<b>1.420.058,06</b>	<b>0,21</b>					
	<b>Jersey</b>								
590.000	APTIV PLC 1.500% 10/03/2025	EUR	590.694,62	0,09					
500.000	WHEEL BIDCO LTD 6.750% 15/07/2026	GBP	556.297,47	0,08					
			<b>1.146.992,09</b>	<b>0,17</b>					
	<b>Schweden</b>								
900.000	ATLAS COPCO AB 0.625% 30/08/2026 EMTN	EUR	879.640,23	0,13					
200.000	MOLNLYCKE HOLDING AB 0.875% 05/09/2029 EMTN	EUR	181.203,68	0,03					
			<b>1.060.843,91</b>	<b>0,16</b>					
						<b>Schweiz</b>			
500.000	UBS AG/LONDON 0.010% 31/03/2026 EMTN	EUR	477.019,83	0,07					
620.000	UBS AG/LONDON 0.500% 31/03/2031 EMTN	EUR	564.462,53	0,08					
			<b>1.041.482,36</b>	<b>0,15</b>					
						<b>Island</b>			
400.000	ISLANDSBANKI HF 19/01/2024 FRN GMTN	EUR	401.171,76	0,06					
400.000	LANDSBANKINN HF 0.500% 20/05/2024 EMTN	EUR	391.275,10	0,06					
200.000	LANDSBANKINN HF 1.000% 30/05/2023 EMTN	EUR	200.201,75	0,03					
			<b>992.648,61</b>	<b>0,15</b>					
						<b>Supranational-Multinational</b>			
750.000	CLARIOS GLOBAL LP / CLARIOS US FINANCE CO 8.500% 15/05/2027	USD	699.465,92	0,11					
			<b>699.465,92</b>	<b>0,11</b>					
						<b>Neuseeland</b>			
500.000	ASB FINANCE LTD 0.250% 08/09/2028 EMTN	EUR	450.436,50	0,07					
100.000	WESTPAC SECURITIES NZ LTD/LONDON 0.427% 14/12/2026 EMTN	EUR	95.414,91	0,01					
100.000	WESTPAC SECURITIES NZ LTD/LONDON 1.099% 24/03/2026 EMTN	EUR	99.192,78	0,01					
			<b>645.044,19</b>	<b>0,09</b>					
						<b>Portugal</b>			
600.000	BRISA-CONCESSAO RODOVIARIA SA 2.375% 10/05/2027 EMTN	EUR	623.998,40	0,09					
			<b>623.998,40</b>	<b>0,09</b>					
						<b>Singapur</b>			
600.000	DBS GROUP HOLDINGS LTD 11/04/2028 FRN GMTN	EUR	604.084,89	0,09					
			<b>604.084,89</b>	<b>0,09</b>					
						<b>Dänemark</b>			
120.000	CARLSBERG BREWERIES AS 0.625% 09/03/2030 EMTN	EUR	108.643,60	0,02					
500.000	CARLSBERG BREWERIES AS 0.875% 01/07/2029 EMTN	EUR	465.516,24	0,06					
			<b>574.159,84</b>	<b>0,08</b>					
						<b>Kaimaninseln</b>			
350.000	XLIT LTD 29/06/2047 FRN	EUR	359.618,96	0,05					
			<b>359.618,96</b>	<b>0,05</b>					
						<b>Liberia</b>			
150.000	ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD 5.375% 15/07/2027	USD	128.845,37	0,02					
236.000	ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD 5.500% 01/04/2028	USD	202.673,76	0,03					
			<b>331.519,13</b>	<b>0,05</b>					
						<b>Norwegen</b>			
100.000	NORSK HYDRO ASA 1.125% 11/04/2025	EUR	98.748,37	0,01					
			<b>98.748,37</b>	<b>0,01</b>					
							<b>367.045.852,63</b>	<b>53,79</b>	
						<b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>			
						<b>Aktien</b>			
						<b>Russland</b>			
253.112	MOSCOW EXCHANGE MICEX-RTS PJSC	RUB	0,28	0,00					

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) First Class Multi Asset

(ausgedrückt in EUR)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
9.788	UNITED CO RUSAL INTERNATIONAL PJSC	RUB	0,01	0,00
			<b>0,29</b>	<b>0,00</b>
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>				
<b>Jersey</b>				
597.580	WISDOMTREE ALUMINIUM	USD	2.607.514,40	0,38
79.906	WISDOMTREE COPPER	USD	3.004.778,72	0,44
			<b>5.612.293,12</b>	<b>0,82</b>
<b>Organismen für gemeinsame Anlagen</b>				
<b>Offene Fonds</b>				
<b>Luxemburg</b>				
317.794	AMUNDI INDEX US CORP SRI UCITS ETF DR	USD	16.425.664,09	2,41
			<b>16.425.664,09</b>	<b>2,41</b>
<b>Irland</b>				
2.183.521	ISHARES JP MORGAN ESG USD EM BOND UCITS ETF	USD	10.410.802,06	1,52
			<b>10.410.802,06</b>	<b>1,52</b>
			<b>26.836.466,15</b>	<b>3,93</b>
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>			<b>627.713.103,06</b>	<b>91,98</b>

### Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022

Bezeichnung	Verkauf / Kauf	Zinssatz (%)	Fälligkeits- datum	Währung	Nennwert	Swap-Wert in EUR
<b>Credit Default Swaps</b>						
CDX ITRAXX EUROPE SERIES 37 VERSION 1	Kauf	1,000	20/06/2027	EUR	14.000.000,00	(191.333,24)
CDX NORTH AMERICA HIGH YIELD SERIES 38 VERSION 1	Kauf	5,000	20/06/2027	USD	6.690.000,00	(333.434,25)
CDX ITRAXX EUROPE CROSSOVER SERIES 37 VERSION 1	Kauf	5,000	20/06/2027	EUR	6.000.000,00	(437.479,56)
						<b>(962.247,05)</b>

Zu erhalten	Zu zahlen	Fälligkeits- datum	Engagement in EUR	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR	
<b>Devisentermingeschäfte</b>					
893.494.728,40	CZK	35.166.057,02 EUR	19/04/2022	35.166.057,02	1.334.397,20
12.693.702,91	EUR	1.625.129.826,00 JPY	19/04/2022	12.693.702,91	661.887,84
62.474.754,06	EUR	69.321.000,00 USD	30/06/2022	62.474.754,06	393.040,59
9.439.861,63	EUR	1.230.000.000,00 JPY	27/05/2022	9.439.861,63	337.874,55
4.716.437.524,60	HUF	12.516.752,54 EUR	19/04/2022	12.516.752,54	294.011,71
23.104.243,25	EUR	19.400.000,00 GBP	27/05/2022	23.104.243,25	197.630,21
7.613.849,04	AUD	4.961.116,92 EUR	19/04/2022	4.961.116,92	176.283,98
4.576.120,18	EUR	5.031.258,68 USD	19/04/2022	4.576.120,18	56.212,25
29.819.965,62	USD	26.734.498,20 EUR	19/04/2022	26.734.498,20	54.722,52
4.038.843,01	RON	811.771,55 EUR	19/04/2022	811.771,55	3.569,29
1.181.387,38	EUR	1.000.000,00 GBP	30/06/2022	1.181.387,38	2.553,58
131.456,91	EUR	657.750,86 RON	19/04/2022	131.456,91	(1.326,45)
519.980,51	GBP	614.298,41 EUR	30/06/2022	614.298,41	(1.327,81)
218.902,69	EUR	330.725,90 AUD	19/04/2022	218.902,69	(4.252,72)
7.600.000,00	USD	6.829.432,41 EUR	27/05/2022	6.829.432,41	(12.035,49)
850.513,97	EUR	319.918.443,47 HUF	19/04/2022	850.513,97	(18.446,92)
6.685.476,72	USD	6.017.705,94 EUR	30/06/2022	6.017.705,94	(30.402,67)
2.134.436,08	EUR	53.878.506,76 CZK	19/04/2022	2.134.436,08	(66.572,95)
21.126.056,07	EUR	30.600.000,00 CAD	27/05/2022	21.126.056,07	(846.631,74)
2.768.947.495,00	JPY	21.628.652,26 EUR	19/04/2022	21.628.652,26	(1.128.465,96)
30.707.659,26	EUR	49.000.000,00 AUD	27/05/2022	30.707.659,26	(2.327.949,08)
180.905.681,64	EUR	204.500.000,00 USD	27/05/2022	180.905.681,64	(2.536.117,08)
				<b>464.825.061,28</b>	<b>(3.461.345,15)</b>

Stückzahl	Bezeichnung	Währung	Engagement in EUR	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR
<b>Futures auf Aktienindizes</b>				
(284)	EURO STOXX 50 17/06/2022	EUR	10.857.320,00	(140.551,01)
36	FTSE 100 INDEX FUTURE 17/06/2022	GBP	3.189.070,12	116.001,04
(153)	MSCI EMERGING MARKETS 17/06/2022	USD	7.738.349,89	(281.233,99)
(206)	S&P500 EMINI FUTURE 17/06/2022	USD	41.941.962,88	(2.563.653,95)
			<b>63.726.702,89</b>	<b>(2.869.437,91)</b>
<b>Zins-Futures</b>				
(348)	AUSTRALIA 10Y BOND FUTURE 15/06/2022	AUD	29.768.416,91	1.159.854,31
(231)	CANADA 10YR BOND FUTURE 21/06/2022	CAD	21.701.198,44	941.802,31
(164)	EURO-BOBL FUTURE 08/06/2022	EUR	21.133.040,00	(39.713,92)
99	EURO-BUND FUTURE 08/06/2022	EUR	15.707.340,00	(830.651,50)
(86)	EURO-OAT FUTURE 08/06/2022	EUR	13.029.860,00	589.153,15
(96)	LONG GILT FUTURE 28/06/2022	GBP	13.771.875,33	(15.334,14)

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) First Class Multi Asset

(ausgedrückt in EUR)

### Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl	Bezeichnung	Währung	Engagement in EUR	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR
24	US ULTRA BOND (CBT) 21/06/2022	USD	3.820.608,46	52.731,66
(298)	US 10YR NOTE (CBT) 21/06/2022	USD	32.909.495,35	(124.570,82)
(375)	US 5YR NOTE (CBT) 30/06/2022	USD	38.653.496,16	429.013,54
			<b>190.495.330,65</b>	<b>2.162.284,59</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>				<b>(5.130.745,52)</b>

### Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick

		% NIW
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	<b>627.713.103,06</b>	<b>91,98</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	<b>(5.130.745,52)</b>	<b>(0,75)</b>
<b>Bankguthaben</b>	<b>28.565.733,38</b>	<b>4,19</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>	<b>31.287.499,53</b>	<b>4,58</b>
<b>Nettovermögen Gesamt</b>	<b>682.435.590,45</b>	<b>100,00</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) First Class Multi Asset Premium

(ausgedrückt in EUR)

### Statistische Angaben

<b>Nettovermögen</b>	31.03.2022	EUR	22.804.022,46	<b>Anzahl der Anteile</b>			
	30.09.2021	EUR	143.192.193,44				
	30.09.2020	EUR	145.596.754,59		Capitalisation P (EUR)	31.03.2022	6
<b>Nettoinventarwert pro Anteil**</b>					30.09.2021	198.816	
					30.09.2020	259.387	
				Capitalisation X (EUR)	31.03.2022	977	
Capitalisation I (EUR)	31.03.2022	EUR	6.802,04		30.09.2021	934	
	30.09.2021	EUR	6.967,24		30.09.2020	1.203	
	30.09.2020	EUR	6.385,69	Capitalisation Z (EUR)	31.03.2022	-	
Capitalisation I Hedged (i) (PLN)	31.03.2022	PLN	24.378,77		30.09.2021	7.390	
	30.09.2021	PLN	24.660,92		30.09.2020	6.514	
	30.09.2020	PLN	22.495,52	Distribution I (HY) Hedged (i) (JPY)	31.03.2022	94.133	
Capitalisation I Hedged (i) (USD)	31.03.2022	USD	5.706,60		30.09.2021	80.995	
	30.09.2021	USD	5.811,75		30.09.2020	66.667	
	30.09.2020	USD	5.278,40	<b>Dividende</b>			
Capitalisation N (EUR)	31.03.2022	EUR	33,65		Distribution I (HY) Hedged (i) (JPY)	28.02.2022	JPY 111,00
	30.09.2021	EUR	34,49				
	30.09.2020	EUR	31,65	<b>Laufende Kosten in %*</b>			
Capitalisation P (EUR)	31.03.2022	EUR	320,63		Capitalisation I (EUR)	31.03.2022	0,79%
	30.09.2021	EUR	329,91		Capitalisation I Hedged (i) (PLN)	31.03.2022	0,81%
	30.09.2020	EUR	304,62	Capitalisation I Hedged (i) (USD)	31.03.2022	0,80%	
Capitalisation X (EUR)	31.03.2022	EUR	293,10	Capitalisation N (EUR)	31.03.2022	0,93%	
	30.09.2021	EUR	302,54	Capitalisation P (EUR)	31.03.2022	1,51%	
	30.09.2020	EUR	281,59	Capitalisation X (EUR)	31.03.2022	2,33%	
Capitalisation Z (EUR)	31.03.2022	EUR	-	Distribution I (HY) Hedged (i) (JPY)	31.03.2022	0,81%	
	30.09.2021	EUR	7.546,62	<b>Portfolioumsatz in %*</b>			
	30.09.2020	EUR	6.868,50		Capitalisation I (EUR)	31.03.2022	170,72%
Distribution I (HY) Hedged (i) (JPY)	31.03.2022	JPY	9.668,00				
	30.09.2021	JPY	9.989,00				
	30.09.2020	JPY	9.320,00				
<b>Anzahl der Anteile</b>							
	Capitalisation I (EUR)	31.03.2022		1.989			
		30.09.2021		1.992			
30.09.2020			2.463				
Capitalisation I Hedged (i) (PLN)	31.03.2022		371				
	30.09.2021		202				
	30.09.2020		66				
Capitalisation I Hedged (i) (USD)	31.03.2022		0,51				
	30.09.2021		0,51				
	30.09.2020		9				
Capitalisation N (EUR)	31.03.2022		8.672				
	30.09.2021		9.487				
	30.09.2020		12.120				

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.



## NN (L) First Class Multi Asset Premium

(ausgedrückt in EUR)

### Finanzabschlüsse

#### Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022

	Erläuterungen	
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	2	<b>20.121.582,99</b>
Aktien		9.870.800,89
Organismen für gemeinsame Anlagen		1.885.222,69
Börsengehandelte Wertpapiere		176.049,33
Anleihen und andere Schuldtitel		8.189.510,08
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	2	<b>139.498,00</b>
Credit Default Swaps		139.498,00
<b>Bankguthaben</b>		<b>1.908.587,29</b>
<b>Hinterlegte Sicherheiten</b>		<b>302.807,76</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte</b>	4, 12	<b>1.520.163,29</b>
<b>Vermögenswerte Gesamt</b>		<b>23.992.639,33</b>
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>	4, 12	<b>(333.477,41)</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	2	<b>(855.139,46)</b>
Devisentermingeschäfte		(830.326,91)
Futures		(24.812,55)
<b>Verbindlichkeiten Gesamt</b>		<b>(1.188.616,87)</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Berichtszeitraums</b>		<b>22.804.022,46</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.



# NN (L) First Class Multi Asset Premium

(ausgedrückt in EUR)

## Wertpapierbestand zum 31.03.2022

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW	Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
<b>Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>									
<b>Aktien</b>									
<b>Vereinigte Staaten</b>									
103	ADOBE INC	USD	42.177,56	0,18	560	EVERSOURCE ENERGY	USD	44.386,28	0,19
345	ADVANCED MICRO DEVICES INC	USD	33.903,11	0,15	156	EXPEDIA GROUP INC	USD	27.434,07	0,12
122	AIR PRODUCTS AND CHEMICALS INC	USD	27.402,17	0,12	45	FEDEX CORP	USD	9.358,33	0,04
7	ALPHABET INC - A	USD	17.498,27	0,08	702	FIFTH THIRD BANCORP	USD	27.155,06	0,12
108	ALPHABET INC - C	USD	271.103,15	1,19	1.396	FORD MOTOR CO	USD	21.216,34	0,09
74	AMAZON.COM INC	USD	216.812,38	0,95	405	GILEAD SCIENCES INC	USD	21.639,55	0,09
196	AMERICAN EXPRESS CO	USD	32.941,18	0,14	131	HCA HEALTHCARE INC	USD	29.507,23	0,13
43	AMERICAN TOWER CORP	USD	9.708,77	0,04	225	HERSHEY CO/THE	USD	43.806,90	0,19
82	AMERIPRISE FINANCIAL INC	USD	22.135,91	0,10	295	HOME DEPOT INC/THE	USD	79.362,20	0,35
67	AMGEN INC	USD	14.561,58	0,06	53	HUMANA INC	USD	20.728,90	0,09
2.843	APPLE INC	USD	446.156,68	1,97	48	IDEXX LABORATORIES INC	USD	23.600,31	0,10
230	APPLIED MATERIALS INC	USD	27.244,87	0,12	265	INCYTE CORP	USD	18.915,47	0,08
93	AVALONBAY COMMUNITIES INC	USD	20.759,82	0,09	1.351	INTEL CORP	USD	60.176,66	0,26
44	AVERY DENNISON CORP	USD	6.879,68	0,03	54	INTUIT INC	USD	23.336,50	0,10
2.407	BANK OF AMERICA CORP	USD	89.171,38	0,40	210	INTUITIVE SURGICAL INC	USD	56.938,66	0,25
104	BIOGEN INC	USD	19.684,90	0,09	436	IRON MOUNTAIN INC	USD	21.712,81	0,10
84	BLOCK INC	AUD	10.506,97	0,05	745	JPMORGAN CHASE & CO	USD	91.276,14	0,40
62	BLOCK INC - A	USD	7.556,01	0,03	554	KEURIG DR PEPPER INC	USD	18.870,80	0,08
10	BOOKING HOLDINGS INC	USD	21.106,82	0,09	368	KROGER CO/THE	USD	18.974,66	0,08
216	BROWN & BROWN INC	USD	14.029,86	0,06	34	LAM RESEARCH CORP	USD	16.428,11	0,07
96	BURLINGTON STORES INC	USD	15.717,72	0,07	83	LULULEMON ATHLETICA INC	USD	27.244,95	0,12
321	CARDINAL HEALTH INC	USD	16.357,97	0,07	168	MARRIOTT INTERNATIONAL INC/MD - A	USD	26.536,65	0,12
120	CARMAX INC	USD	10.405,43	0,05	71	MARSH & MCLENNAN COS INC	USD	10.874,78	0,05
246	CATALENT INC	USD	24.519,30	0,11	181	MCDONALD'S CORP	USD	40.226,20	0,18
267	CBRE GROUP INC - A	USD	21.961,84	0,10	1.152	MERCK & CO INC	USD	84.951,78	0,37
372	CHENIERE ENERGY INC	USD	46.355,82	0,20	20	METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL INC	USD	24.683,23	0,11
298	CIGNA CORP	USD	64.174,52	0,28	1.296	MICROSOFT CORP	USD	359.115,41	1,57
45	CINTAS CORP	USD	17.204,47	0,08	105	MOLINA HEALTHCARE INC	USD	31.480,65	0,14
882	CISCO SYSTEMS INC/DELAWARE	USD	44.201,07	0,19	693	MONDELEZ INTERNATIONAL INC - A	USD	39.101,73	0,17
168	COGNEX CORP	USD	11.648,95	0,05	278	MONSTER BEVERAGE CORP	USD	19.963,33	0,09
103	COLGATE-PALMOLIVE CO	USD	7.019,72	0,03	63	MOODY'S CORP	USD	19.104,69	0,08
1.208	COMCAST CORP - A	USD	50.832,30	0,22	912	MORGAN STANLEY	USD	71.638,70	0,31
22	COOPER COS INC/THE	USD	8.256,85	0,04	132	NASDAQ INC	USD	21.140,88	0,09
82	COPART INC	USD	9.246,88	0,04	266	NIKE INC - B	USD	32.169,11	0,14
127	COSTCO WHOLESALE CORP	USD	65.728,62	0,29	174	NORFOLK SOUTHERN CORP	USD	44.603,68	0,20
126	CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	USD	20.904,69	0,09	481	NVIDIA CORP	USD	117.957,72	0,52
734	CSX CORP	USD	24.705,25	0,11	647	ONEOK INC	USD	41.070,97	0,18
196	CUMMINS INC	USD	36.131,36	0,16	100	ORACLE CORP	USD	7.435,40	0,03
71	DANAHER CORP	USD	18.717,86	0,08	107	OTIS WORLDWIDE CORP	USD	7.400,04	0,03
105	DEERE & CO	USD	39.206,67	0,17	105	PACKAGING CORP OF AMERICA	USD	14.731,99	0,06
151	DELL TECHNOLOGIES INC - C	USD	6.811,39	0,03	663	PARAMOUNT GLOBAL - B	USD	22.530,02	0,10
40	DEXCOM INC	USD	18.392,13	0,08	272	PAYCHEX INC	USD	33.361,65	0,15
24	DOMINO'S PIZZA INC	USD	8.779,26	0,04	311	PAYPAL HOLDINGS INC	USD	32.325,66	0,14
204	DOVER CORP	USD	28.767,00	0,13	319	PEPSICO INC	USD	47.988,33	0,21
350	EBAY INC	USD	18.011,95	0,08	1.247	PFIZER INC	USD	58.021,11	0,25
53	ECOLAB INC	USD	8.410,26	0,04	293	PINTEREST INC - A	USD	6.480,68	0,03
263	EDWARDS LIFESCIENCES CORP	USD	27.825,79	0,12	217	PNC FINANCIAL SERVICES GROUP INC/THE	USD	35.973,26	0,16
181	ELECTRONIC ARTS INC	USD	20.579,98	0,09	615	PROCTER & GAMBLE CO/THE	USD	84.457,83	0,37
253	ELI LILLY & CO	USD	65.116,26	0,29	315	PROGRESSIVE CORP/THE	USD	32.271,47	0,14
625	EMERSON ELECTRIC CO	USD	55.076,84	0,24	157	PROLOGIS INC	USD	22.785,57	0,10
78	EPAM SYSTEMS INC	USD	20.793,22	0,09	82	PTC INC	USD	7.938,74	0,03
263	ESSENTIAL UTILITIES INC	USD	12.085,73	0,05	376	PULTEGROUP INC	USD	14.159,35	0,06
26	ESTEE LAUDER COS INC/THE - A	USD	6.363,47	0,03	112	QORVO INC	USD	12.491,98	0,05
					76	REGENERON PHARMACEUTICALS INC	USD	47.705,86	0,21
					109	ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	USD	11.185,57	0,05
					36	ROCKWELL AUTOMATION INC	USD	9.060,42	0,04
					24	ROPER TECHNOLOGIES INC	USD	10.186,06	0,04
					153	SALESFORCE.COM INC	USD	29.196,03	0,13
					58	SBA COMMUNICATIONS CORP - A	USD	17.937,18	0,08
					73	SERVICENOW INC	USD	36.537,07	0,16
					58	SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	USD	13.012,14	0,06

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.



# NN (L) First Class Multi Asset Premium

(ausgedrückt in EUR)

## Wertpapierbestand zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
1.941	NETEASE INC	HKD	32.032,18	0,14
1.261	SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	HKD	18.248,71	0,08
1.237	TENCENT HOLDINGS LTD	HKD	53.122,13	0,23
3.255	WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	HKD	24.299,67	0,11
			<b>320.713,19</b>	<b>1,41</b>
<b>Schweiz</b>				
33	GEBERIT AG - REG	CHF	18.441,55	0,08
3	GIVAUDAN SA - REG	CHF	11.212,83	0,05
641	NESTLE SA - REG	CHF	75.248,54	0,33
14	PARTNERS GROUP HOLDING AG	CHF	15.771,80	0,07
96	ROCHE HOLDING AG - GENUSSSCHEIN	CHF	34.357,50	0,15
113	SIKA AG - REG	CHF	33.924,85	0,15
136	SWISS PRIME SITE AG - REG	CHF	12.120,13	0,05
46	SWISSCOM AG - REG	CHF	24.933,68	0,11
243	TE CONNECTIVITY LTD	USD	28.605,71	0,13
1.375	UBS GROUP AG - REG	CHF	24.366,62	0,10
			<b>278.983,21</b>	<b>1,22</b>
<b>Frankreich</b>				
640	AXA SA	EUR	17.001,60	0,07
670	CARREFOUR SA	EUR	13.162,15	0,06
163	CIE GENERALE DES ETABLISSEMENTS MICHELIN SCA	EUR	20.040,85	0,09
629	COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	EUR	34.135,83	0,15
1.600	CREDIT AGRICOLE SA	EUR	17.417,60	0,08
119	EDENRED	EUR	5.345,48	0,02
23	HERMES INTERNATIONAL	EUR	29.704,50	0,13
78	LEGRAND SA	EUR	6.737,64	0,03
79	L'OREAL SA	EUR	28.744,15	0,13
11	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	EUR	7.143,40	0,03
113	PERNOD RICARD SA	EUR	22.520,90	0,10
1.233	VEOLIA ENVIRONNEMENT SA	EUR	35.867,97	0,16
840	VIVENDI SE	EUR	9.945,60	0,04
			<b>247.767,67</b>	<b>1,09</b>
<b>Taiwan</b>				
900	ACCTON TECHNOLOGY CORP	TWD	6.281,55	0,03
2.162	ADVANTECH CO LTD	TWD	25.059,03	0,11
2.520	DELTA ELECTRONICS INC	TWD	21.224,57	0,09
760	ECLAT TEXTILE CO LTD	TWD	11.383,64	0,05
760	MEDIATEK INC	TWD	21.575,27	0,09
5.947	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING CO LTD	TWD	111.369,51	0,50
380	WIWYNN CORP	TWD	12.158,44	0,05
			<b>209.052,01</b>	<b>0,92</b>
<b>Südkorea</b>				
466	HYUNDAI ENGINEERING & CONSTRUCTION CO LTD	KRW	16.551,69	0,07
511	HYUNDAI STEEL CO	KRW	15.743,92	0,07
41	LG CHEM LTD	KRW	16.173,96	0,07
112	NAVER CORP	KRW	28.278,48	0,12
1.281	SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	KRW	24.886,93	0,10
109	SAMSUNG SDS CO LTD	KRW	11.194,31	0,05
560	SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD	KRW	17.232,85	0,08
252	SK HYNIX INC	KRW	22.049,74	0,10
126	SK INNOVATION CO LTD	KRW	20.087,69	0,09
264	SK SQUARE CO LTD	KRW	11.119,19	0,05
			<b>183.318,76</b>	<b>0,80</b>

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
<b>Irland</b>				
210	ACCENTURE PLC - A	USD	63.648,32	0,28
87	AON PLC - A	USD	25.461,56	0,11
394	CRH PLC	EUR	14.321,90	0,06
234	JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	USD	13.789,94	0,06
73	LINDE PLC	USD	20.957,52	0,09
448	MEDTRONIC PLC	USD	44.673,17	0,20
			<b>182.852,41</b>	<b>0,80</b>
<b>Deutschland</b>				
61	ALLIANZ SE - REG	EUR	13.209,55	0,06
105	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	EUR	8.253,00	0,04
926	DEUTSCHE POST AG - REG	EUR	40.327,30	0,18
395	EVONIK INDUSTRIES AG	EUR	9.946,10	0,04
63	MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGSGESELLSCHAFT AG IN MUENCHEN - REG	EUR	15.309,00	0,07
61	NEMETSCHKE SE	EUR	5.355,80	0,02
163	PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE - PREF	EUR	14.327,70	0,06
255	SIEMENS AG - REG	EUR	32.043,30	0,14
3.138	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	EUR	7.747,72	0,03
151	VONOVIA SE	EUR	6.388,81	0,03
130	ZALANDO SE	EUR	5.980,00	0,03
			<b>158.888,28</b>	<b>0,70</b>
<b>Australien</b>				
1.048	AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP LTD	AUD	19.521,93	0,09
68	COCHLEAR LTD	AUD	10.341,42	0,05
978	COMPUTERSHARE LTD	AUD	16.303,78	0,07
58	CSL LTD	AUD	10.496,83	0,05
2.280	FORTESCUE METALS GROUP LTD	AUD	31.791,98	0,13
477	GOODMAN GROUP	AUD	7.369,14	0,03
154	MACQUARIE GROUP LTD	AUD	21.127,42	0,09
95	REA GROUP LTD	AUD	8.685,99	0,04
341	WESFARMERS LTD	AUD	11.601,75	0,05
685	WOOLWORTHS GROUP LTD	AUD	17.226,06	0,08
			<b>154.466,30</b>	<b>0,68</b>
<b>Brasilien</b>				
3.515	BANCO SANTANDER BRASIL SA	BRL	24.518,04	0,11
3.829	CPFL ENERGIA SA	BRL	23.369,74	0,10
3.393	HYPERA SA	BRL	24.841,43	0,11
8.229	ITAU UNIBANCO HOLDING SA - PREF	BRL	42.769,42	0,19
1.788	LOCALIZA RENT A CAR SA	BRL	20.662,28	0,09
			<b>136.160,91</b>	<b>0,60</b>
<b>Niederlande</b>				
5	ADYEN NV	EUR	9.045,00	0,04
123	AKZO NOBEL NV	EUR	9.621,06	0,04
74	ASML HOLDING NV	EUR	45.140,00	0,20
508	KONINKLIJKE PHILIPS NV	EUR	14.086,84	0,05
263	LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV - A	USD	24.303,83	0,11
144	PROSUS NV	EUR	6.994,80	0,03
83	WOLTERS KLUWER NV	EUR	8.016,14	0,04
			<b>117.207,67</b>	<b>0,51</b>
<b>Südafrika</b>				
2.236	BIDVEST GROUP LTD/THE	ZAR	30.764,84	0,13
1.017	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	ZAR	14.075,97	0,06
2.313	STANDARD BANK GROUP LTD	ZAR	25.911,82	0,11

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.



# NN (L) First Class Multi Asset Premium

(ausgedrückt in EUR)

## Wertpapierbestand zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
<b>Anleihen und andere Schuldtitel</b>				
<b>Vereinigte Staaten</b>				
200.000	MGM GROWTH PROPERTIES OPERATING PARTNERSHIP LP / MGP FINANCE CO-ISSUER INC 5.750% 01/02/2027	USD	190.662,16	0,84
1.010.000	UNITED STATES TREASURY NOTE 1.500% 15/02/2030	USD	851.008,85	3,73
1.000.000	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 2.250% 15/05/2041	USD	848.059,81	3,72
			<b>1.889.730,82</b>	<b>8,29</b>
<b>Deutschland</b>				
600.000	BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE ZCP 15/02/2032	EUR	568.581,53	2,50
400.000	BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE ZCP 15/08/2031	EUR	381.304,48	1,67
300.000	BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE 0.250% 15/02/2029	EUR	296.560,75	1,30
			<b>1.246.446,76</b>	<b>5,47</b>
<b>Kanada</b>				
800.000	CANADIAN GOVERNMENT BOND 1.500% 01/06/2031	CAD	533.560,45	2,34
600.000	CANADIAN GOVERNMENT BOND 5.750% 01/06/2029	CAD	527.093,58	2,31
			<b>1.060.654,03</b>	<b>4,65</b>
<b>Australien</b>				
1.400.000	AUSTRALIA GOVERNMENT BOND 2.250% 21/05/2028	AUD	920.947,00	4,04
			<b>920.947,00</b>	<b>4,04</b>
<b>Vereinigtes Königreich</b>				
170.000	UNITED KINGDOM GILT 0.625% 31/07/2035	GBP	173.187,09	0,76
450.000	UNITED KINGDOM GILT 4.500% 07/09/2034	GBP	695.911,24	3,05
			<b>869.098,33</b>	<b>3,81</b>
<b>Niederlande</b>				
500.000	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND ZCP 15/07/2031	EUR	469.014,72	2,06
200.000	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 4.000% 15/01/2037	EUR	287.301,52	1,26
			<b>756.316,24</b>	<b>3,32</b>
<b>Österreich</b>				
100.000	AUSTRIA GOVERNMENT BOND ZCP 20/02/2030	EUR	93.824,63	0,41
600.000	AUSTRIA GOVERNMENT BOND ZCP 20/02/2031	EUR	554.838,38	2,42
			<b>648.663,01</b>	<b>2,83</b>
<b>Finnland</b>				
140.000	FINLAND GOVERNMENT BOND 0.125% 15/09/2031	EUR	130.319,25	0,57
180.000	FINLAND GOVERNMENT BOND 0.500% 15/09/2029	EUR	176.957,42	0,78
130.000	FINLAND GOVERNMENT BOND 1.125% 15/04/2034	EUR	131.916,64	0,58
			<b>439.193,31</b>	<b>1,93</b>
<b>Irland</b>				
90.000	IRELAND GOVERNMENT BOND ZCP 18/10/2031	EUR	81.873,41	0,36
120.000	IRELAND GOVERNMENT BOND 0.400% 15/05/2035	EUR	109.051,51	0,48
			<b>190.924,92</b>	<b>0,84</b>
<b>Spanien</b>				
150.000	SPAIN GOVERNMENT BOND 1.000% 31/10/2050	EUR	119.231,25	0,52
			<b>119.231,25</b>	<b>0,52</b>

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW		
<b>Belgien</b>						
50.000	BELGIUM GOVERNMENT BOND 1.400% 22/06/2053	EUR	48.304,41	0,21		
			<b>48.304,41</b>	<b>0,21</b>		
			<b>8.189.510,08</b>	<b>35,91</b>		
<b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>						
<b>Aktien</b>						
<b>Russland</b>						
36.712	MOSCOW EXCHANGE MICEX-RTS PJSC	RUB	0,04	0,00		
3.278	UNITED CO RUSAL INTERNATIONAL PJSC	RUB	0,00	0,00		
			<b>0,04</b>	<b>0,00</b>		
			<b>0,04</b>	<b>0,00</b>		
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>						
<b>Offene Fonds</b>						
<b>Jersey</b>						
19.715	WISDOMTREE ALUMINIUM	USD	86.025,55	0,38		
2.394	WISDOMTREE COPPER	USD	90.023,78	0,39		
			<b>176.049,33</b>	<b>0,77</b>		
			<b>176.049,33</b>	<b>0,77</b>		
<b>Organismen für gemeinsame Anlagen</b>						
<b>Offene Fonds</b>						
<b>Irland</b>						
141.571	ISHARES EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND ESG UCITS ETF	EUR	702.956,64	3,08		
72.280	ISHARES JP MORGAN ESG USD EM BOND UCITS ETF	USD	344.623,56	1,51		
174.011	ISHARES USD HIGH YIELD CORPORATE BOND ESG UCITS ETF	USD	837.642,49	3,68		
			<b>1.885.222,69</b>	<b>8,27</b>		
			<b>1.885.222,69</b>	<b>8,27</b>		
			<b>20.121.582,99</b>	<b>88,24</b>		
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>						
<b>Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022</b>						
Bezeichnung	Verkauf / Kauf	Zinssatz (%)	Fälligkeits- datum	Währung	Nennwert	Swap-Wert in EUR
<b>Credit Default Swaps</b>						
CDX NORTH AMERICA INVESTMENT GRADE SERIES 38 VERSION 1	Verkauf	1,000	20/06/2027	USD	2.900.000,00	42.146,40
CDX NORTH AMERICA HIGH YIELD SERIES 38 VERSION 1	Verkauf	5,000	20/06/2027	USD	800.000,00	39.872,57
CDX ITRAXX EUROPE SERIES 37 VERSION 1	Verkauf	1,000	20/06/2027	EUR	2.200.000,00	30.066,65

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) First Class Multi Asset Premium

(ausgedrückt in EUR)

### Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Bezeichnung	Verkauf / Kauf	Zinssatz (%)	Fälligkeitsdatum	Währung	Nennwert	Swap-Wert in EUR
CDX NORTH AMERICA HIGH YIELD SERIES 38 VERSION 1	Verkauf	5,000	20/06/2027	USD	550.000,00	27.412,38
						<b>139.498,00</b>

Zu erhalten	Zu zahlen	Fälligkeitsdatum	Engagement in EUR	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR
-------------	-----------	------------------	-------------------	---

#### Devisentermingeschäfte

10.845.478,00	PLN	2.292.354,88	EUR	19/04/2022	2.292.354,88	42.461,81	
1.162.714,66	EUR	151.500.000,00	JPY	27/05/2022	1.162.714,66	41.616,25	
2.274.696,11	EUR	1.910.000,00	GBP	27/05/2022	2.274.696,11	19.457,40	
271.103,40	EUR	34.950.945,00	JPY	19/04/2022	271.103,40	12.340,50	
1.300.000,00	CAD	926.268,33	EUR	27/05/2022	926.268,33	7.211,87	
216.297,24	EUR	240.000,00	USD	30/06/2022	216.297,24	1.360,77	
11.813,87	EUR	10.000,00	GBP	30/06/2022	11.813,87	25,53	
2.996,31	USD	2.684,71	EUR	19/04/2022	2.684,71	7,07	
73,49	EUR	80,72	USD	19/04/2022	73,49	0,97	
17.000,00	USD	15.324,70	EUR	30/06/2022	15.324,70	(100,03)	
1.060.000,00	GBP	1.254.788,35	EUR	27/05/2022	1.254.788,35	(3.189,91)	
377.141,70	EUR	1.838.065,65	PLN	19/04/2022	377.141,70	(18.557,44)	
88.700.000,00	JPY	675.236,25	EUR	27/05/2022	675.236,25	(18.857,18)	
933.763,52	EUR	1.490.000,00	AUD	27/05/2022	933.763,52	(70.788,65)	
1.864.063,77	EUR	2.700.000,00	CAD	27/05/2022	1.864.063,77	(74.702,80)	
13.930.000,00	USD	12.589.942,22	EUR	27/05/2022	12.589.942,22	(94.371,28)	
19.378.242,69	EUR	21.940.000,00	USD	27/05/2022	19.378.242,69	(302.505,79)	
939.334.446,00	JPY	7.326.194,75	EUR	19/04/2022	7.326.194,75	(371.736,00)	
						<b>51.572.704,64</b>	<b>(830.326,91)</b>

Stückzahl	Bezeichnung	Währung	Engagement in EUR	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR
-----------	-------------	---------	-------------------	---

#### Futures auf Aktienindizes

(11)	EURO STOXX 50 17/06/2022	EUR	420.530,00	(5.443,87)	
2	FTSE 100 INDEX FUTURE 17/06/2022	GBP	177.170,56	6.444,50	
(4)	MSCI EMERGING MARKETS 17/06/2022	USD	202.309,80	(7.352,52)	
(4)	S&P500 EMINI FUTURE 17/06/2022	USD	814.407,05	(49.779,70)	
				<b>1.614.417,41</b>	<b>(56.131,59)</b>

#### Zins-Futures

(8)	AUSTRALIA 10Y BOND FUTURE 15/06/2022	AUD	684.331,42	26.663,32
-----	--------------------------------------	-----	------------	-----------

Stückzahl	Bezeichnung	Währung	Engagement in EUR	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR
(10)	CANADA 10YR BOND FUTURE 21/06/2022	CAD	939.445,82	40.770,66
(6)	EURO-BOBL FUTURE 08/06/2022	EUR	773.160,00	(1.452,95)
4	EURO-BUND FUTURE 08/06/2022	EUR	634.640,00	(33.561,67)
2	EURO-OAT FUTURE 08/06/2022	EUR	303.020,00	(13.860,00)
(5)	LONG GILT FUTURE 28/06/2022	GBP	717.285,17	(58,08)
1	US ULTRA BOND (CBT) 21/06/2022	USD	159.192,02	2.197,15
(3)	US 10YR NOTE (CBT) 21/06/2022	USD	331.303,64	(3.858,26)
(13)	US 5YR NOTE (CBT) 30/06/2022	USD	1.339.987,87	14.478,87
			<b>5.882.365,94</b>	<b>31.319,04</b>

**Derivative Finanzinstrumente Gesamt (715.641,46)**

### Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick

		% NIW
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	<b>20.121.582,99</b>	<b>88,24</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	<b>(715.641,46)</b>	<b>(3,14)</b>
<b>Bankguthaben</b>	<b>1.908.587,29</b>	<b>8,37</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>	<b>1.489.493,64</b>	<b>6,53</b>
<b>Nettovermögen Gesamt</b>	<b>22.804.022,46</b>	<b>100,00</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) First Class Protection

(ausgedrückt in EUR)

### Statistische Angaben

<b>Nettovermögen</b>	31.03.2022	EUR	64.154.187,57
	30.09.2021	EUR	62.745.737,30
	30.09.2020	EUR	67.559.594,78
<b>Nettoinventarwert pro Anteil**</b>			
Capitalisation I (EUR)	31.03.2022	EUR	5.097,94
	30.09.2021	EUR	5.174,46
	30.09.2020	EUR	4.977,15
Capitalisation N (EUR)	31.03.2022	EUR	31,51
	30.09.2021	EUR	31,99
	30.09.2020	EUR	30,80
Capitalisation P (EUR)	31.03.2022	EUR	30,59
	30.09.2021	EUR	31,12
	30.09.2020	EUR	30,06
<b>Anzahl der Anteile</b>			
Capitalisation I (EUR)	31.03.2022		3.484
	30.09.2021		2.917
	30.09.2020		3.139
Capitalisation N (EUR)	31.03.2022		794.043
	30.09.2021		816.906
	30.09.2020		878.836
Capitalisation P (EUR)	31.03.2022		698.730
	30.09.2021		691.556
	30.09.2020		827.459
<b>Laufende Kosten in %*</b>			
Capitalisation I (EUR)	31.03.2022		0,54%
Capitalisation N (EUR)	31.03.2022		0,61%
Capitalisation P (EUR)	31.03.2022		0,97%
<b>Portfolioumsatz in %*</b>	31.03.2022		(46,06%)

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

## NN (L) First Class Protection

(ausgedrückt in EUR)

### Finanzabschlüsse

#### Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022

	Erläuterungen	
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	2	<b>60.407.413,82</b>
Organismen für gemeinsame Anlagen		24.568.900,51
Anleihen und andere Schuldtitel		2.217.592,78
Geldmarktinstrumente		33.620.920,53
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	2	<b>314.570,00</b>
Futures		314.570,00
<b>Bankguthaben</b>		<b>2.134.803,13</b>
<b>Hinterlegte Sicherheiten</b>		<b>1.501.384,40</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte</b>	4	<b>33.835,10</b>
<b>Vermögenswerte Gesamt</b>		<b>64.392.006,45</b>
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>	4	<b>(237.818,88)</b>
<b>Verbindlichkeiten Gesamt</b>		<b>(237.818,88)</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Berichtszeitraums</b>		<b>64.154.187,57</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.



# NN (L) First Class Protection

(ausgedrückt in EUR)

## Wertpapierbestand zum 31.03.2022

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
<b>Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>				
<b>Anleihen und andere Schuldtitel</b>				
<b>Vereinigte Staaten</b>				
2.200.000	WELLS FARGO & CO 1.500% 12/09/2022 EMTN	EUR	2.217.592,78	3,46
			<b>2.217.592,78</b>	<b>3,46</b>
<b>Geldmarktinstrumente</b>				
<b>Frankreich</b>				
1.000.000	CDC HABITAT ZCP 24/10/2022	EUR	1.001.743,45	1,56
2.000.000	METROPOLE DE LYON ZCP 11/04/2022	EUR	2.000.296,36	3,12
1.000.000	METROPOLE DE LYON ZCP 20/04/2022	EUR	1.000.277,92	1,56
2.000.000	REGION NORD ZCP 21/04/2022	EUR	2.000.538,54	3,12
1.000.000	REGION OCCITANIE ZCP 08/04/2022	EUR	1.000.104,82	1,56
2.000.000	SAGESS ZCP 06/05/2022	EUR	2.000.911,00	3,11
1.000.000	SAGESS ZCP 25/05/2022	EUR	1.000.697,79	1,56
2.000.000	VILLE DE PARIS ZCP 17/05/2022	EUR	2.001.239,54	3,12
			<b>12.005.809,42</b>	<b>18,71</b>
<b>Belgien</b>				
2.000.000	BRUSSELS MUNICIPALITIES REGION ZCP 25/04/2022	EUR	2.000.622,92	3,12
1.100.000	BRUSSELS MUNICIPALITIES REGIONAL FUND ZCP 15/06/2022	EUR	1.100.892,10	1,72
500.000	SOCIETE WALLONE DU CREDIT SOCIAL ZCP 31/05/2022	EUR	500.736,77	0,78
2.500.000	SOCIETE WALLONE DU CREDIT SOCIAL ZCP 31/05/2022	EUR	2.501.865,83	3,89
2.000.000	VLAAMSE GEMEENSCHAP ZCP 19/04/2022	EUR	2.000.478,44	3,12
			<b>8.104.596,06</b>	<b>12,63</b>
<b>Schweiz</b>				
1.000.000	BASLER KANTONALBANK ZCP 04/04/2022 (1)	EUR	1.000.051,59	1,56
2.000.000	CREDIT SUISSE ZCP 23/06/2022	EUR	2.001.472,48	3,12
			<b>3.001.524,07</b>	<b>4,68</b>
<b>Norwegen</b>				
1.000.000	DNB BANK ASA ZCP 09/09/2022	EUR	1.001.214,35	1,56
1.000.000	DNB BANK ASA ZCP 14/09/2022	EUR	1.001.183,51	1,56
			<b>2.002.397,86</b>	<b>3,12</b>
<b>Kanada</b>				
2.000.000	TORONTO DOMINION BANK ZCP 18/07/2022	EUR	2.001.997,06	3,12
			<b>2.001.997,06</b>	<b>3,12</b>
<b>Österreich</b>				
2.000.000	BUNDESIMMOBILIENGESELLSCHAFT MBH ZCP 23/05/2022	EUR	2.000.975,00	3,12
			<b>2.000.975,00</b>	<b>3,12</b>
<b>Schweden</b>				
1.500.000	SVENSKA HANDELSBANKEN AB ZCP 15/06/2022	EUR	1.501.560,90	2,34
			<b>1.501.560,90</b>	<b>2,34</b>
<b>Luxemburg</b>				
1.000.000	INDUSTRIAL AND COMMERCIAL BANK OF CHINA ZCP 24/08/2022 (1)	EUR	1.000.873,55	1,56

(1) Kurzfristiges Einlagezertifikat.

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
500.000	INDUSTRIAL AND COMMERCIAL BANK OF CHINA ZCP 31/08/2022 (1)	EUR	500.443,55	0,78
			<b>1.501.317,10</b>	<b>2,34</b>
<b>Vereinigtes Königreich</b>				
1.500.000	QATAR NATIONAL BANK (Q.P.S.C.) ZCP 09/02/2023 (1)	EUR	1.500.743,06	2,34
			<b>1.500.743,06</b>	<b>2,34</b>
			<b>33.620.920,53</b>	<b>52,40</b>
<b>Organismen für gemeinsame Anlagen</b>				
<b>Offene Fonds</b>				
<b>Luxemburg</b>				
12.446	NN (L) LIQUID EUR - Z CAP EUR	EUR	12.293.038,66	19,17
12.173	NN (L) LIQUID EURIBOR 3M - A CAP EUR	EUR	12.275.861,85	19,13
			<b>24.568.900,51</b>	<b>38,30</b>
			<b>24.568.900,51</b>	<b>38,30</b>
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>			<b>60.407.413,82</b>	<b>94,16</b>

## Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022

Stückzahl	Bezeichnung	Währung	Engagement in EUR	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR
<b>Future auf Aktienindizes</b>				
261	EURO STOXX 50 17/06/2022	EUR	9.978.030,00	314.570,00
			<b>9.978.030,00</b>	<b>314.570,00</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>				<b>314.570,00</b>

## Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick

		% NIW
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	<b>60.407.413,82</b>	<b>94,16</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	<b>314.570,00</b>	<b>0,49</b>
<b>Bankguthaben</b>	<b>2.134.803,13</b>	<b>3,33</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>	<b>1.297.400,62</b>	<b>2,02</b>
<b>Nettovermögen Gesamt</b>	<b>64.154.187,57</b>	<b>100,00</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) First Class Stable Yield Opportunities

(ausgedrückt in EUR)

### Statistische Angaben

<b>Nettovermögen</b>	31.03.2022	EUR	64.054.623,77	<b>Anzahl der Anteile</b>				
	30.09.2021	EUR	50.274.444,65					
	30.09.2020	EUR	43.647.135,72		Capitalisation X (EUR)	31.03.2022	3.892	
<b>Nettoinventarwert pro Anteil**</b>					30.09.2021	6.421		
					30.09.2020	3.478		
Capitalisation I (EUR)	31.03.2022	EUR	5.757,73	Capitalisation Z (EUR)	31.03.2022	7.599		
	30.09.2021	EUR	6.104,05		30.09.2021	4.411		
	30.09.2020	EUR	5.904,82		30.09.2020	2.368		
Capitalisation I Hedged (i) (PLN)	31.03.2022	PLN	22.706,22	Distribution D (Q) (EUR)	31.03.2022	266		
	30.09.2021	PLN	23.769,82		30.09.2021	266		
	30.09.2020	PLN	22.881,72		30.09.2020	266		
Capitalisation I Hedged (i) (USD)	31.03.2022	USD	5.384,74	Distribution N (Q) (EUR)	31.03.2022	901.914		
	30.09.2021	USD	5.672,98		30.09.2021	947.879		
	30.09.2020	USD	5.429,03		30.09.2020	1.108.692		
Capitalisation P (EUR)	31.03.2022	EUR	271,23	<b>Dividende</b>				
	30.09.2021	EUR	287,84		Distribution D (Q) (EUR)	11.02.2022	EUR	0,02
	30.09.2020	EUR	278,96		Distribution D (Q) (EUR)	11.11.2021	EUR	0,15
Capitalisation X (EUR)	31.03.2022	EUR	250,94	Distribution N (Q) (EUR)	11.02.2022	EUR	0,11	
	30.09.2021	EUR	266,71	Distribution N (Q) (EUR)	11.11.2021	EUR	0,15	
	30.09.2020	EUR	259,37					
Capitalisation Z (EUR)	31.03.2022	EUR	5.195,40	<b>Laufende Kosten in %*</b>				
	30.09.2021	EUR	5.499,66		Capitalisation I (EUR)	31.03.2022	0,43%	
	30.09.2020	EUR	5.304,31		Capitalisation I Hedged (i) (PLN)	31.03.2022	0,45%	
Distribution D (Q) (EUR)	31.03.2022	EUR	16,88	Capitalisation I Hedged (i) (USD)	31.03.2022	0,43%		
	30.09.2021	EUR	18,09	Capitalisation P (EUR)	31.03.2022	0,63%		
	30.09.2020	EUR	18,14	Capitalisation X (EUR)	31.03.2022	0,95%		
Distribution N (Q) (EUR)	31.03.2022	EUR	17,37	Capitalisation Z (EUR)	31.03.2022	0,13%		
	30.09.2021	EUR	18,68	Distribution D (Q) (EUR)	31.03.2022	0,65%		
	30.09.2020	EUR	18,66	Distribution N (Q) (EUR)	31.03.2022	0,45%		
<b>Anzahl der Anteile</b>				<b>Portfolioumsatz in %*</b>				
					Portfolioumsatz in %*	31.03.2022	99,97%	
Capitalisation I (EUR)	31.03.2022		1.350					
	30.09.2021		1.052					
	30.09.2020		1.575					
Capitalisation I Hedged (i) (PLN)	31.03.2022		30					
	30.09.2021		30					
	30.09.2020		30					
Capitalisation I Hedged (i) (USD)	31.03.2022		0.30					
	30.09.2021		0.30					
	30.09.2020		7					
Capitalisation P (EUR)	31.03.2022		36					
	30.09.2021		44					
	30.09.2020		38					

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

## NN (L) First Class Stable Yield Opportunities

(ausgedrückt in EUR)

### Finanzabschlüsse

#### Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022

	Erläuterungen	
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	2	<b>60.207.191,68</b>
Anleihen und andere Schuldtitel		60.207.191,68
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	2	<b>311.232,05</b>
Credit Default Swaps		93.405,93
Devisentermingeschäfte		217.826,12
<b>Bankguthaben</b>		<b>2.693.360,27</b>
<b>Hinterlegte Sicherheiten</b>		<b>166.427,20</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte</b>	4, 12	<b>2.220.527,70</b>
<b>Vermögenswerte Gesamt</b>		<b>65.598.738,90</b>
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>	4	<b>(1.446.120,07)</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	2	<b>(97.995,06)</b>
Zinsswaps		(71.983,21)
Futures		(26.011,85)
<b>Verbindlichkeiten Gesamt</b>		<b>(1.544.115,13)</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Berichtszeitraums</b>		<b>64.054.623,77</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) First Class Stable Yield Opportunities

(ausgedrückt in EUR)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW	Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
<b>Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>									
<b>Anleihen und andere Schuldtitel</b>									
<b>Vereinigte Staaten</b>									
650.000	ABBVIE INC 2.950% 21/11/2026	USD	579.489,91	0,90	250.000	OWENS-BROCKWAY GLASS CONTAINER INC 6.625% 13/05/2027	USD	224.601,74	0,35
600.000	AIR LEASE CORP 4.250% 15/09/2024	USD	545.970,52	0,85	275.000	PATTERN ENERGY OPERATIONS LP / PATTERN ENERGY OPERATIONS INC 4.500% 15/08/2028	USD	243.206,29	0,38
200.000	ALBERTSONS COS INC / SAFEWAY INC / NEW ALBERTSONS LP / ALBERTSONS LLC 3.500% 15/03/2029	USD	162.265,73	0,25	150.000	PITNEY BOWES INC 7.250% 15/03/2029	USD	127.290,56	0,20
250.000	AMERICAN AIRLINES INC 11.750% 15/07/2025	USD	262.447,42	0,41	600.000	PNC FINANCIAL SERVICES GROUP INC/THE 2.600% 23/07/2026	USD	531.460,14	0,83
213.000	AMERICAN BUILDERS & CONTRACTORS SUPPLY CO INC 4.000% 15/01/2028	USD	184.063,07	0,29	225.000	SBA COMMUNICATIONS CORP 3.125% 01/02/2029	USD	183.833,86	0,29
600.000	AMERICAN TOWER CORP 1.300% 15/09/2025	USD	503.033,96	0,79	300.000	SERVICE CORP INTERNATIONAL/US 4.000% 15/05/2031	USD	251.562,46	0,39
400.000	AT&T INC 1.300% 05/09/2023	EUR	405.237,16	0,63	300.000	SIRIUS XM RADIO INC 3.875% 01/09/2031	USD	245.379,49	0,38
150.000	AUTOLIV INC 0.750% 26/06/2023	EUR	150.374,30	0,23	150.000	SPRINT CORP 7.625% 01/03/2026	USD	152.245,85	0,24
1.000.000	BANK OF AMERICA CORP 22/07/2027 FRN	USD	835.448,68	1,30	225.000	STANDARD INDUSTRIES INC/NJ 5.000% 15/02/2027	USD	200.810,50	0,31
300.000	BRIXMOR OPERATING PARTNERSHIP LP 2.250% 01/04/2028	USD	246.563,85	0,38	336.000	STAPLES INC 7.500% 15/04/2026	USD	293.107,87	0,46
725.000	BROADCOM INC 3.150% 15/11/2025	USD	647.233,20	1,01	400.000	STARWOOD PROPERTY TRUST INC 3.625% 15/07/2026	USD	343.193,09	0,54
197.000	BUILDERS FIRSTSOURCE INC 6.750% 01/06/2027	USD	183.617,32	0,29	650.000	SYNCHRONY FINANCIAL 4.375% 19/03/2024	USD	594.370,12	0,93
150.000	CARGO AIRCRAFT MANAGEMENT INC 4.750% 01/02/2028	USD	131.431,05	0,21	250.000	TENET HEALTHCARE CORP 4.375% 15/01/2030	USD	215.873,19	0,34
600.000	CDW LLC / CDW FINANCE CORP 2.670% 01/12/2026	USD	509.135,24	0,79	375.000	T-MOBILE USA INC 3.375% 15/04/2029	USD	321.221,20	0,50
350.000	CHARTER COMMUNICATIONS OPERATING LLC / CHARTER COMMUNICATIONS OPERATING CAPITAL 4.500% 01/02/2024	USD	322.291,81	0,50	750.000	TSMC ARIZONA CORP 1.750% 25/10/2026	USD	631.857,15	0,99
375.000	CHS/COMMUNITY HEALTH SYSTEMS INC 4.750% 15/02/2031	USD	318.496,38	0,50	200.000	US BANCORP 1.450% 12/05/2025	USD	172.075,66	0,27
275.000	CLEARWAY ENERGY OPERATING LLC 3.750% 15/01/2032	USD	228.154,59	0,36	262.000	VALLEY NATIONAL BANCORP 15/06/2031 FRN	USD	225.030,88	0,35
600.000	CONAGRA BRANDS INC 1.375% 01/11/2027	USD	479.369,46	0,75	650.000	VMWARE INC 4.500% 15/05/2025	USD	602.034,90	0,94
100.000	COTY INC 3.875% 15/04/2026	EUR	97.323,71	0,15	875.000	WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC 3.450% 01/06/2026	USD	791.066,47	1,23
200.000	CSC HOLDINGS LLC 5.375% 01/02/2028	USD	174.539,37	0,27	250.000	WORKDAY INC 3.500% 01/04/2027	USD	225.357,75	0,35
400.000	CVS HEALTH CORP 1.300% 21/08/2027	USD	326.993,61	0,51	<b>22.195.765,82 34,65</b>				
225.000	DARLING INGREDIENTS INC 5.250% 15/04/2027	USD	206.184,24	0,32	<b>Frankreich</b>				
250.000	DIEBOLD NIXDORF INC 9.375% 15/07/2025	USD	229.169,50	0,36	250.000	ALTICE FRANCE SA 2.125% 15/02/2025	EUR	237.781,36	0,37
600.000	DR HORTON INC 1.300% 15/10/2026	USD	491.144,30	0,77	100.000	BANIJAY ENTERTAINMENT SASU 3.500% 01/03/2025	EUR	99.854,22	0,16
750.000	EQUINIX INC 1.250% 15/07/2025	USD	628.758,15	0,98	500.000	BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL SA 0.010% 11/05/2026 EMTN	EUR	474.412,64	0,73
350.000	FORD MOTOR CO 3.250% 12/02/2032	USD	280.910,04	0,44	200.000	BNP PARIBAS SA 13/04/2027 FRN EMTN	EUR	189.121,21	0,30
200.000	FXI HOLDINGS INC 12.250% 15/11/2026	USD	194.530,29	0,30	200.000	BNP PARIBAS SA 24/05/2031 FRN EMTN	GBP	221.608,00	0,35
900.000	GOLDMAN SACHS GROUP INC 08/03/2024 FRN	USD	792.980,35	1,24	400.000	CREDIT AGRICOLE SA 05/06/2030 FRN EMTN	EUR	396.657,84	0,61
353.000	HAT HOLDINGS I LLC / HAT HOLDINGS II LLC 3.375% 15/06/2026	USD	301.302,28	0,47	225.000	CROWN EUROPEAN HOLDINGS SA 2.875% 01/02/2026	EUR	228.029,19	0,36
150.000	HCA INC 3.500% 01/09/2030	USD	130.141,74	0,20	35.556	E-CARAT SA 10FR D 20/12/2028 FRN	EUR	35.416,72	0,06
275.000	HUGHES SATELLITE SYSTEMS CORP 6.625% 01/08/2026	USD	256.434,93	0,40	200.000	ELIS SA 1.000% 03/04/2025 EMTN	EUR	193.287,24	0,30
200.000	INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCES INC 1.800% 25/09/2026	EUR	200.406,64	0,31	200.000	ELO SACA 3.250% 23/07/2027 EMTN	EUR	200.657,00	0,31
150.000	IRON MOUNTAIN INC 5.250% 15/03/2028	USD	133.518,82	0,21	200.000	FAURECIA SE 2.375% 15/06/2027	EUR	178.428,16	0,28
800.000	JPMORGAN CHASE & CO 09/08/2025 FRN	USD	682.218,90	1,07	200.000	FAURECIA SE 2.625% 15/06/2025	EUR	194.858,44	0,30
500.000	LENNAR CORP 4.750% 29/11/2027	USD	468.570,59	0,73	200.000	KAPLA HOLDING SAS 3.375% 15/12/2026	EUR	191.182,17	0,30
125.000	MARSH & MCLENNAN COS INC 2.375% 15/12/2031	USD	102.993,29	0,16	200.000	LOXAM SAS 3.250% 14/01/2025	EUR	197.159,60	0,31
200.000	MASCO CORP 1.500% 15/02/2028	USD	158.644,58	0,25	150.000	ORANGE SA FRN PERP	EUR	160.226,78	0,25
562.000	MERCK & CO INC 1.700% 10/06/2027	USD	478.532,30	0,75	250.000	ORANGE SA FRN PERP EMTN	EUR	278.799,82	0,44
210.000	MILLENNIUM ESCROW CORP 6.625% 01/08/2026	USD	178.772,47	0,28	200.000	PAPREC HOLDING SA 3.500% 01/07/2028	EUR	190.562,50	0,30
150.000	MORGAN STANLEY 1.875% 30/03/2023	EUR	152.854,13	0,24	200.000	PICARD GROUPE SAS 3.875% 01/07/2026	EUR	194.052,05	0,30
800.000	MORGAN STANLEY 22/01/2025 FRN GMTN	USD	690.288,80	1,08	300.000	PSA BANQUE FRANCE SA 0.625% 21/06/2024	EUR	297.717,76	0,45
150.000	NAVIENT CORP 5.000% 15/03/2027	USD	128.926,71	0,20	150.000	PSA BANQUE FRANCE SA 0.750% 19/04/2023 EMTN	EUR	150.683,13	0,24
150.000	NETFLIX INC 3.625% 15/06/2030	EUR	158.646,45	0,25	202.000	QUATRIM SASU 5.875% 15/01/2024	EUR	201.824,32	0,32
250.000	NEXTERA ENERGY OPERATING PARTNERS LP 4.500% 15/09/2027	USD	223.952,95	0,35	100.000	SPIE SA 2.625% 18/06/2026	EUR	99.334,91	0,16
700.000	NUCOR CORP 2.000% 01/06/2025	USD	609.838,30	0,95	<b>4.611.655,06 7,20</b>				
500.000	ORACLE CORP 2.950% 15/11/2024	USD	446.985,56	0,70	<b>Niederlande</b>				
					550.000	ALLIANDER NV FRN PERP	EUR	544.405,13	0,85
					455.000	ARGENTUM NETHERLANDS BV FOR SWISS RE LTD 15/08/2050 FRN	USD	421.075,47	0,66
					400.000	CONTI-GUMMI FINANCE BV 2.125% 27/11/2023 EMTN	EUR	409.136,22	0,64
					100.000	CTP NV 0.625% 27/09/2026 EMTN	EUR	90.940,15	0,14
					200.000	CTP NV 0.625% 27/11/2023 EMTN	EUR	197.736,56	0,31
					200.000	DE VOLKSBANK NV 22/10/2030 FRN EMTN	EUR	197.091,52	0,31

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.



## NN (L) First Class Stable Yield Opportunities

(ausgedrückt in EUR)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW	Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
300.000	MEXICO GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.750% 11/01/2028	USD	274.618,01	0,42	200.000	KASIKORNBANK PCL/HONG KONG FRN PERP EMTN	USD	175.443,76	0,27
200.000	MEXICO GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.150% 28/03/2027	USD	189.439,26	0,30	200.000	TMBTHANACHART BANK PCL FRN PERP EMTN	USD	171.605,11	0,28
200.000	TRUST FIBRA UNO 5.250% 15/12/2024	USD	185.282,97	0,29				<b>522.640,26</b>	<b>0,82</b>
			<b>923.427,38</b>	<b>1,44</b>		<b>Island</b>			
	<b>Kolumbien</b>				150.000	ISLANDSBANKI HF 19/01/2024 FRN GMTN	EUR	150.439,41	0,23
200.000	BANCO DE BOGOTA SA 6.250% 12/05/2026	USD	183.501,76	0,29	305.000	LANDSBANKINN HF 1.000% 30/05/2023 EMTN	EUR	305.307,67	0,48
200.000	BANCOLOMBIA SA 3.000% 29/01/2025	USD	174.628,27	0,27				<b>455.747,08</b>	<b>0,71</b>
400.000	COLOMBIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.875% 25/04/2027	USD	345.955,57	0,54		<b>Brasilien</b>			
200.000	COLOMBIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.500% 28/01/2026	USD	179.650,88	0,28	500.000	BRAZILIAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.875% 12/06/2030	USD	415.138,54	0,65
			<b>883.736,48</b>	<b>1,38</b>				<b>415.138,54</b>	<b>0,65</b>
	<b>Dominikanische Republik</b>					<b>Marokko</b>			
300.000	AEROPUERTOS DOMINICANOS SIGLO XXI SA 6.750% 30/03/2029	USD	260.588,84	0,41	500.000	MOROCCO GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 2.375% 15/12/2027	USD	410.707,95	0,64
500.000	DOMINICAN REPUBLIC INTERNATIONAL BOND 6.000% 19/07/2028	USD	457.071,08	0,71				<b>410.707,95</b>	<b>0,64</b>
			<b>717.659,92</b>	<b>1,12</b>		<b>Jungferninseln</b>			
	<b>Kanada</b>				300.000	DIANJIAN HAIYU LTD FRN PERP EMTN	USD	268.956,13	0,42
326.000	BAUSCH HEALTH COS INC 6.125% 15/04/2025	USD	295.283,64	0,46	200.000	NEW METRO GLOBAL LTD 4.625% 15/10/2025	USD	115.729,06	0,18
405.000	FAIRFAX FINANCIAL HOLDINGS LTD 2.750% 29/03/2028	EUR	407.313,93	0,64				<b>384.685,19</b>	<b>0,60</b>
			<b>702.597,57</b>	<b>1,10</b>		<b>Peru</b>			
	<b>Jersey</b>				400.000	PERUVIAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.125% 25/08/2027	USD	373.695,83	0,58
200.000	ADIENT GLOBAL HOLDINGS LTD 4.875% 15/08/2026	USD	172.623,72	0,27				<b>373.695,83</b>	<b>0,58</b>
450.000	APTIV PLC 1.500% 10/03/2025	EUR	450.529,79	0,70		<b>Supranational-Multinational</b>			
			<b>623.153,51</b>	<b>0,97</b>	150.000	ARDAGH PACKAGING FINANCE PLC / ARDAGH HOLDINGS USA INC 2.125% 15/08/2026	EUR	141.026,81	0,22
	<b>Bermuda</b>				250.000	BANQUE QUEST AFRICAINE DE DEVELOPPEMENT 4.700% 22/10/2031	USD	221.815,41	0,34
700.000	AIRCASTLE LTD 4.250% 15/06/2026	USD	620.411,72	0,97				<b>362.842,22</b>	<b>0,56</b>
			<b>620.411,72</b>	<b>0,97</b>		<b>Jordanien</b>			
	<b>Indien</b>				200.000	JORDAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.850% 07/07/2030	USD	168.074,01	0,27
300.000	BHARTI AIRTEL LTD 3.250% 03/06/2031	USD	248.823,89	0,38	200.000	JORDAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.125% 29/01/2026	USD	181.264,33	0,28
200.000	EXPORT-IMPORT BANK OF INDIA 3.375% 05/08/2026	USD	176.160,64	0,28				<b>349.338,34</b>	<b>0,55</b>
200.000	EXPORT-IMPORT BANK OF INDIA 3.875% 01/02/2028	USD	178.071,75	0,28		<b>Indonesien</b>			
			<b>603.056,28</b>	<b>0,94</b>	200.000	INDONESIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 2.150% 28/07/2031	USD	166.576,30	0,26
	<b>Oman</b>				200.000	PERUSAHAAN PENERBIT SBSN INDONESIA III 2.300% 23/06/2025	USD	177.061,92	0,28
200.000	OMAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.875% 01/02/2025 EMTN	USD	183.352,69	0,29				<b>343.638,22</b>	<b>0,54</b>
400.000	OMAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.750% 28/10/2027	USD	391.142,49	0,61		<b>Georgien</b>			
			<b>574.495,18</b>	<b>0,90</b>	200.000	GEORGIA INTERNATIONAL BOND 2.750% 22/04/2026	USD	153.865,61	0,24
	<b>Südkorea</b>				200.000	TBC BANK JSC 5.750% 19/06/2024 EMTN	USD	185.428,93	0,29
300.000	HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD FRN PERP	USD	272.543,77	0,42				<b>339.294,54</b>	<b>0,53</b>
300.000	HEUNGKUK LIFE INSURANCE CO LTD FRN PERP	USD	268.278,43	0,42		<b>Israel</b>			
			<b>540.822,20</b>	<b>0,84</b>	400.000	BANK HAPOALIM BM 21/01/2032 FRN	USD	331.916,93	0,52
	<b>Paraguay</b>							<b>331.916,93</b>	<b>0,52</b>
200.000	BANCO CONTINENTAL SAECA 2.750% 10/12/2025	USD	164.611,68	0,26		<b>Rumänien</b>			
400.000	PARAGUAY GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.000% 15/04/2026	USD	375.025,86	0,58	300.000	ROMANIAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 2.875% 26/05/2028	EUR	294.869,39	0,46
			<b>539.637,54</b>	<b>0,84</b>				<b>294.869,39</b>	<b>0,46</b>
	<b>Thailand</b>								
200.000	BANGKOK BANK PCL/HONG KONG FRN PERP EMTN	USD	175.591,39	0,27					

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) First Class Stable Yield Opportunities

(ausgedrückt in EUR)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
<b>Türkei</b>				
300.000	AKBANK TAS 5.000% 24/10/2022	USD	270.913,81	0,42
			<b>270.913,81</b>	<b>0,42</b>
<b>Hongkong</b>				
300.000	SHANGHAI COMMERCIAL BANK LTD 29/11/2027 FRN	USD	269.697,79	0,42
			<b>269.697,79</b>	<b>0,42</b>
<b>Schweiz</b>				
280.000	UBS AG/LONDON 0.010% 31/03/2026 EMTN	EUR	267.131,10	0,42
			<b>267.131,10</b>	<b>0,42</b>
<b>Malaysia</b>				
250.000	MALAYSIA WAKALA SUKUK BHD 2.070% 28/04/2031	USD	209.853,43	0,33
			<b>209.853,43</b>	<b>0,33</b>
<b>Bahamas</b>				
250.000	INTERCORP PERU LTD 3.875% 15/08/2029	USD	204.013,15	0,32
			<b>204.013,15</b>	<b>0,32</b>
<b>Belgien</b>				
200.000	KBC GROUP NV 03/12/2029 FRN EMTN	EUR	192.067,37	0,30
			<b>192.067,37</b>	<b>0,30</b>
<b>Mauritius</b>				
200.000	HTA GROUP LTD 7.000% 18/12/2025	USD	178.324,04	0,28
			<b>178.324,04</b>	<b>0,28</b>
<b>Chile</b>				
200.000	CHILE GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 2.450% 31/01/2031	USD	168.252,98	0,26
			<b>168.252,98</b>	<b>0,26</b>
<b>Aserbaidshjan</b>				
200.000	REPUBLIC OF AZERBAIJAN INTERNATIONAL BOND 3.500% 01/09/2032	USD	167.536,75	0,26
			<b>167.536,75</b>	<b>0,26</b>
<b>Panama</b>				
175.000	CARNIVAL CORP 4.000% 01/08/2028	USD	146.605,47	0,23
			<b>146.605,47</b>	<b>0,23</b>
<b>Liberia</b>				
150.000	ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD 5.500% 01/04/2028	USD	128.818,07	0,20
			<b>128.818,07</b>	<b>0,20</b>
<b>Österreich</b>				
100.000	AMS-OSRAM AG 6.000% 31/07/2025	EUR	102.578,36	0,16
			<b>102.578,36</b>	<b>0,16</b>
<b>Südafrika</b>				
710.534	K2016470219 SOUTH AFRICA LTD 8.000% 31/12/2022	EUR	1.648,45	0,00
			<b>1.648,45</b>	<b>0,00</b>
			<b>60.207.171,42</b>	<b>93,99</b>

### Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente

<b>Aktien</b>				
<b>Südafrika</b>				
347.110	HOLDCO 2 ORDINARY B SHARES	USD	0,00	0,00
			<b>0,00</b>	<b>0,00</b>
			<b>0,00</b>	<b>0,00</b>
<b>Anleihen und andere Schuldtitel</b>				
<b>Südafrika</b>				
118.361	K2016470260 SOUTH AFRICA LTD 25.000% 31/12/2022	USD	20,26	0,00
			<b>20,26</b>	<b>0,00</b>
			<b>20,26</b>	<b>0,00</b>
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>			<b>60.207.191,68</b>	<b>93,99</b>

### Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022

Bezeichnung	Verkauf / Kauf	Zinssatz (%)	Fälligkeits- datum	Währung	Nennwert	Swap-Wert in EUR
<b>Credit Default Swaps</b>						
CDX ITRAXX EUROPE CROSSOVER SERIES 37 VERSION 1	Verkauf	5,000	20/06/2027	EUR	700.000,00	51.039,28
CDX ITRAXX EUROPE SERIES 37 VERSION 1	Verkauf	1,000	20/06/2027	EUR	3.100.000,00	42.366,65
						<b>93.405,93</b>
Zu erhalten (%)	Zu zahlen (%)	Fälligkeits- datum	Währung	Nennwert	Swap-Wert in EUR	
<b>Zinsswap</b>						
-0,093	Floating	23/11/2026	EUR	1.500.000,00	(71.983,21)	
					<b>(71.983,21)</b>	
Zu erhalten	Zu zahlen	Fälligkeits- datum	Engagement in EUR	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR		
<b>Devisentermingeschäfte</b>						
34.997.815,69	EUR	38.842.639,07	USD	30/06/2022	34.997.815,69	211.566,38
1.296.234,71	EUR	1.096.834,41	GBP	30/06/2022	1.296.234,71	3.249,23
715.937,72	PLN	151.293,87	EUR	19/04/2022	151.293,87	2.833,35

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) First Class Stable Yield Opportunities

(ausgedrückt in EUR)

### Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Zu erhalten	Zu zahlen	Fälligkeits- datum	Engagement in EUR	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR
31.999,53 EUR	44.311,12 CAD	30/06/2022	31.999,53	235,81
12.861,58 EUR	19.000,00 AUD	30/06/2022	12.861,58	63,02
1.666,87 USD	1.493,41 EUR	19/04/2022	1.493,41	4,05
36,92 EUR	40,21 USD	19/04/2022	36,92	0,80
518.826,34 USD	464.672,17 EUR	30/06/2022	464.672,17	(27,57)
5.161,48 EUR	24.435,29 PLN	19/04/2022	5.161,48	(98,95)
			<b>36.961.569,36</b>	<b>217.826,12</b>

Stückzahl	Bezeich- nung	Währung	Engagement in EUR	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR
<b>Zins-Futures</b>				
(10)	EURO-BOBL FUTURE 08/06/2022	EUR	1.288.600,00	45.165,61
4	EURO-BUND FUTURE 08/06/2022	EUR	634.640,00	(21.571,59)
7	LONG GILT FUTURE 28/06/2022	GBP	1.004.199,24	(8.697,59)
(2)	US LONG BOND (CBT) 21/06/2022	USD	269.738,91	7.695,59
(35)	US 10YR NOTE (CBT) 21/06/2022	USD	3.865.209,19	93.035,25
59	US 2YR NOTE (CBT) 30/06/2022	USD	11.237.487,70	(144.580,17)
13	US 5YR NOTE (CBT) 30/06/2022	USD	1.339.987,87	2.941,05
			<b>19.639.862,91</b>	<b>(26.011,85)</b>

**Derivative Finanzinstrumente Gesamt 213.236,99**

### Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick

		% NIW
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	<b>60.207.191,68</b>	<b>93,99</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	<b>213.236,99</b>	<b>0,33</b>
<b>Bankguthaben</b>	<b>2.693.360,27</b>	<b>4,20</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>	<b>940.834,83</b>	<b>1,48</b>
<b>Nettovermögen Gesamt</b>	<b>64.054.623,77</b>	<b>100,00</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.



## NN (L) First Class Yield Opportunities

(ausgedrückt in EUR)

### Statistische Angaben

<b>Nettovermögen</b>	31.03.2022	EUR	363.076.866,49	Distribution X (M) Hedged (i) (USD)	31.03.2022	USD	216,82
	30.09.2021	EUR	433.023.516,85		30.09.2021	USD	242,32
	30.09.2020	EUR	444.952.449,35		30.09.2020	USD	247,64
<b>Nettoinventarwert pro Anteil**</b>				Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR)	31.03.2022	ZAR	4.239,91
					30.09.2021	ZAR	4.791,15
					30.09.2020	ZAR	4.977,51
Capitalisation I (EUR)	31.03.2022	EUR	5.150,12	Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD)	31.03.2022	AUD	343,37
	30.09.2021	EUR	5.540,42		30.09.2021	AUD	386,75
	30.09.2020	EUR	5.250,30		30.09.2020	AUD	396,50
Capitalisation I Hedged (i) (PLN)	31.03.2022	PLN	23.845,99	Distribution Y (M) Hedged (i) (USD)	31.03.2022	USD	215,87
	30.09.2021	PLN	25.332,09		30.09.2021	USD	242,52
	30.09.2020	PLN	23.879,11		30.09.2020	USD	247,64
Capitalisation I Hedged (i) (USD)	31.03.2022	USD	5.372,36	Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR)	31.03.2022	ZAR	4.194,07
	30.09.2021	USD	5.743,39		30.09.2021	ZAR	4.763,86
	30.09.2020	USD	5.395,12		30.09.2020	ZAR	4.977,51
Capitalisation N (EUR)	31.03.2022	EUR	26,71	<b>Anzahl der Anteile</b>			
	30.09.2021	EUR	28,74		Capitalisation I (EUR)	31.03.2022	36.395
	30.09.2020	EUR	27,23		30.09.2021	36.219	
Capitalisation P (EUR)	31.03.2022	EUR	266,87	30.09.2020	54.093		
	30.09.2021	EUR	287,71	Capitalisation I Hedged (i) (PLN)	31.03.2022	7.515	
	30.09.2020	EUR	273,84	30.09.2021	6.400		
Capitalisation X Hedged (i) (CZK)	31.03.2022	CZK	4.967,79	30.09.2020	4.525		
	30.09.2021	CZK	5.278,52	Capitalisation I Hedged (i) (USD)	31.03.2022	0,78	
	30.09.2020	CZK	5.013,63	30.09.2021	0,78		
Capitalisation X Hedged (i) (USD)	31.03.2022	USD	241,12	30.09.2020	9		
	30.09.2021	USD	259,10	Capitalisation N (EUR)	31.03.2022	283	
	30.09.2020	USD	245,06	30.09.2021	1.399		
Capitalisation Y Hedged (i) (USD)	31.03.2022	USD	242,08	30.09.2020	2.503		
	30.09.2021	USD	261,25	Capitalisation P (EUR)	31.03.2022	12.247	
	30.09.2020	USD	247,64	30.09.2021	12.497		
Capitalisation Z (EUR)	31.03.2022	EUR	5.863,65	30.09.2020	15.227		
	30.09.2021	EUR	6.289,19	Capitalisation X Hedged (i) (CZK)	31.03.2022	32.232	
	30.09.2020	EUR	5.924,18	30.09.2021	37.234		
Capitalisation Zz (EUR)	31.03.2022	EUR	5.363,81	30.09.2020	40.138		
	30.09.2021	EUR	5.748,68	Capitalisation X Hedged (i) (USD)	31.03.2022	6.081	
	30.09.2020	EUR	5.407,03	30.09.2021	2.974		
Distribution N (EUR)	31.03.2022	EUR	19,79	30.09.2020	3.541		
	30.09.2021	EUR	22,04	Capitalisation Y Hedged (i) (USD)	31.03.2022	14.910	
	30.09.2020	EUR	21,61	30.09.2021	18.905		
Distribution P (EUR)	31.03.2022	EUR	203,14	30.09.2020	0,68		
	30.09.2021	EUR	221,22	Capitalisation Z (EUR)	31.03.2022	8.982	
	30.09.2020	EUR	214,49	30.09.2021	9.603		
Distribution X (M) Hedged (i) (AUD)	31.03.2022	AUD	345,37	30.09.2020	18.612		
	30.09.2021	AUD	386,73				
	30.09.2020	AUD	396,50				

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

## NN (L) First Class Yield Opportunities

(ausgedrückt in EUR)

### Statistische Angaben (Fortsetzung)

#### Anzahl der Anteile

Capitalisation Zz (EUR)	31.03.2022	7.575	Distribution X (M) Hedged (i) (USD)	02.03.2022	USD	1,56
	30.09.2021	15.489	Distribution X (M) Hedged (i) (USD)	02.02.2022	USD	1,56
	30.09.2020	2.614	Distribution X (M) Hedged (i) (USD)	04.01.2022	USD	1,56
Distribution N (EUR)	31.03.2022	12.474	Distribution X (M) Hedged (i) (USD)	02.12.2021	USD	1,56
	30.09.2021	16.987	Distribution X (M) Hedged (i) (USD)	02.11.2021	USD	1,56
	30.09.2020	12.045	Distribution X (M) Hedged (i) (USD)	04.10.2021	USD	1,56
Distribution P (EUR)	31.03.2022	44	Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR)	02.03.2022	ZAR	56,42
	30.09.2021	44	Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR)	02.02.2022	ZAR	56,42
	30.09.2020	44	Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR)	04.01.2022	ZAR	56,42
Distribution X (M) Hedged (i) (AUD)	31.03.2022	1.984	Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR)	02.12.2021	ZAR	56,42
	30.09.2021	1.251	Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR)	02.11.2021	ZAR	56,42
	30.09.2020	0,59	Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR)	04.10.2021	ZAR	56,42
Distribution X (M) Hedged (i) (USD)	31.03.2022	17.547	Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD)	02.03.2022	AUD	2,50
	30.09.2021	18.542	Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD)	02.02.2022	AUD	2,50
	30.09.2020	0,68	Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD)	04.01.2022	AUD	2,50
Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR)	31.03.2022	5.771	Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD)	02.12.2021	AUD	2,50
	30.09.2021	4.300	Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD)	02.11.2021	AUD	2,50
	30.09.2020	0,59	Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD)	04.10.2021	AUD	2,50
Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD)	31.03.2022	8.148	Distribution Y (M) Hedged (i) (USD)	02.03.2022	USD	1,56
	30.09.2021	7.208	Distribution Y (M) Hedged (i) (USD)	02.02.2022	USD	1,56
	30.09.2020	0,59	Distribution Y (M) Hedged (i) (USD)	04.01.2022	USD	1,56
Distribution Y (M) Hedged (i) (USD)	31.03.2022	87.010	Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR)	02.03.2022	ZAR	56,42
	30.09.2021	94.187	Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR)	02.02.2022	ZAR	56,42
	30.09.2020	21	Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR)	04.01.2022	ZAR	56,42
Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR)	31.03.2022	18.926	Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR)	04.01.2022	ZAR	56,42
	30.09.2021	15.298	Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR)	02.12.2021	ZAR	56,42
	30.09.2020	0,59	Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR)	02.11.2021	ZAR	56,42
<b>Dividende</b>			Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR)	02.12.2021	ZAR	56,42
	Distribution N (EUR)	14.12.2021	EUR	0,75		
	Distribution P (EUR)	14.12.2021	EUR	2,20		
	Distribution X (M) Hedged (i) (AUD)	02.03.2022	AUD	2,50		
	Distribution X (M) Hedged (i) (AUD)	02.02.2022	AUD	2,50		
	Distribution X (M) Hedged (i) (AUD)	04.01.2022	AUD	2,50		
	Distribution X (M) Hedged (i) (AUD)	02.12.2021	AUD	2,50		
	Distribution X (M) Hedged (i) (AUD)	02.11.2021	AUD	2,50		
	Distribution X (M) Hedged (i) (AUD)	04.10.2021	AUD	2,50		
	Distribution X (M) Hedged (i) (AUD)	02.03.2022	AUD	2,50		
	Distribution X (M) Hedged (i) (AUD)	02.02.2022	AUD	2,50		
	Distribution X (M) Hedged (i) (AUD)	04.01.2022	AUD	2,50		
	Distribution X (M) Hedged (i) (AUD)	02.12.2021	AUD	2,50		
	Distribution X (M) Hedged (i) (AUD)	02.11.2021	AUD	2,50		
	Distribution X (M) Hedged (i) (AUD)	04.10.2021	AUD	2,50		

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

## NN (L) First Class Yield Opportunities

(ausgedrückt in EUR)

### Statistische Angaben (Fortsetzung)

Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR)	02.11.2021	ZAR	56,42
Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR)	04.10.2021	ZAR	56,42
<b>Laufende Kosten in %*</b>			
Capitalisation I (EUR)	31.03.2022		0,77%
Capitalisation I Hedged (i) (PLN)	31.03.2022		0,79%
Capitalisation I Hedged (i) (USD)	31.03.2022		0,77%
Capitalisation N (EUR)	31.03.2022		0,75%
Capitalisation P (EUR)	31.03.2022		1,20%
Capitalisation X Hedged (i) (CZK)	31.03.2022		1,53%
Capitalisation X Hedged (i) (USD)	31.03.2022		1,52%
Capitalisation Y Hedged (i) (USD)	31.03.2022		1,53%
Capitalisation Z (EUR)	31.03.2022		0,17%
Capitalisation Zz (EUR)	31.03.2022		0,02%
Distribution N (EUR)	31.03.2022		0,75%
Distribution P (EUR)	31.03.2022		1,20%
Distribution X (M) Hedged (i) (AUD)	31.03.2022		1,53%
Distribution X (M) Hedged (i) (USD)	31.03.2022		1,53%
Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR)	31.03.2022		1,53%
Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD)	31.03.2022		1,53%
Distribution Y (M) Hedged (i) (USD)	31.03.2022		1,53%
Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR)	31.03.2022		1,53%
<b>Portfolioumsatz in %*</b>	31.03.2022		42,05%

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

## NN (L) First Class Yield Opportunities

(ausgedrückt in EUR)

### Finanzabschlüsse

#### Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022

	Erläuterungen	
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	2	<b>332.976.610,05</b>
Organismen für gemeinsame Anlagen		34.368.910,18
Anleihen und andere Schuldtitel		298.607.699,87
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	2	<b>2.815.636,33</b>
Credit Default Swaps		31.933,85
Devisentermingeschäfte		2.783.702,48
<b>Bankguthaben</b>		<b>27.243.821,53</b>
<b>Hinterlegte Sicherheiten</b>		<b>826.036,58</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte</b>	4, 12	<b>13.218.584,27</b>
<b>Vermögenswerte Gesamt</b>		<b>377.080.688,76</b>
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>	4, 12	<b>(12.699.166,89)</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	2	<b>(1.304.655,38)</b>
Zinsswaps		(1.007.765,01)
Futures		(296.890,37)
<b>Verbindlichkeiten Gesamt</b>		<b>(14.003.822,27)</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Berichtszeitraums</b>		<b>363.076.866,49</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) First Class Yield Opportunities

(ausgedrückt in EUR)

## Wertpapierbestand zum 31.03.2022

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW	Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
<b>Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>									
<b>Anleihen und andere Schuldtitel</b>									
<b>Vereinigte Staaten</b>									
300.000	AIR LEASE CORP 3.625% 01/04/2027	USD	264.459,25	0,07	750.000	FORD MOTOR CREDIT CO LLC 2.386% 17/02/2026	EUR	735.372,37	0,20
1.500.000	ALBERTSONS COS INC / SAFEWAY INC / NEW ALBERTSONS LP / ALBERTSONS LLC 3.500% 15/03/2029	USD	1.216.993,02	0,34	1.500.000	FORD MOTOR CREDIT CO LLC 4.000% 13/11/2030	USD	1.268.634,06	0,35
1.263.000	ALLIED UNIVERSAL HOLDCO LLC / ALLIED UNIVERSAL FINANCE CORP 6.625% 15/07/2026	USD	1.149.391,19	0,32	1.750.000	FREEMONT-MCMORAN INC 4.625% 01/08/2030	USD	1.607.975,32	0,44
1.000.000	AMAZON.COM INC 3.100% 12/05/2051	USD	844.219,94	0,23	2.000.000	GOLDMAN SACHS GROUP INC 27/01/2032 FRN	USD	1.556.758,80	0,43
1.685.000	AMERICAN AIRLINES INC 11.750% 15/07/2025	USD	1.768.895,62	0,49	1.531.000	HCA INC 3.500% 01/09/2030	USD	1.328.313,35	0,37
2.000.000	AMERICAN TOWER CORP 3.950% 15/03/2029	USD	1.805.887,89	0,50	1.000.000	HOWARD MIDSTREAM ENERGY PARTNERS LLC 6.750% 15/01/2027	USD	882.010,74	0,24
1.711.000	ANTERO MIDSTREAM PARTNERS LP / ANTERO MIDSTREAM FINANCE CORP 5.750% 01/03/2027	USD	1.567.795,07	0,43	1.250.000	HUB INTERNATIONAL LTD 7.000% 01/05/2026	USD	1.137.232,90	0,31
800.000	ARCHROCK PARTNERS LP / ARCHROCK PARTNERS FINANCE CORP 6.250% 01/04/2028	USD	709.278,87	0,20	1.600.000	IHEARTCOMMUNICATIONS INC 4.750% 15/01/2028	USD	1.376.387,07	0,38
1.700.000	ARROW BIDCO LLC 9.500% 15/03/2024	USD	1.557.258,26	0,43	2.111.000	IMOLA MERGER CORP 4.750% 15/05/2029	USD	1.826.986,40	0,50
1.000.000	AT&T INC 4.850% 01/03/2039	USD	978.600,99	0,27	2.000.000	JPMORGAN CHASE & CO 13/05/2031 FRN	USD	1.685.249,07	0,46
2.000.000	BANK OF AMERICA CORP 29/04/2031 FRN	USD	1.660.472,03	0,46	1.215.000	KOSMOS ENERGY LTD 7.125% 04/04/2026	USD	1.072.660,59	0,30
1.600.000	BAUSCH HEALTH AMERICAS INC 8.500% 31/01/2027	USD	1.433.804,07	0,39	1.750.000	LAREDO PETROLEUM INC 7.750% 31/07/2029	USD	1.582.345,85	0,44
1.200.000	BAXTER INTERNATIONAL INC 2.539% 01/02/2032	USD	986.208,83	0,27	200.000	LENNAR CORP 4.750% 29/11/2027	USD	187.428,24	0,05
700.000	BLUE RACER MIDSTREAM LLC / BLUE RACER FINANCE CORP 7.625% 15/12/2025	USD	659.044,31	0,18	1.250.000	MARSH & MCLENNAN COS INC 2.375% 15/12/2031	USD	1.029.932,89	0,28
3.600.000	BOARDWALK PIPELINES LP 4.450% 15/07/2027	USD	3.308.483,67	0,92	2.000.000	MATADOR RESOURCES CO 5.875% 15/09/2026	USD	1.831.468,62	0,50
2.300.000	BRIXMOR OPERATING PARTNERSHIP LP 4.050% 01/07/2030	USD	2.073.512,75	0,57	1.000.000	MATTEL INC 3.750% 01/04/2029	USD	864.269,78	0,24
1.000.000	BROADCOM INC 3.187% 15/11/2036	USD	789.761,02	0,22	750.000	MATTEL INC 6.200% 01/10/2040	USD	775.726,98	0,21
1.000.000	BROADCOM INC 3.419% 15/04/2033	USD	838.731,68	0,23	388.000	MERCK & CO INC 1.700% 10/06/2027	USD	330.374,61	0,09
2.000.000	BROWN & BROWN INC 2.375% 15/03/2031	USD	1.582.614,16	0,44	775.000	MERCK & CO INC 2.150% 10/12/2031	USD	645.411,57	0,18
1.144.000	CARGO AIRCRAFT MANAGEMENT INC 4.750% 01/02/2028	USD	1.002.380,85	0,28	600.000	MERCURY CHILE HOLDCO LLC 6.500% 24/01/2027	USD	516.257,67	0,14
1.000.000	CDW LLC / CDW FINANCE CORP 3.569% 01/12/2031	USD	835.066,45	0,23	1.750.000	MILLENNIUM ESCROW CORP 6.625% 01/08/2026	USD	1.489.770,62	0,41
238.000	CENTENE CORP 2.450% 15/07/2028	USD	195.422,99	0,05	1.500.000	MPLX LP 4.700% 15/04/2048	USD	1.359.063,68	0,37
1.774.000	CENTENE CORP 2.500% 01/03/2031	USD	1.411.820,25	0,39	300.000	NBM US HOLDINGS INC 6.625% 06/08/2029	USD	283.432,34	0,08
950.000	CENTENE CORP 3.375% 15/02/2030	USD	804.225,96	0,22	1.265.000	NOKIA OF AMERICA CORP 6.450% 15/03/2029	USD	1.192.201,51	0,33
550.000	CENTENNIAL RESOURCE PRODUCTION LLC 5.375% 15/01/2026	USD	480.336,75	0,13	527.000	PITNEY BOWES INC 6.875% 15/03/2027	USD	448.493,05	0,12
340.000	CENTENNIAL RESOURCE PRODUCTION LLC 6.875% 01/04/2027	USD	306.924,50	0,08	337.000	PITNEY BOWES INC 7.250% 15/03/2029	USD	285.979,46	0,08
1.350.000	CHARTER COMMUNICATIONS OPERATING LLC / CHARTER COMMUNICATIONS OPERATING CAPITAL 6.384% 23/10/2035	USD	1.378.735,99	0,38	1.500.000	PLAINS ALL AMERICAN PIPELINE LP / PAA FINANCE CORP 4.900% 15/02/2045	USD	1.290.396,78	0,36
1.200.000	CHEMOURS CO/THE 4.000% 15/05/2026	EUR	1.154.978,35	0,32	1.300.000	RAIN CII CARBON LLC / CII CARBON CORP 7.250% 01/04/2025	USD	1.148.223,54	0,32
1.500.000	CITIGROUP INC 20/03/2030 FRN	USD	1.372.358,37	0,38	900.000	RANGE RESOURCES CORP 8.250% 15/01/2029	USD	886.368,93	0,24
500.000	CITIGROUP INC 29/01/2031 FRN	USD	417.457,32	0,11	200.000	RESORTS WORLD LAS VEGAS LLC / RWLV CAPITAL INC 4.625% 16/04/2029	USD	162.849,51	0,04
2.500.000	CITIZENS FINANCIAL GROUP INC 3.250% 30/04/2030	USD	2.194.008,79	0,60	1.816.000	SIZZLING PLATTER LLC / SIZZLING PLATTER FINANCE CORP 8.500% 28/11/2025	USD	1.502.673,27	0,41
1.773.000	CLARIVATE SCIENCE HOLDINGS CORP 3.875% 01/07/2028	USD	1.516.858,03	0,42	1.313.000	S&P GLOBAL INC 2.900% 01/03/2032	USD	1.145.173,77	0,32
1.025.000	CLEARWAY ENERGY OPERATING LLC 4.750% 15/03/2028	USD	925.819,01	0,25	1.643.000	STAPLES INC 7.500% 15/04/2026	USD	1.433.262,59	0,39
1.800.000	CLEVELAND-CLIFFS INC 4.875% 01/03/2031	USD	1.599.429,09	0,44	800.000	STILLWATER MINING CO 4.000% 16/11/2026	USD	691.171,64	0,19
1.850.000	COMSTOCK RESOURCES INC 5.875% 15/01/2030	USD	1.637.789,98	0,45	2.065.000	SUNCOKE ENERGY INC 4.875% 30/06/2029	USD	1.751.113,69	0,48
250.000	COTY INC 4.750% 15/04/2026	EUR	239.798,67	0,07	547.000	TENET HEALTHCARE CORP 4.250% 01/06/2029	USD	472.821,55	0,13
1.000.000	CVS HEALTH CORP 4.300% 25/03/2028	USD	942.166,02	0,26	1.000.000	TENET HEALTHCARE CORP 4.375% 15/01/2030	USD	863.492,79	0,24
1.200.000	DAE FUNDING LLC 3.375% 20/03/2028	USD	1.012.181,00	0,28	893.000	T-MOBILE USA INC 2.625% 15/02/2029	USD	732.886,36	0,20
1.650.000	DELL INTERNATIONAL LLC / EMC CORP 5.300% 01/10/2029	USD	1.615.314,66	0,44	383.000	T-MOBILE USA INC 2.875% 15/02/2031	USD	310.437,57	0,09
960.000	DELL INTERNATIONAL LLC / EMC CORP 6.020% 15/06/2026	USD	936.162,21	0,26	2.000.000	T-MOBILE USA INC 3.000% 15/02/2041	USD	1.518.668,35	0,42
3.250.000	DIAMONDBACK ENERGY INC 3.125% 24/03/2031	USD	2.790.364,91	0,78	325.000	T-MOBILE USA INC 3.500% 15/04/2031	USD	275.029,75	0,08
750.000	DIEBOLD NIXDORF INC 8.500% 15/04/2024	USD	650.321,78	0,18	1.750.000	UNIVISION COMMUNICATIONS INC 4.500% 01/05/2029	USD	1.497.140,58	0,41
1.887.000	ENDEAVOR ENERGY RESOURCES LP / EER FINANCE INC 5.750% 30/01/2028	USD	1.749.868,57	0,48	1.488.000	VALLEY NATIONAL BANCORP 15/06/2031 FRN	USD	1.278.037,99	0,35
1.000.000	EQUINIX INC 3.200% 18/11/2029	USD	863.477,02	0,24	1.000.000	VMWARE INC 4.700% 15/05/2030	USD	949.921,18	0,26
					1.291.000	WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC 4.100% 15/04/2050	USD	1.122.936,55	0,31
					800.000	WORKDAY INC 3.500% 01/04/2027	USD	721.144,79	0,20
					500.000	W&T OFFSHORE INC 9.750% 01/11/2023	USD	445.936,72	0,12
								<b>100.728.105,58</b>	<b>27,74</b>
					<b>Niederlande</b>				
					1.190.000	ALLIANDER NV FRN PERP	EUR	1.177.894,73	0,32
					350.000	ARGENTUM NETHERLANDS BV FOR SWISS RE LTD 15/08/2050 FRN	USD	323.904,21	0,09
					2.430.000	ATRADIUS FINANCE BV 23/09/2044 FRN	EUR	2.569.590,77	0,71
					2.000.000	DIEBOLD NIXDORF DUTCH HOLDING BV 9.000% 15/07/2025	EUR	2.065.838,40	0,57
					325.000	DUTCH PROPERTY FINANCE 2020-1 BV 2020-1 D 28/07/2054 FRN	EUR	319.236,07	0,09

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.



## NN (L) First Class Yield Opportunities

(ausgedrückt in EUR)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW	Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
750.000	TUI CRUISES GMBH 6.500% 15/05/2026	EUR	710.307,13	0,20	2.900.000	ZURICH FINANCE IRELAND DESIGNATED ACTIVITY CO 17/09/2050 FRN EMTN	EUR	2.732.408,01	0,74
			<b>11.102.340,33</b>	<b>3,06</b>				<b>7.675.931,32</b>	<b>2,11</b>
<b>Kanada</b>					<b>Mexiko</b>				
750.000	CANACOL ENERGY LTD 5.750% 24/11/2028	USD	628.001,78	0,17	435.000	BANCO MERCANTIL DEL NORTE SA/GRAND CAYMAN FRN PERP	USD	382.723,75	0,11
750.000	CANADIAN PACIFIC RAILWAY CO 3.000% 02/12/2041	USD	608.446,40	0,17	650.000	BBVA BANCOMER SA/TEXAS 18/01/2033 FRN	USD	550.901,86	0,15
3.085.000	FAIRFAX FINANCIAL HOLDINGS LTD 2.750% 29/03/2028	EUR	3.102.625,84	0,85	695.000	CIBANCO SA INSTITUCION DE BANCA MULTIPLE TRUST CIB/3332 4.375% 22/07/2031	USD	520.280,97	0,14
1.300.000	FIRST QUANTUM MINERALS LTD 7.500% 01/04/2025	USD	1.187.531,56	0,33	900.000	GRUPO KUO SAB DE CV 5.750% 07/07/2027	USD	798.622,31	0,21
600.000	FRONTERA ENERGY CORP 7.875% 21/06/2028	USD	504.305,52	0,14	200.000	MEXICO CITY AIRPORT TRUST 5.500% 31/07/2047	USD	158.549,15	0,04
1.300.000	GARDA WORLD SECURITY CORP 4.625% 15/02/2027	USD	1.119.204,78	0,31	250.000	MEXICO GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.71% 24/05/2061	USD	182.033,32	0,05
1.750.000	HUSKY III HOLDING LTD 13.000% 15/02/2025	USD	1.635.736,65	0,45	150.000	MEXICO GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.000% 15/03/2115	EUR	135.966,26	0,04
2.000.000	TECK RESOURCES LTD 3.900% 15/07/2030	USD	1.794.587,01	0,49	350.000	PETROLEOS MEXICANOS 5.500% 27/06/2044	USD	236.916,16	0,07
			<b>10.580.439,54</b>	<b>2,91</b>	150.000	PETROLEOS MEXICANOS 5.950% 28/01/2031	USD	124.510,99	0,03
<b>Kaimaninseln</b>					<b>Italien</b>				
200.000	AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC 2.625% 02/06/2026	USD	161.488,40	0,04	342.208	ASSET-BACKED EUROPEAN SECURITISATION TRANSACT -17 D 15/04/2032 FRN	EUR	343.263,96	0,09
200.000	ABQ FINANCE 3.125% 24/09/2024 EMTN	USD	178.834,67	0,05	217.861	AUTOFLORENCE 1 SRL 1 D 25/12/2042 FRN	EUR	219.133,39	0,06
650.000	AGILE GROUP HOLDINGS LTD FRN PERP	USD	116.987,17	0,03	300.000	AUTOFLORENCE 2 SRL 2 D 24/12/2044 FRN	EUR	299.990,66	0,08
325.000	ALDAR SUKUK NO 2 LTD 3.875% 22/10/2029	USD	293.467,11	0,08	1.000.000	AUTOSTRADA PER L'ITALIA SPA 2.000% 15/01/2030	EUR	942.819,38	0,26
200.000	CHINA HONGQIAO GROUP LTD 6.250% 08/06/2024	USD	172.751,61	0,05	650.000	BANCA MONTE DEI PASCHI DI SIENA SPA 1.875% 09/01/2026	EUR	589.436,88	0,16
700.000	DP WORLD SALAAM FRN PERP	USD	650.376,59	0,18	250.000	CORDUSIO RMBS 3 D - UBCASA 1 SRL - 3 D 31/12/2042 FRN	EUR	235.590,70	0,06
450.000	EMAAAR SUKUK LTD 3.875% 17/09/2029 EMTN	USD	403.519,88	0,11	500.000	INTESA SANPAOLO SPA FRN PERP EMTN	EUR	495.553,16	0,14
200.000	FANTASIA HOLDINGS GROUP CO LTD 11.875% 01/06/2023	USD	25.802,01	0,01	1.250.000	PRO-GEST SPA 3.250% 15/12/2024	EUR	949.710,19	0,27
1.565.620	GLOBAL AIRCRAFT LEASING CO LTD 6.500% 15/09/2024	USD	1.279.425,70	0,35	500.000	RED & BLACK AUTO ITALY SRL 1 D 28/12/2031 FRN	EUR	478.932,14	0,13
700.000	GRAN TIERRA ENERGY INTERNATIONAL HOLDINGS LTD 6.250% 15/02/2025	USD	582.917,58	0,16				<b>4.554.430,46</b>	<b>1,25</b>
414.000	HILONG HOLDING LTD 9.750% 18/11/2024	USD	230.354,35	0,06	<b>Supranational-Multinational</b>				
200.000	INDUSTRIAL SENIOR TRUST 5.500% 01/11/2022	USD	180.582,38	0,05	570.000	AFRICAN EXPORT-IMPORT BANK/THE 4.125% 20/06/2024 EMTN	USD	511.026,31	0,14
400.000	LINK FINANCE CAYMAN 2009 2.750% 19/01/2032 EMTN	USD	336.801,77	0,09	572.000	ARDAGH METAL PACKAGING FINANCE USA LLC / ARDAGH METAL PACKAGING FINANCE PLC 2.000% 01/09/2028	EUR	527.524,53	0,15
300.000	REDSUN PROPERTIES GROUP LTD 9.500% 20/09/2023	USD	41.136,89	0,01	616.000	ARDAGH METAL PACKAGING FINANCE USA LLC / ARDAGH METAL PACKAGING FINANCE PLC 3.250% 01/09/2028	USD	502.533,01	0,14
1.000.000	SANDS CHINA LTD 4.375% 18/06/2030	USD	817.366,64	0,23	800.000	ATP TOWER HOLDINGS LLC / ANDEAN TOWER PARTNERS COLOMBIA SAS / ANDEAN TELECOM PAR 4.050% 27/04/2026	USD	685.977,84	0,19
600.000	TENCENT HOLDINGS LTD 3.925% 19/01/2038 EMTN	USD	500.907,25	0,14	1.250.000	AXALTA COATING SYSTEMS LLC / AXALTA COATING SYSTEMS DUTCH HOLDING B BV 4.750% 15/06/2027	USD	1.080.874,08	0,30
220.000	WEIBO CORP 1.250% 15/11/2022	USD	191.775,61	0,05	300.000	BANQUE OUEST AFRICAINE DE DEVELOPPEMENT 4.700% 22/10/2031	USD	266.178,50	0,07
600.000	WELL HOPE DEVELOPMENT LTD FRN PERP	USD	540.595,46	0,15	450.000	BLACK SEA TRADE & DEVELOPMENT BANK 3.500% 25/06/2024	USD	364.349,15	0,10
880.000	XLIT LTD 29/06/2047 FRN	EUR	904.184,80	0,25				<b>3.938.463,42</b>	<b>1,09</b>
300.000	YUZHOU GROUP HOLDINGS CO LTD FRN PERP	USD	19.099,49	0,01	<b>Spanien</b>				
300.000	YUZHOU GROUP HOLDINGS CO LTD 7.700% 20/02/2025	USD	35.441,23	0,01	500.000	AI CANDELARIA SPAIN SA 7.500% 15/12/2028	USD	441.371,72	0,12
200.000	ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD 6.630% 07/01/2026	USD	19.780,53	0,01	340.388	AUTONORIA SPAIN 2019-SP D 25/12/2035 FRN	EUR	337.812,98	0,09
			<b>7.683.597,12</b>	<b>2,12</b>	700.000	AUTONORIA SPAIN 2021 FT 2021-SP E 31/01/2039 FRN	EUR	684.022,54	0,19
<b>Irland</b>					<b>Spanien</b>				
170.000	CITIZEN IRISH AUTO RECEIVABLES TRUST 2020-1 D 15/12/2029 FRN	EUR	168.628,18	0,05	400.000	CELLNEX FINANCE CO SA 2.250% 12/04/2026	EUR	397.048,48	0,11
2.000.000	CLOVERIE PLC FOR ZURICH INSURANCE CO LTD 24/06/2046 FRN EMTN	USD	1.887.385,97	0,51					
220.000	CREDIT BANK OF MOSCOW 3.875% 21/09/2026	USD	21.749,88	0,01					
425.000	FINANCE IRELAND RMBS -1 D 24/06/2058 FRN	EUR	425.920,49	0,12					
250.000	HARVEST CLO IX DAC-9X CR 15/02/2030 FRN	EUR	242.534,35	0,07					
149.957	HAUS EUROPEAN LOAN CONDUIT NO 39 DAC 39X D 28/06/2026 FRN	EUR	150.071,61	0,04					
214.000	PRIMROSE RESIDENTIAL 2021-1 DAC 2021-1 D 24/03/2061 FRN	EUR	214.212,50	0,06					
750.000	SOVCOMBANK VIA SOVCOM CAPITAL DAC 07/04/2030 FRN	USD	33.703,32	0,01					
1.312.443	TAURUS 2019-4 FIN DAC 2019-FIN4 B 18/11/2031 FRN	EUR	1.306.407,26	0,36					
500.000	TORO EUROPEAN CLO 4 DAC -1X CRE 15/07/2030 FRN	EUR	492.909,75	0,14					

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.







## NN (L) First Class Yield Opportunities

(ausgedrückt in EUR)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW	Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
<b>Indonesien</b>					200.000	NIGERIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.696% 23/02/2038	USD	157.029,28	0,04
400.000	ALAM SUTERA REALTY TBK 8.250% 02/11/2025	USD	246.052,36	0,07	370.000	NIGERIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 8.250% 28/09/2051 EMTN	USD	290.013,63	0,08
200.000	HUTAMA KARYA PERSERO PT 3.750% 11/05/2030 EMTN	USD	180.176,35	0,05	200.000	NIGERIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 8.375% 24/03/2029 EMTN	USD	181.498,55	0,05
200.000	INDONESIA ASAHAN ALUMINIUM PERSERO PT 5.450% 15/05/2030	USD	187.813,75	0,05	650.000	SEPLAT ENERGY PLC 7.750% 01/04/2026	USD	559.567,83	0,16
200.000	INDONESIA ASAHAN ALUMINIUM PERSERO PT 6.530% 15/11/2028	USD	199.289,69	0,05				<b>1.656.813,98</b>	<b>0,46</b>
200.000	PERTAMINA PERSERO PT 4.700% 30/07/2049 EMTN	USD	178.090,68	0,05	<b>Panama</b>				
450.000	PERUSAHAAN PERSEROAN PERSERO PT PERUSAHAAN LISTRIK NEGARA 4.000% 30/06/2050 EMTN	USD	360.379,77	0,09	217.000	AEROPUERTO INTERNACIONAL DE TOCUMEN SA 5.125% 11/08/2061	USD	177.841,62	0,05
200.000	PERUSAHAAN PERSEROAN PERSERO PT PERUSAHAAN LISTRIK NEGARA 4.375% 05/02/2050 EMTN	USD	165.601,39	0,05	424.000	BANCO GENERAL SA 4.125% 07/08/2027	USD	387.398,56	0,11
200.000	PERUSAHAAN PERSEROAN PERSERO PT PERUSAHAAN LISTRIK NEGARA 6.150% 21/05/2048 EMTN	USD	200.509,95	0,06	200.000	PANAMA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.870% 23/07/2060	USD	157.787,69	0,04
200.000	PERUSAHAAN PERSEROAN PERSERO PT PERUSAHAAN LISTRIK NEGARA 6.250% 25/01/2049	USD	204.700,44	0,06	200.000	PANAMA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.870% 23/07/2060	USD	157.787,69	0,04
			<b>1.922.614,38</b>	<b>0,53</b>	200.000	PANAMA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.500% 15/05/2047	USD	179.404,32	0,05
<b>Chile</b>					200.000	PANAMA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.500% 16/04/2050	USD	177.940,92	0,05
255.000	CHILE GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.100% 07/05/2041	USD	202.528,68	0,06	300.000	PANAMA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 9.375% 01/04/2029	USD	365.430,67	0,10
300.000	CHILE GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.100% 22/01/2061	USD	221.891,01	0,06				<b>1.603.591,47</b>	<b>0,44</b>
200.000	CHILE GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.250% 21/09/2071	USD	145.584,22	0,04	<b>Argentinien</b>				
400.000	CHILE GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.500% 25/01/2050	USD	329.407,50	0,09	6.082	ARGENTINE REPUBLIC GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 0.500% 09/07/2029	EUR	1.923,35	0,00
200.000	EMPRESA DE LOS FERROCARRILES DEL ESTADO 3.068% 18/08/2050	USD	137.516,58	0,04	116.400	ARGENTINE REPUBLIC GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 0.750% 09/07/2035 STEP-UP	EUR	31.895,89	0,01
255.000	EMPRESA DE TRANSPORTE DE PASAJEROS METRO SA 4.700% 07/05/2050	USD	232.659,51	0,06	60.473	ARGENTINE REPUBLIC GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 1.000% 09/07/2029	USD	18.690,96	0,01
656.000	TELEFONICA MOVILES CHILE SA 3.537% 18/11/2031	USD	549.939,77	0,15	2.160.000	ARGENTINE REPUBLIC GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 1.125% 09/07/2035 STEP-UP	USD	595.189,17	0,16
			<b>1.819.527,27</b>	<b>0,50</b>	400.000	TELECOM ARGENTINA SA 8.000% 18/07/2026	USD	340.716,56	0,09
<b>Schweden</b>					350.000	TRANSPORTADORA DE GAS DEL SUR SA 6.750% 02/05/2025	USD	286.253,54	0,08
1.200.000	SVENSKA HANDELSBANKEN AB FRN PERP EMTN	USD	1.111.682,13	0,30	425.000	YPF SA 8.500% 28/07/2025	USD	326.532,77	0,09
700.000	VERISURE HOLDING AB 3.875% 15/07/2026	EUR	683.141,21	0,19				<b>1.601.202,24</b>	<b>0,44</b>
			<b>1.794.823,34</b>	<b>0,49</b>	<b>Brasilien</b>				
<b>Bermuda</b>					375.000	BRAZILIAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.750% 12/09/2031	USD	304.563,74	0,08
2.000.000	AIRCASLE LTD 4.250% 15/06/2026	USD	1.772.604,92	0,49	800.000	BRAZILIAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.875% 12/06/2030	USD	664.221,67	0,18
			<b>1.772.604,92</b>	<b>0,49</b>	200.000	BRAZILIAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.750% 14/01/2050	USD	150.631,09	0,04
<b>Dänemark</b>					500.000	OI MOVEL SA 8.750% 30/07/2026	USD	457.887,78	0,13
1.000.000	DKT FINANCE APS 7.000% 17/06/2023	EUR	1.003.703,66	0,27				<b>1.577.304,28</b>	<b>0,43</b>
800.000	DKT FINANCE APS 9.375% 17/06/2023	USD	718.642,54	0,20	<b>Katar</b>				
			<b>1.722.346,20</b>	<b>0,47</b>	200.000	QATAR ENERGY 1.375% 12/09/2026	USD	167.629,97	0,05
<b>Australien</b>					250.000	QATAR ENERGY 2.250% 12/07/2031	USD	207.010,24	0,06
2.033.000	SANTOS FINANCE LTD 3.649% 29/04/2031	USD	1.714.889,70	0,47	350.000	QATAR ENERGY 3.125% 12/07/2041	USD	287.108,36	0,08
			<b>1.714.889,70</b>	<b>0,47</b>	250.000	QATAR ENERGY 3.300% 12/07/2051	USD	206.286,46	0,06
<b>Jersey</b>					200.000	QATAR GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.000% 14/03/2029	USD	191.820,37	0,05
499.668	GALAXY PIPELINE ASSETS BIDCO LTD 2.160% 31/03/2034	USD	413.790,73	0,11	450.000	QATAR GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.817% 14/03/2049	USD	479.831,48	0,12
600.000	GALAXY PIPELINE ASSETS BIDCO LTD 2.625% 31/03/2036	USD	483.765,60	0,13				<b>1.539.686,88</b>	<b>0,42</b>
700.000	WHEEL BIDCO LTD 6.750% 15/07/2026	GBP	778.816,46	0,22	<b>Ägypten</b>				
			<b>1.676.372,79</b>	<b>0,46</b>	345.000	EGYPT GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.625% 16/04/2030 EMTN	EUR	290.013,91	0,08
<b>Nigeria</b>					360.000	EGYPT GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.052% 15/01/2032 EMTN	USD	284.531,28	0,08
200.000	NIGERIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.500% 28/11/2027 EMTN	USD	170.536,47	0,05	250.000	EGYPT GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.500% 16/02/2061 EMTN	USD	178.034,05	0,05
400.000	NIGERIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.625% 28/11/2047 EMTN	USD	298.168,22	0,08	260.000	EGYPT GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.903% 21/02/2048	USD	189.326,11	0,05
					275.000	EGYPT GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 8.150% 20/11/2059 EMTN	USD	203.357,08	0,06
					225.000	EGYPT GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 8.750% 30/09/2051 EMTN	USD	173.512,70	0,05

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) First Class Yield Opportunities

(ausgedrückt in EUR)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW	Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
200.000	EGYPT GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 8.875% 29/05/2050	USD	155.020,16	0,04					
			<b>1.473.795,29</b>	<b>0,41</b>					
	<b>Peru</b>								
708.088	FENIX POWER PERU SA 4.317% 20/09/2027	USD	621.292,85	0,17					
400.000	PERUVIAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 2.780% 01/12/2060	USD	282.211,41	0,08					
640.000	PERUVIAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.230% 28/07/2121	USD	440.479,87	0,12					
150.000	PERUVIAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.300% 11/03/2041	USD	123.058,72	0,03					
			<b>1.467.042,85</b>	<b>0,40</b>					
	<b>Saudi-Arabien</b>								
210.000	SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 2.000% 09/07/2039	EUR	194.078,30	0,05					
400.000	SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 2.750% 03/02/2032 EMTN	USD	349.688,30	0,10					
200.000	SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.500% 22/04/2060 EMTN	USD	194.743,37	0,05					
540.000	SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.500% 26/10/2046 EMTN	USD	510.977,35	0,14					
200.000	SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.000% 17/04/2049 EMTN	USD	204.513,03	0,06					
			<b>1.454.000,35</b>	<b>0,40</b>					
	<b>Israel</b>								
950.000	BANK HAPOLIM BM 21/01/2032 FRN	USD	788.302,70	0,22					
670.000	ENERGEAN ISRAEL FINANCE LTD 4.500% 30/03/2024	USD	597.676,66	0,16					
			<b>1.385.979,36</b>	<b>0,38</b>					
	<b>Bahrain</b>								
200.000	BAHRAIN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.625% 30/09/2031	USD	174.438,86	0,05					
420.000	BAHRAIN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.000% 19/09/2044	USD	328.868,28	0,09					
400.000	BAHRAIN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.750% 20/09/2029	USD	378.648,41	0,10					
280.000	BAHRAIN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.375% 14/05/2030	USD	272.766,75	0,08					
200.000	OIL AND GAS HOLDING CO BSCC/THE 7.625% 07/11/2024	USD	188.861,41	0,05					
			<b>1.343.583,71</b>	<b>0,37</b>					
	<b>Mauritius</b>								
200.000	GREENKO INVESTMENT CO 4.875% 16/08/2023	USD	179.775,07	0,05					
200.000	GREENKO SOLAR MAURITIUS LTD 5.950% 29/07/2026	USD	182.176,55	0,05					
535.000	HTA GROUP LTD 7.000% 18/12/2025	USD	477.016,80	0,13					
500.000	UPL CORP LTD 4.625% 16/06/2030	USD	426.668,32	0,12					
			<b>1.265.636,74</b>	<b>0,35</b>					
	<b>Paraguay</b>								
610.000	BANCO CONTINENTAL SAECA 2.750% 10/12/2025	USD	502.065,64	0,15					
203.000	PARAGUAY GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 2.739% 29/01/2033	USD	161.211,16	0,04					
205.000	PARAGUAY GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.950% 28/04/2031	USD	193.314,92	0,05					
200.000	PARAGUAY GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.600% 13/03/2048	USD	184.296,14	0,05					
200.000	PARAGUAY GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.100% 11/08/2044	USD	199.203,28	0,05					
			<b>1.240.091,14</b>	<b>0,34</b>					
	<b>Philippinen</b>								
300.000	GLOBE TELECOM INC 3.000% 23/07/2035	USD	217.247,19	0,06					
750.000	PHILIPPINE GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 2.650% 10/12/2045	USD	557.956,35	0,15					
250.000	SMC GLOBAL POWER HOLDINGS CORP FRN PERP	USD	217.818,42	0,06					
			<b>993.021,96</b>	<b>0,27</b>					
	<b>Oman</b>								
255.000	OMAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.875% 01/02/2025 EMTN	USD	233.774,67	0,06					
280.000	OMAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.500% 08/03/2047	USD	247.140,22	0,07					
555.000	OMAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.750% 17/01/2048	USD	498.811,85	0,14					
			<b>979.726,74</b>	<b>0,27</b>					
	<b>Bahamas</b>								
200.000	BAHAMAS GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.000% 21/11/2028	USD	139.081,26	0,04					
315.000	BAHAMAS GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 8.950% 15/10/2032	USD	228.525,12	0,06					
705.000	INTERCORP PERU LTD 3.875% 15/08/2029	USD	575.317,09	0,16					
			<b>942.923,47</b>	<b>0,26</b>					
	<b>Ghana</b>								
230.000	GHANA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND ZCP 07/04/2025	USD	134.642,71	0,04					
400.000	GHANA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 8.125% 26/03/2032	USD	257.774,29	0,07					
300.000	GHANA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 8.627% 16/06/2049	USD	186.310,73	0,05					
200.000	GHANA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 8.750% 11/03/2061	USD	123.838,67	0,03					
270.000	GHANA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 8.875% 07/05/2042	USD	168.753,31	0,05					
			<b>871.319,71</b>	<b>0,24</b>					
	<b>Malaysia</b>								
300.000	MISC CAPITAL TWO LABUAN LTD 3.625% 06/04/2025 EMTN	USD	269.687,50	0,07					
365.000	PETRONAS CAPITAL LTD 4.550% 21/04/2050 EMTN	USD	370.251,84	0,11					
200.000	SSG RESOURCES LTD 4.250% 04/10/2022	USD	180.554,71	0,05					
			<b>820.494,05</b>	<b>0,23</b>					
	<b>Sri Lanka</b>								
200.000	SRI LANKA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.750% 18/04/2023	USD	90.387,65	0,02					
800.000	SRI LANKA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.200% 11/05/2027	USD	343.800,41	0,10					
400.000	SRI LANKA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.850% 14/03/2024	USD	178.418,26	0,05					
200.000	SRI LANKA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.550% 28/03/2030	USD	85.095,92	0,02					
250.000	SRILANKAN AIRLINES LTD 7.000% 25/06/2024	USD	104.713,45	0,03					
			<b>802.415,69</b>	<b>0,22</b>					
	<b>Insel Man</b>								
345.000	ANGLOGOLD ASHANTI HOLDINGS PLC 6.500% 15/04/2040	USD	340.851,64	0,09					
500.000	GOHL CAPITAL LTD 4.250% 24/01/2027	USD	423.163,84	0,12					
			<b>764.015,48</b>	<b>0,21</b>					
	<b>Jordanien</b>								
500.000	JORDAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.850% 07/07/2030	USD	420.185,04	0,11					
250.000	JORDAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.375% 10/10/2047	USD	204.695,26	0,06					
			<b>624.880,30</b>	<b>0,17</b>					
	<b>Rumänien</b>								
280.000	ROMANIAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 2.625% 02/12/2040	EUR	213.008,85	0,06					
156.000	ROMANIAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 2.750% 14/04/2041 EMTN	EUR	119.917,21	0,03					
335.000	ROMANIAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.375% 28/01/2050 EMTN	EUR	268.645,34	0,08					
			<b>601.571,40</b>	<b>0,17</b>					

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) First Class Yield Opportunities

(ausgedrückt in EUR)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW	Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
<b>Ukraine</b>					<b>Bolivien</b>				
200.000	STATE AGENCY OF ROADS OF UKRAINE 6.250% 24/06/2028	USD	67.195,94	0,02	360.000	BOLIVIAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.500% 02/03/2030	USD	320.647,75	0,09
1.400.000	UKRAINE GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.375% 25/09/2032	USD	527.652,87	0,14				<b>320.647,75</b>	<b>0,09</b>
			<b>594.848,81</b>	<b>0,16</b>	<b>Schweiz</b>				
<b>Guatemala</b>					300.000	CREDIT SUISSE GROUP AG 02/04/2026 FRN EMTN	EUR	309.290,28	0,09
240.000	GUATEMALA GOVERNMENT BOND 4.650% 07/10/2041	USD	201.067,97	0,06				<b>309.290,28</b>	<b>0,09</b>
400.000	GUATEMALA GOVERNMENT BOND 6.125% 01/06/2050	USD	376.606,39	0,10	<b>Papua-Neuguinea</b>				
			<b>577.674,36</b>	<b>0,16</b>	400.000	PAPUA NEW GUINEA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 8.375% 04/10/2028	USD	308.713,59	0,09
<b>Südafrika</b>								<b>308.713,59</b>	<b>0,09</b>
200.000	ESKOM HOLDINGS SOC LTD 7.125% 11/02/2025	USD	174.166,06	0,05	<b>Tunesien</b>				
200.000	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.000% 12/10/2046	USD	149.520,90	0,04	315.000	TUNISIAN REPUBLIC 5.625% 17/02/2024	EUR	215.444,53	0,05
290.000	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.750% 30/09/2049	USD	227.907,06	0,06	125.000	TUNISIAN REPUBLIC 6.750% 31/10/2023	EUR	90.913,30	0,03
			<b>551.594,02</b>	<b>0,15</b>				<b>306.357,83</b>	<b>0,08</b>
<b>Angola</b>					<b>Senegal</b>				
600.000	ANGOLAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 9.375% 08/05/2048	USD	530.062,65	0,15	174.000	SENEGAL GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.375% 08/06/2037	EUR	147.816,82	0,04
			<b>530.062,65</b>	<b>0,15</b>	200.000	SENEGAL GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.750% 13/03/2048	USD	155.103,66	0,04
<b>Ecuador</b>								<b>302.920,48</b>	<b>0,08</b>
36.522	ECUADOR GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND ZCP 31/07/2030	USD	18.288,57	0,01	<b>Uruguay</b>				
204.300	ECUADOR GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 0.500% 31/07/2040 STEP-UP	USD	105.560,33	0,03	280.000	URUGUAY GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.100% 18/06/2050	USD	298.219,13	0,08
445.770	ECUADOR GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 1.000% 31/07/2035 STEP-UP	USD	262.219,99	0,06				<b>298.219,13</b>	<b>0,08</b>
170.100	ECUADOR GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.000% 31/07/2030 STEP-UP	USD	127.456,62	0,04	<b>Pakistan</b>				
			<b>513.525,51</b>	<b>0,14</b>	400.000	PAKISTAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.875% 05/12/2027	USD	275.857,62	0,08
<b>Irak</b>								<b>275.857,62</b>	<b>0,08</b>
520.000	IRAQ INTERNATIONAL BOND 6.752% 09/03/2023	USD	469.818,93	0,13	<b>Montenegro</b>				
			<b>469.818,93</b>	<b>0,13</b>	315.000	MONTENEGRO GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 2.875% 16/12/2027	EUR	271.269,87	0,07
<b>Kuwait</b>								<b>271.269,87</b>	<b>0,07</b>
500.000	AL AHLI BANK OF KUWAIT KSCP FRN PERP	USD	457.396,55	0,13	<b>Armenien</b>				
			<b>457.396,55</b>	<b>0,13</b>	343.000	REPUBLIC OF ARMENIA INTERNATIONAL BOND 3.600% 02/02/2031	USD	244.145,94	0,07
<b>Trinidad und Tobago</b>								<b>244.145,94</b>	<b>0,07</b>
300.000	TELECOMMUNICATIONS SERVICES OF TRINIDAD & TOBAGO LTD 8.875% 18/10/2029	USD	271.162,13	0,07	<b>Jamaika</b>				
200.000	TRINIDAD & TOBAGO GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.375% 16/01/2024	USD	182.052,27	0,05	200.000	JAMAICA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.875% 28/07/2045	USD	232.969,11	0,06
			<b>453.214,40</b>	<b>0,12</b>				<b>232.969,11</b>	<b>0,06</b>
<b>Georgien</b>					<b>Republik Serbien</b>				
400.000	TBC BANK JSC 5.750% 19/06/2024 EMTN	USD	370.857,85	0,10	290.000	SERBIA INTERNATIONAL BOND 2.125% 01/12/2030	USD	219.502,69	0,06
			<b>370.857,85</b>	<b>0,10</b>				<b>219.502,69</b>	<b>0,06</b>
<b>Elfenbeinküste</b>					<b>Kenia</b>				
170.000	IVORY COAST GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.875% 30/01/2032	EUR	149.545,00	0,04	265.000	REPUBLIC OF KENYA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.300% 23/01/2034	USD	204.961,57	0,06
200.000	IVORY COAST GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.625% 22/03/2048	EUR	174.478,44	0,05				<b>204.961,57</b>	<b>0,06</b>
			<b>324.023,44</b>	<b>0,09</b>	<b>Marokko</b>				
<b>Kasachstan</b>					271.000	MOROCCO GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.000% 15/12/2050	USD	195.208,65	0,05
200.000	KAZMUNAYGAS NATIONAL CO JSC 5.750% 19/04/2047	USD	159.314,62	0,04				<b>195.208,65</b>	<b>0,05</b>
200.000	KAZTRANS GAS JSC 4.375% 26/09/2027	USD	161.392,05	0,05					
			<b>320.706,67</b>	<b>0,09</b>					

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) First Class Yield Opportunities

(ausgedrückt in EUR)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
<b>Costa Rica</b>				
200.000	INSTITUTO COSTARRICENSE DE ELECTRICIDAD 6.750% 07/10/2031	USD	179.885,40	0,05
			<b>179.885,40</b>	<b>0,05</b>
<b>Benin</b>				
110.000	BENIN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.875% 19/01/2032	EUR	95.887,97	0,03
100.000	BENIN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.875% 19/01/2052	EUR	83.860,61	0,02
			<b>179.748,58</b>	<b>0,05</b>
<b>Singapur</b>				
200.000	GLOBAL PRIME CAPITAL PTE LTD 5.950% 23/01/2025	USD	173.695,10	0,05
			<b>173.695,10</b>	<b>0,05</b>
<b>El Salvador</b>				
285.000	EL SALVADOR GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.375% 18/01/2027	USD	125.589,84	0,03
			<b>125.589,84</b>	<b>0,03</b>
<b>Weißrussland</b>				
200.000	REPUBLIC OF BELARUS INTERNATIONAL BOND 5.875% 24/02/2026	USD	26.962,66	0,01
320.000	REPUBLIC OF BELARUS INTERNATIONAL BOND 6.378% 24/02/2031	USD	37.388,22	0,01
			<b>64.350,88</b>	<b>0,02</b>
			<b>298.607.699,87</b>	<b>82,24</b>

### Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente

#### Anleihen und andere Schuldtitel

##### Jungferneinseln

733.198	OAS RESTRUCTURING BVI LTD 5.000% 31/03/2035	BRL	0,00	0,00
			<b>0,00</b>	<b>0,00</b>
			<b>0,00</b>	<b>0,00</b>

#### Organismen für gemeinsame Anlagen

##### Offene Fonds

##### Luxemburg

3.544	NN (L) FIRST CLASS STABLE YIELD OPPORTUNITIES - Z CAP EUR	EUR	18.412.497,60	5,07
16.155	NN (L) LIQUID EUR - Z CAP EUR	EUR	15.956.412,58	4,40
			<b>34.368.910,18</b>	<b>9,47</b>
			<b>34.368.910,18</b>	<b>9,47</b>

**Wertpapierbestand Gesamt 332.976.610,05 91,71**

### Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022

Bezeichnung	Verkauf / Kauf	Zinssatz (%)	Fälligkeits- datum	Währung	Nennwert	Swap-Wert in EUR
<b>Credit Default Swaps</b>						
CDX ITRAXX EUROPE CROSSOVER SERIES 37 VERSION 1	Verkauf	5,000	20/06/2027	EUR	8.000.000,00	583.306,08
CDX ITRAXX EUROPE SERIES 37 VERSION 1	Verkauf	1,000	20/06/2027	EUR	35.000.000,00	478.333,10
CDX EMERGING MARKETS SERIES 37 VERSION 1	Verkauf	1,000	20/06/2027	USD	19.500.000,00	(1.029.705,33)
						<b>31.933,85</b>
Zu erhalten	Zu zahlen (%)	Fälligkeits- datum	Währung	Nennwert	Swap-Wert in EUR	
						<b>(1.007.765,01)</b>
<b>Zinsswap</b>						
-0.093	Floating	23/11/2026	EUR	21.000.000,00	(1.007.765,01)	
						<b>(1.007.765,01)</b>
Zu erhalten	Zu zahlen	Fälligkeits- datum	Engagement in EUR	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR		

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) First Class Yield Opportunities

(ausgedrückt in EUR)

### Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Zu erhalten	Zu zahlen	Fälligkeits- datum	Engagement in EUR	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR
503.317,95 EUR	12.693.334,84 CZK	19/04/2022	503.317,95	(15.221,75)
2.761.434,20 EUR	13.071.816,47 PLN	19/04/2022	2.761.434,20	(52.669,08)
			<b>305.068.713,90</b>	<b>2.783.702,48</b>

Stückzahl	Bezeich- nung	Währung	Engagement in EUR	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR
<b>Zins-Futures</b>				
(29)	EURO-BOBL FUTURE 08/06/2022	EUR	3.736.940,00	131.043,75
30	EURO-BUND FUTURE 08/06/2022	EUR	4.759.800,00	(161.786,84)
(1)	EURO-BUXL 30Y BOND 08/06/2022	EUR	186.200,00	15.940,00
102	EURO-SCHATZ FUTURE 08/06/2022	EUR	11.294.970,00	(62.425,00)
38	US LONG BOND (CBT) 21/06/2022	USD	5.125.039,32	(216.119,46)
32	US ULTRA BOND (CBT) 21/06/2022	USD	5.094.144,61	(199.973,04)
(137)	US 10YR NOTE (CBT) 21/06/2022	USD	15.129.533,10	441.743,94
166	US 2YR NOTE (CBT) 30/06/2022	USD	31.617.338,26	(406.784,89)
(94)	US 5YR NOTE (CBT) 30/06/2022	USD	9.689.143,04	161.471,17
			<b>86.633.108,33</b>	<b>(296.890,37)</b>

Stückzahl/ Nominal	Bezeich- nung	Währung	Marktwert in EUR
<b>Optionsschein</b>			
219.520	OAS SA ZCP 16/05/2039	BRL	0,00
			<b>0,00</b>

**Derivative Finanzinstrumente Gesamt** **1.510.980,95**

### Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick

		% NIW
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	<b>332.976.610,05</b>	<b>91,71</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	<b>1.510.980,95</b>	<b>0,42</b>
<b>Bankguthaben</b>	<b>27.243.821,53</b>	<b>7,50</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>	<b>1.345.453,96</b>	<b>0,37</b>
<b>Nettovermögen Gesamt</b>	<b>363.076.866,49</b>	<b>100,00</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Food & Beverages

(ausgedrückt in USD)

### Statistische Angaben

<b>Nettovermögen</b>	31.03.2022	USD	202.273.550,75	Distribution P (USD)	31.03.2022	USD	10.451,01
	30.09.2021	USD	188.673.434,63		30.09.2021	USD	10.018,31
	30.09.2020	USD	240.285.547,36		30.09.2020	USD	9.634,49
<b>Nettoinventarwert pro Anteil**</b>				Distribution P Hedged (ii) (EUR)	31.03.2022	EUR	2.928,91
					30.09.2021	EUR	2.785,08
					30.09.2020	EUR	2.680,15
Capitalisation I (EUR)	31.03.2022	EUR	20.319,88	Distribution R (USD)	31.03.2022	USD	293,16
	30.09.2021	EUR	18.524,93		30.09.2021	USD	281,93
	30.09.2020	EUR	17.432,93		30.09.2020	USD	270,77
Capitalisation I (USD)	31.03.2022	USD	3.193,35	Distribution R Hedged (ii) (EUR)	31.03.2022	EUR	289,27
	30.09.2021	USD	3.032,36		30.09.2021	EUR	275,83
	30.09.2020	USD	2.887,27		30.09.2020	EUR	264,89
Capitalisation I Hedged (ii) (EUR)	31.03.2022	EUR	7.824,32	Distribution X (M) (USD)	31.03.2022	USD	250,64
	30.09.2021	EUR	7.367,10		30.09.2021	USD	242,07
	30.09.2020	EUR	7.020,64		30.09.2020	USD	238,63
Capitalisation P (EUR)	31.03.2022	EUR	271,40	Distribution X (M) Hedged (ii) (AUD)	31.03.2022	AUD	252,12
	30.09.2021	EUR	248,65		30.09.2021	AUD	241,84
	30.09.2020	EUR	-		30.09.2020	AUD	237,76
Capitalisation P (USD)	31.03.2022	USD	2.706,34	<b>Anzahl der Anteile</b>			
	30.09.2021	USD	2.582,64		Capitalisation I (EUR)	31.03.2022	564
	30.09.2020	USD	2.483,70		30.09.2021	145	
Capitalisation P Hedged (ii) (EUR)	31.03.2022	EUR	754,44	30.09.2020	132		
	30.09.2021	EUR	714,13	Capitalisation I (USD)	31.03.2022	931	
	30.09.2020	EUR	687,46	30.09.2021	891		
Capitalisation R (USD)	31.03.2022	USD	306,63	30.09.2020	922		
	30.09.2021	USD	291,52	Capitalisation I Hedged (ii) (EUR)	31.03.2022	934	
	30.09.2020	USD	278,25	30.09.2021	1.020		
Capitalisation R Hedged (ii) (EUR)	31.03.2022	EUR	302,42	30.09.2020	1.268		
	30.09.2021	EUR	285,37	Capitalisation P (EUR)	31.03.2022	1.274	
	30.09.2020	EUR	272,74	30.09.2021	40		
Capitalisation X (EUR)	31.03.2022	EUR	2.506,53	30.09.2020	-		
	30.09.2021	EUR	2.302,07	Capitalisation P (USD)	31.03.2022	18.993	
	30.09.2020	EUR	2.198,86	30.09.2021	20.768		
Capitalisation X (USD)	31.03.2022	USD	2.439,43	30.09.2020	24.960		
	30.09.2021	USD	2.333,54	Capitalisation P Hedged (ii) (EUR)	31.03.2022	38.575	
	30.09.2020	USD	2.254,95	30.09.2021	40.825		
Capitalisation Y (USD)	31.03.2022	USD	376,35	30.09.2020	49.980		
	30.09.2021	USD	361,84	Capitalisation R (USD)	31.03.2022	5.344	
	30.09.2020	USD	353,23	30.09.2021	5.016		
Capitalisation Z (USD)	31.03.2022	USD	-	30.09.2020	6.122		
	30.09.2021	USD	-	Capitalisation R Hedged (ii) (EUR)	31.03.2022	6.485	
	30.09.2020	USD	10.347,70	30.09.2021	7.365		
Distribution P (EUR)	31.03.2022	EUR	271,38	30.09.2020	9.604		
	30.09.2021	EUR	248,65				
	30.09.2020	EUR	-				

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

## NN (L) Food & Beverages

(ausgedrückt in USD)

### Statistische Angaben (Fortsetzung)

#### Anzahl der Anteile

Capitalisation X (EUR)	31.03.2022	5.338	Distribution X (M) (USD)	02.03.2022	USD	0,40
	30.09.2021	5.581	Distribution X (M) (USD)	07.02.2022	USD	0,40
	30.09.2020	7.737	Distribution X (M) (USD)	04.01.2022	USD	0,40
Capitalisation X (USD)	31.03.2022	15.586	Distribution X (M) (USD)	02.12.2021	USD	0,40
	30.09.2021	14.014	Distribution X (M) (USD)	02.11.2021	USD	0,40
	30.09.2020	15.566	Distribution X (M) (USD)	04.10.2021	USD	0,40
Capitalisation Y (USD)	31.03.2022	32.767	Distribution X (M) Hedged (ii) (AUD)	02.03.2022	AUD	0,42
	30.09.2021	21.638	Distribution X (M) Hedged (ii) (AUD)	07.02.2022	AUD	0,42
	30.09.2020	26.678	Distribution X (M) Hedged (ii) (AUD)	04.01.2022	AUD	0,42
Capitalisation Z (USD)	31.03.2022	-	Distribution X (M) Hedged (ii) (AUD)	02.12.2021	AUD	0,42
	30.09.2021	-	Distribution X (M) Hedged (ii) (AUD)	02.11.2021	AUD	0,42
	30.09.2020	1.910	Distribution X (M) Hedged (ii) (AUD)	04.10.2021	AUD	0,42
Distribution P (EUR)	31.03.2022	1.128	<b>Laufende Kosten in %*</b>			
	30.09.2021	40	Capitalisation I (EUR)	31.03.2022		0,81%
	30.09.2020	-	Capitalisation I (USD)	31.03.2022		0,81%
Distribution P (USD)	31.03.2022	1.380	Capitalisation I Hedged (ii) (EUR)	31.03.2022		0,83%
	30.09.2021	1.632	Capitalisation P (EUR)	31.03.2022		1,80%
	30.09.2020	2.011	Capitalisation P (USD)	31.03.2022		1,80%
Distribution P Hedged (ii) (EUR)	31.03.2022	2.058	Capitalisation P Hedged (ii) (EUR)	31.03.2022		1,82%
	30.09.2021	2.270	Capitalisation R (USD)	31.03.2022		1,05%
	30.09.2020	2.921	Capitalisation R Hedged (ii) (EUR)	31.03.2022		1,07%
Distribution R (USD)	31.03.2022	1.216	Capitalisation X (EUR)	31.03.2022		2,30%
	30.09.2021	1.609	Capitalisation X (USD)	31.03.2022		2,30%
	30.09.2020	2.288	Capitalisation Y (USD)	31.03.2022		3,30%
Distribution R Hedged (ii) (EUR)	31.03.2022	3.085	Distribution P (EUR)	31.03.2022		1,80%
	30.09.2021	3.733	Distribution P (USD)	31.03.2022		1,80%
	30.09.2020	5.359	Distribution P Hedged (ii) (EUR)	31.03.2022		1,82%
Distribution X (M) (USD)	31.03.2022	5.571				
	30.09.2021	5.042				
	30.09.2020	5.825				
Distribution X (M) Hedged (ii) (AUD)	31.03.2022	5.104				
	30.09.2021	4.752				
	30.09.2020	5.603				
<b>Dividende</b>						
Distribution P (USD)	14.12.2021	USD	48,25			
Distribution P Hedged (ii) (EUR)	14.12.2021	EUR	13,25			
Distribution R (USD)	14.12.2021	USD	3,45			
Distribution R Hedged (ii) (EUR)	14.12.2021	EUR	3,40			

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

## NN (L) Food & Beverages

(ausgedrückt in USD)

### Statistische Angaben (Fortsetzung)

Distribution R (USD)	31.03.2022	1,05%
Distribution R Hedged (ii) (EUR)	31.03.2022	1,07%
Distribution X (M) (USD)	31.03.2022	2,30%
Distribution X (M) Hedged (ii) (AUD)	31.03.2022	2,32%
<b>Portfolioumsatz in %*</b>	31.03.2022	70,19%

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.



## NN (L) Food & Beverages

(ausgedrückt in USD)

### Finanzabschlüsse

#### Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022

	Erläuterungen	
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	2	<b>200.161.939,42</b>
Aktien		200.161.939,42
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	2	<b>50.248,88</b>
Devisentermingeschäfte		50.248,88
<b>Bankguthaben</b>		<b>1.985.654,09</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte</b>	4	<b>2.443.375,31</b>
<b>Vermögenswerte Gesamt</b>		<b>204.641.217,70</b>
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>	4	<b>(2.367.666,95)</b>
<b>Verbindlichkeiten Gesamt</b>		<b>(2.367.666,95)</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Berichtszeitraums</b>		<b>202.273.550,75</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Food & Beverages

(ausgedrückt in USD)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW	Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW
<b>Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>									
<b>Aktien</b>									
<b>Vereinigte Staaten</b>									
34.267	ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	USD	3.092.939,42	1,53	15.300	LAWSON INC	JPY	589.309,99	0,29
23.600	BROWN-FORMAN CORP - B	USD	1.581.672,00	0,78	6.700	NH FOODS LTD	JPY	229.083,42	0,11
65.100	CAMPBELL SOUP CO	USD	2.901.507,00	1,43	8.100	NICHIREI CORP	JPY	158.095,98	0,08
2.400	CHURCH & DWIGHT CO INC	USD	238.512,00	0,12	106.000	NISSHIN SEIFUN GROUP INC	JPY	1.489.894,95	0,73
14.600	CLOROX CO/THE	USD	2.029.838,00	1,00	49.000	POLA ORBIS HOLDINGS INC	JPY	645.528,32	0,32
156.732	COCA-COLA CO	USD	9.717.384,00	4,81	19.500	SHISEIDO CO LTD	JPY	998.978,37	0,49
49.898	COLGATE-PALMOLIVE CO	USD	3.783.765,34	1,87	10.700	SUNDRUG CO LTD	JPY	262.265,71	0,13
35.292	COSTCO WHOLESALE CORP	USD	20.322.898,20	10,05	17.300	UNICHARM CORP	JPY	621.303,40	0,31
10.100	ESTEE LAUDER COS INC/THE - A	USD	2.750.432,00	1,36				<b>12.342.999,80</b>	<b>6,10</b>
103.396	GENERAL MILLS INC	USD	7.001.977,12	3,46	<b>Kanada</b>				
2.600	HERSHEY CO/THE	USD	563.238,00	0,28	89.700	EMPIRE CO LTD - A	CAD	3.184.258,44	1,58
31.600	HORMEL FOODS CORP	USD	1.628.664,00	0,81	19.700	GEORGE WESTON LTD	CAD	2.428.097,35	1,20
23.940	KIMBERLY-CLARK CORP	USD	2.948.450,40	1,46	2.600	PREMIUM BRANDS HOLDINGS CORP	CAD	227.662,62	0,11
17.600	KRAFT HEINZ CO/THE	USD	693.264,00	0,34				<b>5.840.018,41</b>	<b>2,89</b>
17.097	KROGER CO/THE	USD	980.854,89	0,48	<b>Niederlande</b>				
1.500	LAMB WESTON HOLDINGS INC	USD	89.865,00	0,04	37.600	HEINEKEN NV	EUR	3.622.129,65	1,79
18.300	MOLSON COORS BREWING CO - B	USD	976.854,00	0,48	26.600	KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	EUR	861.701,79	0,43
53.970	MONDELEZ INTERNATIONAL INC - A	USD	3.388.236,60	1,68				<b>4.483.831,44</b>	<b>2,22</b>
96.955	PEPSICO INC	USD	16.228.327,90	8,02	<b>Australien</b>				
126.615	PROCTER & GAMBLE CO/THE	USD	19.346.772,00	9,56	387.000	TREASURY WINE ESTATES LTD	AUD	3.365.352,25	1,66
51	SEABOARD CORP	USD	214.479,99	0,11				<b>3.365.352,25</b>	<b>1,66</b>
16.800	SYSCO CORP	USD	1.371.720,00	0,68	<b>Belgien</b>				
12.800	TYSON FOODS INC - A	USD	1.147.264,00	0,57	29.300	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	EUR	1.768.910,97	0,87
26.800	WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	USD	1.199.836,00	0,59	10.000	ETABLISSEMENTS FRANZ COLRUYT NV	EUR	417.243,74	0,21
39.210	WALMART INC	USD	5.839.153,20	2,89				<b>2.186.154,71</b>	<b>1,08</b>
			<b>110.037.905,06</b>	<b>54,40</b>	<b>Deutschland</b>				
<b>Vereinigtes Königreich</b>									
40.000	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	GBP	875.308,89	0,43	27.445	HENKEL AG & CO KGAA	EUR	1.830.673,89	0,91
14.000	COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC	USD	680.540,00	0,34	22.600	METRO AG	EUR	202.826,75	0,10
188.519	DIAGEO PLC	GBP	9.589.729,83	4,74				<b>2.033.500,64</b>	<b>1,01</b>
22.500	J SAINSBURY PLC	GBP	74.861,42	0,04	<b>Irland</b>				
22.200	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	GBP	1.704.671,96	0,84	15.899	KERRY GROUP PLC	EUR	1.788.461,23	0,88
2.343.952	TESCO PLC	GBP	8.517.813,44	4,20				<b>1.788.461,23</b>	<b>0,88</b>
			<b>21.442.925,54</b>	<b>10,59</b>	<b>Norwegen</b>				
<b>Schweiz</b>									
1.175	BARRY CALLEBAUT AG - REG	CHF	2.770.714,48	1,37	27.900	MOWI ASA	NOK	759.400,73	0,38
18.700	COCA-COLA HBC AG - DI	GBP	393.818,56	0,19	70.300	ORKLA ASA	NOK	629.998,63	0,31
117.911	NESTLE SA - REG	CHF	15.401.143,38	7,62				<b>1.389.399,36</b>	<b>0,69</b>
			<b>18.565.676,42</b>	<b>9,18</b>	<b>Bermuda</b>				
<b>Frankreich</b>									
60.500	CARREFOUR SA	EUR	1.322.409,54	0,66	9.800	BUNGE LTD	USD	1.085.938,00	0,54
33.900	DANONE SA	EUR	1.887.073,28	0,93				<b>1.085.938,00</b>	<b>0,54</b>
24.406	L'OREAL SA	EUR	9.880.468,79	4,88	<b>Dänemark</b>				
			<b>13.089.951,61</b>	<b>6,47</b>	8.012	CARLSBERG AS - B	DKK	994.706,34	0,49
<b>Japan</b>									
56.500	ASAHI GROUP HOLDINGS LTD	JPY	2.076.593,20	1,03				<b>994.706,34</b>	<b>0,49</b>
9.000	FANCL CORP	JPY	202.727,09	0,10	<b>Schweden</b>				
99.100	KAO CORP	JPY	4.102.801,24	2,03	12.300	AAK AB	SEK	230.969,80	0,12
9.100	KOSE CORP	JPY	966.418,13	0,48	3.131	AXFOOD AB	SEK	102.872,74	0,05
					12.200	ESSITY AB - B	SEK	290.881,39	0,14
								<b>624.723,93</b>	<b>0,31</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Food & Beverages

(ausgedrückt in USD)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW
<b>Spanien</b>				
4.300	VISCOFAN SA	EUR	257.400,45	0,13
			<b>257.400,45</b>	<b>0,13</b>
<b>Singapur</b>				
188.000	OLAM GROUP LTD	SGD	243.100,45	0,12
			<b>243.100,45</b>	<b>0,12</b>
<b>Kaimaninseln</b>				
5.900	HERBALIFE LTD	USD	179.124,00	0,09
			<b>179.124,00</b>	<b>0,09</b>
<b>Färöer-Inseln</b>				
2.000	BAKKAFFROST P/F	NOK	135.635,86	0,07
			<b>135.635,86</b>	<b>0,07</b>
<b>Finnland</b>				
2.700	KESKO OYJ - B	EUR	75.133,92	0,04
			<b>75.133,92</b>	<b>0,04</b>
			<b>200.161.939,42</b>	<b>98,96</b>
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>			<b>200.161.939,42</b>	<b>98,96</b>

### Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022

Zu erhalten	Zu zahlen	Fälligkeits- datum	Engagement in USD	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in USD	
<b>Devisentermingeschäfte</b>					
3.261.969,68	EUR	419.259.188,00 JPY	20/04/2022	3.661.354,40	175.849,75
5.243.331,62	EUR	4.376.824,49 GBP	20/04/2022	5.882.879,78	74.599,21
698.641,38	AUD	507.929,44 USD	20/04/2022	507.929,44	16.812,47
85.579,16	AUD	7.193.656,00 JPY	20/04/2022	62.162,44	4.992,08
145.790,78	AUD	79.651,36 GBP	20/04/2022	105.880,45	4.640,59
178.236,27	AUD	116.625,51 EUR	20/04/2022	129.333,99	4.047,68
118.862,38	AUD	79.734,50 CHF	20/04/2022	86.351,66	2.585,88
38.201,98	AUD	35.309,91 CAD	20/04/2022	27.738,24	425,53
81.959,50	SEK	7.588,35 EUR	20/04/2022	8.339,06	349,87
6.819,33	AUD	33.023,72 DKK	20/04/2022	4.948,45	179,96
246.631,16	NOK	25.173,37 EUR	20/04/2022	27.342,06	177,81
17.533,79	CAD	12.478,29 EUR	20/04/2022	13.626,42	146,36
9.400,75	AUD	60.550,78 NOK	20/04/2022	6.817,15	137,38
1.508,87	AUD	1.490,17 SGD	20/04/2022	1.094,91	32,29
3.841,83	AUD	26.716,75 SEK	20/04/2022	2.787,82	17,97
443.669,94	DKK	59.637,96 EUR	20/04/2022	65.562,64	7,73
22,80	AUD	53,57 ILS	20/04/2022	16,55	0,33
0,62	AUD	3,53 HKD	20/04/2022	0,45	0,02
4,53	AUD	4,87 NZD	20/04/2022	3,29	0,01

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

Zu erhalten	Zu zahlen	Fälligkeits- datum	Engagement in USD	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in USD	
23,20	EUR	202,63 HKD	20/04/2022	26,05	(0,04)
1.816,92	CAD	1.938,39 AUD	20/04/2022	1.441,37	(1,35)
174,06	EUR	287,38 NZD	20/04/2022	195,51	(6,09)
816,69	EUR	2.948,23 ILS	20/04/2022	917,31	(14,95)
5.193,26	DKK	1.058,82 AUD	20/04/2022	772,63	(18,10)
3.961,81	SGD	2.652,47 EUR	20/04/2022	2.918,57	(25,46)
295.089,95	EUR	2.195.259,08 DKK	20/04/2022	331.100,46	(33,86)
6.780,64	GBP	12.031,95 AUD	20/04/2022	8.928,64	(110,34)
58.956,06	EUR	89.322,81 SGD	20/04/2022	66.100,21	(368,12)
1.261.810,62	USD	1.134.751,86 EUR	20/04/2022	1.261.810,62	(1.357,44)
263.040,12	CHF	260.366,53 EUR	20/04/2022	283.865,26	(3.844,21)
142.217,73	EUR	1.519.040,46 SEK	20/04/2022	159.704,82	(4.731,27)
360.240,22	EUR	3.553.454,36 NOK	20/04/2022	404.027,89	(5.296,94)
4.290.211,35	EUR	4.401.913,64 CHF	20/04/2022	4.815.915,76	(10.206,16)
423.898,92	GBP	510.956,23 EUR	20/04/2022	559.893,73	(10.715,21)
43.297.713,00	JPY	340.250,62 EUR	20/04/2022	374.702,62	(21.923,59)
1.306.436,40	EUR	1.848.211,88 CAD	20/04/2022	1.463.360,10	(25.315,34)
758.490,54	EUR	1.164.223,87 AUD	20/04/2022	851.578,78	(30.109,37)
25.680.423,65	EUR	28.707.270,06 USD	20/04/2022	28.707.270,06	(120.676,10)
			<b>49.888.699,59</b>	<b>50.248,98</b>	
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>				<b>50.248,88</b>	

### Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick

		% NIW
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	<b>200.161.939,42</b>	<b>98,96</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	<b>50.248,88</b>	<b>0,02</b>
<b>Bankguthaben</b>	<b>1.985.654,09</b>	<b>0,98</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>	<b>75.708,36</b>	<b>0,04</b>
<b>Nettovermögen Gesamt</b>	<b>202.273.550,75</b>	<b>100,00</b>

## NN (L) Frontier Markets Debt (Hard Currency)

(ausgedrückt in USD)

### Statistische Angaben

<b>Nettovermögen</b>	31.03.2022	USD	275.213.120,62	Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR)	31.03.2022	ZAR	2.872,55
	30.09.2021	USD	352.298.071,67		30.09.2021	ZAR	3.497,37
	30.09.2020	USD	303.128.293,37		30.09.2020	ZAR	3.521,75
<b>Nettoinventarwert pro Anteil**</b>				Distribution Y (M) (USD)	31.03.2022	USD	180,63
	31.03.2022	USD	7.100,45		30.09.2021	USD	219,38
	30.09.2021	USD	8.111,80		30.09.2020	USD	221,01
Capitalisation I (USD)	31.03.2022	USD	7.100,45	Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD)	31.03.2022	AUD	273,71
	30.09.2021	USD	8.111,80		30.09.2021	AUD	334,61
	30.09.2020	USD	7.316,31		30.09.2020	AUD	340,22
Capitalisation I Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	EUR	5.549,83	Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR)	31.03.2022	ZAR	2.738,45
	30.09.2021	EUR	6.395,21		30.09.2021	ZAR	3.358,77
	30.09.2020	EUR	5.829,31		30.09.2020	ZAR	3.435,07
Capitalisation N Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	EUR	27,65	<b>Anzahl der Anteile</b>			
	30.09.2021	EUR	31,87		Capitalisation I (USD)	31.03.2022	29.663
	30.09.2020	EUR	29,06		30.09.2021	32.346	
Capitalisation P (USD)	31.03.2022	USD	319,69	30.09.2020	30.307		
	30.09.2021	USD	366,35	Capitalisation I Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	3.174	
	30.09.2020	USD	332,46	30.09.2021	3.932		
Capitalisation P Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	EUR	269,52	30.09.2020	4.129		
	30.09.2021	EUR	311,51	Capitalisation N Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	7.968	
	30.09.2020	EUR	285,72	30.09.2021	9.438		
Capitalisation X (USD)	31.03.2022	USD	256,98	30.09.2020	14.834		
	30.09.2021	USD	294,93	Capitalisation P (USD)	31.03.2022	1.224	
	30.09.2020	USD	268,45	30.09.2021	2.545		
Capitalisation X Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	EUR	265,88	30.09.2020	5.153		
	30.09.2021	EUR	307,78	Capitalisation P Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	6.050	
	30.09.2020	EUR	283,16	30.09.2021	5.956		
Capitalisation Y (USD)	31.03.2022	USD	-	30.09.2020	7.288		
	30.09.2021	USD	-	Capitalisation X (USD)	31.03.2022	7.030	
	30.09.2020	USD	262,37	30.09.2021	8.617		
Distribution I Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	EUR	3.916,26	30.09.2020	6.815		
	30.09.2021	EUR	4.859,86	Capitalisation X Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	12.800	
	30.09.2020	EUR	4.721,81	30.09.2021	17.441		
Distribution P (USD)	31.03.2022	USD	209,17	30.09.2020	22.767		
	30.09.2021	USD	244,88	Capitalisation Y (USD)	31.03.2022	-	
	30.09.2020	USD	-	30.09.2021	-		
Distribution X Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	EUR	178,49	30.09.2020	0,65		
	30.09.2021	EUR	220,23	Distribution I Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	5.950	
	30.09.2020	EUR	214,06	30.09.2021	5.050		
Distribution X (M) (USD)	31.03.2022	USD	188,10	30.09.2020	3.600		
	30.09.2021	USD	226,88	Distribution P (USD)	31.03.2022	8	
	30.09.2020	USD	225,73	30.09.2021	8		
Distribution X (M) Hedged (i) (AUD)	31.03.2022	AUD	287,25	30.09.2020	-		
	30.09.2021	AUD	348,49				
	30.09.2020	AUD	349,78				

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

## NN (L) Frontier Markets Debt (Hard Currency)

(ausgedrückt in USD)

### Statistische Angaben (Fortsetzung)

#### Anzahl der Anteile

Distribution X Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	31.061	Distribution X (M) Hedged (i) (AUD)	02.12.2021	AUD	2,77				
	30.09.2021	41.630	Distribution X (M) Hedged (i) (AUD)	02.11.2021	AUD	2,77				
	30.09.2020	45.442	Distribution X (M) Hedged (i) (AUD)	04.10.2021	AUD	2,77				
Distribution X (M) (USD)	31.03.2022	12.650	Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR)	02.03.2022	ZAR	43,10				
	30.09.2021	22.886	Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR)	02.02.2022	ZAR	43,10				
	30.09.2020	22.310	Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR)	04.01.2022	ZAR	43,10				
Distribution X (M) Hedged (i) (AUD)	31.03.2022	1.023	Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR)	02.12.2021	ZAR	43,10				
	30.09.2021	1.429	Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR)	02.11.2021	ZAR	43,10				
	30.09.2020	1.549	Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR)	04.10.2021	ZAR	43,10				
Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR)	31.03.2022	8.316	Distribution Y (M) (USD)	02.03.2022	USD	1,74				
	30.09.2021	8.062	Distribution Y (M) (USD)	02.02.2022	USD	1,74				
	30.09.2020	6.445	Distribution Y (M) (USD)	04.01.2022	USD	1,74				
Distribution Y (M) (USD)	31.03.2022	1.739	Distribution Y (M) (USD)	02.12.2021	USD	1,74				
	30.09.2021	3.482	Distribution Y (M) (USD)	02.11.2021	USD	1,74				
	30.09.2020	3.190	Distribution Y (M) (USD)	04.10.2021	USD	1,74				
Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD)	31.03.2022	294	Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD)	02.03.2022	AUD	2,77				
	30.09.2021	344	Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD)	02.02.2022	AUD	2,77				
	30.09.2020	341	Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD)	04.01.2022	AUD	2,77				
Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR)	31.03.2022	1.287	Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD)	02.12.2021	AUD	2,77				
	30.09.2021	5.524	Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD)	02.11.2021	AUD	2,77				
	30.09.2020	984	Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR)	02.03.2022	ZAR	43,10				
<b>Dividende</b>			Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR)	02.02.2022	ZAR	43,10				
			Distribution Y (M) (USD)	04.10.2021	USD	1,74				
			Distribution I Hedged (i) (EUR)	14.12.2021	EUR	330,45	Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD)	02.03.2022	AUD	2,77
			Distribution P (USD)	14.12.2021	USD	5,10	Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD)	02.02.2022	AUD	2,77
			Distribution X Hedged (i) (EUR)	14.12.2021	EUR	12,95	Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD)	04.01.2022	AUD	2,77
			Distribution X (M) (USD)	02.03.2022	USD	1,74	Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD)	02.12.2021	AUD	2,77
			Distribution X (M) (USD)	02.02.2022	USD	1,74	Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD)	02.11.2021	AUD	2,77
			Distribution X (M) (USD)	04.01.2022	USD	1,74	Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD)	04.10.2021	AUD	2,77
			Distribution X (M) (USD)	02.12.2021	USD	1,74	Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR)	02.03.2022	ZAR	43,10
			Distribution X (M) (USD)	02.11.2021	USD	1,74	Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR)	02.02.2022	ZAR	43,10
			Distribution X (M) (USD)	04.10.2021	USD	1,74	Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR)	04.01.2022	ZAR	43,10
			Distribution X (M) Hedged (i) (AUD)	02.03.2022	AUD	2,77	Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR)	02.12.2021	ZAR	43,10
			Distribution X (M) Hedged (i) (AUD)	02.02.2022	AUD	2,77	Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR)	02.11.2021	ZAR	43,10
			Distribution X (M) Hedged (i) (AUD)	04.01.2022	AUD	2,77	Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR)	04.10.2021	ZAR	43,10

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

## NN (L) Frontier Markets Debt (Hard Currency)

(ausgedrückt in USD)

### Statistische Angaben (Fortsetzung)

Laufende Kosten in %*		
Capitalisation I (USD)	31.03.2022	0,88%
Capitalisation I Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	0,90%
Capitalisation N Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	0,92%
Capitalisation P (USD)	31.03.2022	1,50%
Capitalisation P Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	1,52%
Capitalisation X (USD)	31.03.2022	1,80%
Capitalisation X Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	1,82%
Distribution I Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	0,90%
Distribution P (USD)	31.03.2022	1,46%
Distribution X Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	1,82%
Distribution X (M) (USD)	31.03.2022	1,80%
Distribution X (M) Hedged (i) (AUD)	31.03.2022	1,82%
Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR)	31.03.2022	1,82%
Distribution Y (M) (USD)	31.03.2022	2,80%
Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD)	31.03.2022	2,82%
Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR)	31.03.2022	2,82%
<b>Portfolioumsatz in %*</b>	31.03.2022	27,22%

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

## NN (L) Frontier Markets Debt (Hard Currency)

(ausgedrückt in USD)

### Finanzabschlüsse

#### Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022

	Erläuterungen	
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	2	<b>248.147.088,66</b>
Anleihen und andere Schuldtitel		248.147.088,66
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	2	<b>134.015,20</b>
Futures		134.015,20
<b>Bankguthaben</b>		<b>22.181.925,83</b>
<b>Hinterlegte Sicherheiten</b>		<b>547.403,98</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte</b>	4	<b>24.615.496,01</b>
<b>Vermögenswerte Gesamt</b>		<b>295.625.929,68</b>
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>	4, 12	<b>(20.318.304,60)</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	2	<b>(94.504,46)</b>
Devisentermingeschäfte		(94.504,46)
<b>Verbindlichkeiten Gesamt</b>		<b>(20.412.809,06)</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Berichtszeitraums</b>		<b>275.213.120,62</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Frontier Markets Debt (Hard Currency)

(ausgedrückt in USD)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW	Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW
<b>Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>					6.705.000	ANGOLAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 9.125% 26/11/2049 EMTN	USD	6.534.008,96	2,37
					4.420.000	ANGOLAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 9.375% 08/05/2048	USD	4.344.670,03	1,58
								<b>14.474.774,46</b>	<b>5,26</b>
<b>Anleihen und andere Schuldtitel</b>					<b>Pakistan</b>				
<b>Nigeria</b>					2.525.000	PAKISTAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.000% 08/04/2026 EMTN	USD	1.936.506,84	0,70
1.555.000	NIGERIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.125% 28/09/2028 EMTN	USD	1.426.745,06	0,52	6.900.000	PAKISTAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.875% 05/12/2027	USD	5.294.593,97	1,93
4.250.000	NIGERIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.500% 28/11/2027 EMTN	USD	4.032.132,29	1,47	2.500.000	PAKISTAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.375% 08/04/2031 EMTN	USD	1.787.728,08	0,65
1.735.000	NIGERIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.375% 28/09/2033 EMTN	USD	1.578.341,54	0,57	3.270.000	PAKISTAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.875% 31/03/2036	USD	2.183.834,38	0,79
1.150.000	NIGERIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.625% 21/11/2025	USD	1.195.108,95	0,43	3.800.000	PAKISTAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 8.875% 08/04/2051 EMTN	USD	2.549.198,95	0,93
2.405.000	NIGERIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.625% 28/11/2047 EMTN	USD	1.994.688,19	0,72	300.000	PAKISTAN WATER & POWER DEVELOPMENT AUTHORITY 7.500% 04/06/2031	USD	194.494,45	0,07
12.200.000	NIGERIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.696% 23/02/2038	USD	10.657.836,19	3,88				<b>13.946.356,67</b>	<b>5,07</b>
5.315.000	NIGERIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 8.250% 28/09/2051 EMTN	USD	4.635.307,38	1,68	<b>Paraguay</b>				
240.000	NIGERIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 8.375% 24/03/2029 EMTN	USD	242.333,23	0,09	800.000	PARAGUAY GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 2.739% 29/01/2033	USD	706.883,14	0,26
3.160.000	NIGERIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 9.248% 21/01/2049	USD	3.010.615,71	1,09	575.000	PARAGUAY GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.950% 28/04/2031	USD	603.306,42	0,22
			<b>28.773.108,54</b>	<b>10,45</b>	5.235.000	PARAGUAY GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.400% 30/03/2050	USD	5.282.743,78	1,92
<b>Ghana</b>					1.940.000	PARAGUAY GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.600% 13/03/2048	USD	1.989.053,89	0,72
1.210.000	GHANA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND ZCP 07/04/2025	USD	788.131,96	0,29	1.365.000	PARAGUAY GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.100% 11/08/2044	USD	1.512.717,08	0,55
200.000	GHANA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 10.750% 14/10/2030	USD	210.619,43	0,08				<b>10.094.704,31</b>	<b>3,67</b>
3.570.000	GHANA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.375% 11/02/2027	USD	2.674.881,23	0,97	<b>Jordanien</b>				
2.470.000	GHANA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.875% 11/02/2035	USD	1.721.281,45	0,63	790.000	JORDAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.950% 07/07/2025	USD	788.432,67	0,29
1.620.000	GHANA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 8.125% 18/01/2026	USD	1.370.604,21	0,50	200.000	JORDAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.750% 31/01/2027	USD	198.287,61	0,07
3.780.000	GHANA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 8.125% 26/03/2032	USD	2.710.378,73	0,98	3.890.000	JORDAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.850% 07/07/2030	USD	3.637.296,89	1,32
1.720.000	GHANA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 8.625% 07/04/2034	USD	1.214.390,61	0,44	5.905.000	JORDAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.375% 10/10/2047	USD	5.379.553,61	1,95
8.702.000	GHANA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 8.627% 16/06/2049	USD	6.013.042,32	2,18				<b>10.003.570,78</b>	<b>3,63</b>
3.220.000	GHANA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 8.750% 11/03/2061	USD	2.218.404,57	0,81	<b>Costa Rica</b>				
1.690.000	GHANA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 8.875% 07/05/2042	USD	1.175.259,61	0,43	396.600	AUTOPISTAS DEL SOL SA/COSTA RICA 7.375% 30/12/2030	USD	392.464,43	0,14
3.725.000	GHANA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 8.950% 26/03/2051	USD	2.571.508,16	0,93	700.000	COSTA RICA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.625% 30/04/2043	USD	610.135,17	0,22
			<b>22.668.502,28</b>	<b>8,24</b>	500.000	COSTA RICA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.125% 19/02/2031	USD	507.736,34	0,18
<b>Sri Lanka</b>					1.500.000	COSTA RICA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.000% 04/04/2044	USD	1.474.882,53	0,54
3.635.000	SRI LANKA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.125% 03/06/2025	USD	1.789.023,37	0,65	2.585.000	COSTA RICA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.158% 12/03/2045	USD	2.564.340,21	0,93
4.875.000	SRI LANKA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.200% 11/05/2027	USD	2.331.039,31	0,85	4.800.000	INSTITUTO COSTARRICENSE DE ELECTRICIDAD 6.375% 15/05/2043	USD	3.922.264,18	1,43
500.000	SRI LANKA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.350% 28/06/2024	USD	249.722,56	0,09	304.000	INSTITUTO COSTARRICENSE DE ELECTRICIDAD 6.750% 07/10/2031	USD	304.227,22	0,11
5.290.000	SRI LANKA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.750% 18/04/2028	USD	2.505.725,89	0,91				<b>9.776.050,08</b>	<b>3,55</b>
13.890.000	SRI LANKA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.850% 03/11/2025	USD	6.820.237,80	2,48	<b>Jamaika</b>				
300.000	SRI LANKA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.850% 14/03/2024	USD	148.887,81	0,05	7.450.000	JAMAICA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.875% 28/07/2045	USD	9.655.687,30	3,51
1.850.000	SRI LANKA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.550% 28/03/2030	USD	875.808,30	0,32				<b>9.655.687,30</b>	<b>3,51</b>
4.450.000	SRI LANKA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.850% 14/03/2029	USD	2.119.764,09	0,77	<b>Guatemala</b>				
1.400.000	SRI LANKAN AIRLINES LTD 7.000% 25/06/2024	USD	652.452,74	0,24	200.000	GUATEMALA GOVERNMENT BOND 3.700% 07/10/2033	USD	185.065,21	0,07
			<b>17.492.661,87</b>	<b>6,36</b>	700.000	GUATEMALA GOVERNMENT BOND 4.375% 05/06/2027	USD	706.443,50	0,26
<b>Angola</b>					765.000	GUATEMALA GOVERNMENT BOND 4.650% 07/10/2041	USD	713.102,01	0,26
930.000	ANGOLAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 8.000% 26/11/2029 EMTN	USD	934.071,19	0,34	220.000	GUATEMALA GOVERNMENT BOND 5.375% 24/04/2032	USD	230.000,11	0,08
2.620.000	ANGOLAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 8.250% 09/05/2028	USD	2.662.024,28	0,97					

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.



## NN (L) Frontier Markets Debt (Hard Currency)

(ausgedrückt in USD)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW	Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW
6.585.000	GUATEMALA GOVERNMENT BOND 6.125% 01/06/2050	USD	6.898.299,48	2,50					
	<b>Aserbaidtschan</b>		<b>8.732.910,31</b>	<b>3,17</b>					
3.070.000	REPUBLIC OF AZERBAIJAN INTERNATIONAL BOND 3.500% 01/09/2032	USD	2.861.389,85	1,04					
5.000.000	REPUBLIC OF AZERBAIJAN INTERNATIONAL BOND 5.125% 01/09/2029	USD	5.121.634,70	1,86					
	<b>Irak</b>		<b>7.983.024,55</b>	<b>2,90</b>					
7.699.500	IRAQ INTERNATIONAL BOND 5.800% 15/01/2028	USD	7.508.867,21	2,73					
	<b>El Salvador</b>		<b>7.508.867,21</b>	<b>2,73</b>					
900.000	EL SALVADOR GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.875% 30/01/2025	USD	501.727,37	0,18					
240.000	EL SALVADOR GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.124% 20/01/2050	USD	107.538,52	0,04					
5.010.000	EL SALVADOR GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.125% 20/01/2050	USD	2.244.866,57	0,82					
6.055.000	EL SALVADOR GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.625% 01/02/2041	USD	2.844.374,28	1,02					
1.309.000	EL SALVADOR GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.625% 21/09/2034	USD	602.520,12	0,22					
500.000	EL SALVADOR GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.650% 15/06/2035	USD	237.888,49	0,09					
1.700.000	EL SALVADOR GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 9.500% 15/07/2052	USD	820.553,55	0,30					
	<b>Kenia</b>		<b>7.359.468,90</b>	<b>2,67</b>					
2.460.000	REPUBLIC OF KENYA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.300% 23/01/2034	USD	2.116.997,03	0,77					
5.505.000	REPUBLIC OF KENYA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 8.250% 28/02/2048	USD	4.915.884,13	1,79					
	<b>Gabun</b>		<b>7.032.881,16</b>	<b>2,56</b>					
2.830.000	GABON GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.950% 16/06/2025	USD	2.871.991,40	1,04					
3.210.000	GABON GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.000% 24/11/2031	USD	3.079.634,65	1,12					
	<b>Sambia</b>		<b>5.951.626,05</b>	<b>2,16</b>					
7.400.000	ZAMBIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 8.970% 30/07/2027	USD	5.247.327,64	1,91					
	<b>Uzbekistan</b>		<b>5.247.327,64</b>	<b>1,91</b>					
1.500.000	REPUBLIC OF UZBEKISTAN INTERNATIONAL BOND 3.700% 25/11/2030 EMTN	USD	1.302.829,79	0,47					
2.579.000	REPUBLIC OF UZBEKISTAN INTERNATIONAL BOND 3.900% 19/10/2031	USD	2.243.607,21	0,82					
1.375.000	UZBEKNEFTEGAZ JSC 4.750% 16/11/2028	USD	1.121.457,36	0,41					
	<b>Papua-Neuguinea</b>		<b>4.667.894,36</b>	<b>1,70</b>					
5.370.000	PAPUA NEW GUINEA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 8.375% 04/10/2028	USD	4.611.355,61	1,68					
	<b>Honduras</b>		<b>4.611.355,61</b>	<b>1,68</b>					
1.200.000	HONDURAS GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.625% 24/06/2030	USD	1.085.616,07	0,39					
3.000.000	HONDURAS GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.250% 19/01/2027	USD	2.848.738,62	1,04					
	<b>Elfenbeinküste</b>		<b>3.934.354,69</b>	<b>1,43</b>					
1.035.000	IVORY COAST GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.875% 30/01/2032	EUR	1.013.029,05	0,37					
125.000	IVORY COAST GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.875% 17/10/2031	EUR	128.757,85	0,05					
400.000	IVORY COAST GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.125% 15/06/2033	USD	388.540,96	0,14					
2.005.000	IVORY COAST GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.625% 22/03/2048	EUR	1.946.187,68	0,71					
335.000	IVORY COAST GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.875% 17/10/2040	EUR	338.981,70	0,12					
	<b>Senegal</b>		<b>3.815.497,24</b>	<b>1,39</b>					
1.381.000	SENEGAL GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.375% 08/06/2037	EUR	1.305.349,62	0,47					
2.600.000	SENEGAL GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.750% 13/03/2048	USD	2.243.489,20	0,82					
	<b>Ecuador</b>		<b>3.548.838,82</b>	<b>1,29</b>					
225.815	ECUADOR GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND ZCP 31/07/2030	USD	125.816,23	0,05					
2.300.000	ECUADOR GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 0.500% 31/07/2040 STEP-UP	USD	1.322.265,88	0,48					
1.733.550	ECUADOR GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 1.000% 31/07/2035 STEP-UP	USD	1.134.618,60	0,41					
661.500	ECUADOR GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.000% 31/07/2030 STEP-UP	USD	551.501,28	0,20					
	<b>Bahrain</b>		<b>3.134.201,99</b>	<b>1,14</b>					
625.000	BAHRAIN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.250% 25/01/2028 EMTN	USD	605.185,18	0,22					
1.388.000	BAHRAIN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.250% 25/01/2033 EMTN	USD	1.282.610,96	0,47					
1.259.000	BAHRAIN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.250% 25/01/2051 EMTN	USD	1.108.711,94	0,40					
	<b>Tunesien</b>		<b>2.996.508,08</b>	<b>1,09</b>					
300.000.000	TUNISIAN REPUBLIC 3.500% 03/02/2033	JPY	1.219.887,89	0,44					
200.000	TUNISIAN REPUBLIC 5.625% 17/02/2024	EUR	152.199,59	0,06					
1.800.000	TUNISIAN REPUBLIC 5.750% 30/01/2025	USD	1.214.759,30	0,44					
	<b>Argentinien</b>		<b>2.586.846,78</b>	<b>0,94</b>					
40.353	ARGENTINE REPUBLIC GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 0.500% 09/07/2029	EUR	14.198,65	0,01					
635.350	ARGENTINE REPUBLIC GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 0.750% 09/07/2035 STEP-UP	EUR	193.710,57	0,07					
100.000	ARGENTINE REPUBLIC GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 1.000% 09/07/2029	USD	34.389,73	0,01					
4.900.000	ARGENTINE REPUBLIC GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 1.125% 09/07/2035 STEP-UP	USD	1.502.297,42	0,55					
1.300.000	ARGENTINE REPUBLIC GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 1.125% 09/07/2046 STEP-UP	USD	409.216,91	0,15					
500.000	ARGENTINE REPUBLIC GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 1.500% 09/07/2041 STEP-UP	EUR	165.481,95	0,06					
7.700.000	ARGENTINE REPUBLIC GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 15/12/2035 FRN	USD	42.326,59	0,01					
	<b>Mosambik</b>		<b>2.361.621,82</b>	<b>0,86</b>					
2.700.000	MOZAMBIQUE INTERNATIONAL BOND 5.000% 15/09/2031 STEP-UP	USD	2.323.079,49	0,84					
	<b>Mosambik</b>		<b>2.323.079,49</b>	<b>0,84</b>					

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Frontier Markets Debt (Hard Currency)

(ausgedrückt in USD)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW	Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW
<b>Ägypten</b>					<b>Tadschikistan</b>				
1.351.000	EGYPT GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.500% 16/02/2061 EMTN	USD	1.070.476,12	0,39	1.630.000	REPUBLIC OF TAJIKISTAN INTERNATIONAL BOND 7.125% 14/09/2027	USD	1.222.006,45	0,44
379.000	EGYPT GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 8.700% 01/03/2049	USD	323.133,68	0,12				<b>1.222.006,45</b>	<b>0,44</b>
930.000	EGYPT GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 8.750% 30/09/2051 EMTN	USD	797.976,83	0,29	<b>Mexiko</b>				
			<b>2.191.586,63</b>	<b>0,80</b>	300.000	PETROLEOS MEXICANOS 5.500% 27/06/2044	USD	225.946,95	0,08
<b>Dominikanische Republik</b>					1.200.000	PETROLEOS MEXICANOS 5.625% 23/01/2046	USD	906.784,94	0,33
350.000	BANCO DE RESERVAS DE LA REPUBLICA DOMINICANA 7.000% 01/02/2023	USD	355.260,02	0,13				<b>1.132.731,89</b>	<b>0,41</b>
380.000	DOMINICAN REPUBLIC INTERNATIONAL BOND 4.500% 30/01/2030	USD	349.799,56	0,13	<b>Weißrussland</b>				
600.000	DOMINICAN REPUBLIC INTERNATIONAL BOND 5.300% 21/01/2041	USD	523.316,18	0,19	2.485.000	DEVELOPMENT BANK OF THE REPUBLIC OF BELARUS JSC 6.750% 02/05/2024	USD	146.078,61	0,05
1.090.000	DOMINICAN REPUBLIC INTERNATIONAL BOND 5.875% 30/01/2060	USD	931.027,28	0,33	1.200.000	REPUBLIC OF BELARUS INTERNATIONAL BOND 6.378% 24/02/2031	USD	156.000,00	0,06
			<b>2.159.403,04</b>	<b>0,78</b>	5.570.000	REPUBLIC OF BELARUS INTERNATIONAL BOND 7.625% 29/06/2027	USD	818.118,09	0,30
<b>Armenien</b>								<b>1.120.196,70</b>	<b>0,41</b>
2.713.000	REPUBLIC OF ARMENIA INTERNATIONAL BOND 3.600% 02/02/2031	USD	2.148.640,44	0,78	<b>Montenegro</b>				
			<b>2.148.640,44</b>	<b>0,78</b>	1.125.000	MONTENEGRO GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 2.875% 16/12/2027	EUR	1.077.958,61	0,39
<b>Bahamas</b>								<b>1.077.958,61</b>	<b>0,39</b>
200.000	BAHAMAS GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.000% 21/11/2028	USD	154.748,76	0,06	<b>Niederlande</b>				
1.975.000	BAHAMAS GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 8.950% 15/10/2032	USD	1.594.222,92	0,58	950.000	BOI FINANCE BV 7.500% 16/02/2027	EUR	1.043.756,04	0,38
			<b>1.748.971,68</b>	<b>0,64</b>				<b>1.043.756,04</b>	<b>0,38</b>
<b>Vereinigtes Königreich</b>					<b>Türkei</b>				
516.188	PETRA DIAMONDS US TREASURY PLC 10.500% 08/03/2026	USD	538.696,82	0,20	600.000	ISTANBUL METROPOLITAN MUNICIPALITY 6.375% 09/12/2025	USD	549.440,99	0,20
1.100.000	TULLOW OIL PLC 7.000% 01/03/2025	USD	916.711,77	0,32	505.000	TURKEY GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.500% 20/09/2033	USD	441.259,31	0,16
364.000	UKRAINE RAILWAYS VIA RAIL CAPITAL MARKETS PLC 7.875% 15/07/2026	USD	102.655,96	0,04				<b>990.700,30</b>	<b>0,36</b>
580.000	UKRAINE RAILWAYS VIA RAIL CAPITAL MARKETS PLC 8.250% 09/07/2024	USD	171.229,05	0,06	<b>Barbados</b>				
			<b>1.729.293,60</b>	<b>0,62</b>	1.016.400	BARBADOS GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.500% 01/10/2029	USD	976.552,90	0,35
<b>Kaimaninseln</b>								<b>976.552,90</b>	<b>0,35</b>
1.577.545	BIOCEANICO SOVEREIGN CERTIFICATE LTD ZCP 05/06/2034	USD	1.145.889,36	0,42	<b>Oman</b>				
437.000	MALDIVES SUKUK ISSUANCE LTD 9.875% 08/04/2026	USD	414.095,20	0,15	210.000	OMAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.875% 01/02/2025 EMTN	USD	214.207,73	0,08
			<b>1.559.984,56</b>	<b>0,57</b>	200.000	OMAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.250% 25/01/2031	USD	212.006,36	0,08
<b>Georgien</b>					300.000	OMAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.750% 17/01/2048	USD	300.001,62	0,10
1.746.000	GEORGIAN RAILWAY JSC 4.000% 17/06/2028	USD	1.494.952,21	0,54	240.000	OQ SAOC 5.125% 06/05/2028	USD	237.192,70	0,09
			<b>1.494.952,21</b>	<b>0,54</b>				<b>963.408,41</b>	<b>0,35</b>
<b>Ukraine</b>					<b>Benin</b>				
490.000	NPC UKRENERGO 6.875% 09/11/2026	USD	183.387,25	0,07	557.000	BENIN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.950% 22/01/2035	EUR	505.424,70	0,18
900.000	STATE AGENCY OF ROADS OF UKRAINE 6.250% 24/06/2028	USD	336.445,02	0,12	458.000	BENIN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.875% 19/01/2052	EUR	427.348,36	0,16
3.000.000	UKRAINE GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 31/05/2040 FRN	USD	936.569,76	0,34				<b>932.773,06</b>	<b>0,34</b>
			<b>1.456.402,03</b>	<b>0,53</b>	<b>Albanien</b>				
<b>Bolivien</b>					600.000	ALBANIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.500% 23/11/2031	EUR	578.035,12	0,21
1.000.000	BOLIVIAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.500% 20/03/2028	USD	870.744,00	0,32				<b>578.035,12</b>	<b>0,21</b>
565.000	BOLIVIAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.500% 02/03/2030	USD	559.928,68	0,20	<b>Venezuela</b>				
			<b>1.430.672,68</b>	<b>0,52</b>	4.225.000	VENEZUELA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 9.375% 13/01/2034 - DEFAULTED	USD	374.758,98	0,14
								<b>374.758,98</b>	<b>0,14</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Frontier Markets Debt (Hard Currency)

(ausgedrückt in USD)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW
<b>Mongolei</b>				
200.000	MONGOLIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.500% 07/07/2027	USD	181.917,49	0,06
200.000	MONGOLIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.450% 07/07/2031	USD	180.735,74	0,07
			<b>362.653,23</b>	<b>0,13</b>
<b>Libanon</b>				
200.000	LEBANON GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.650% 22/04/2024	USD	23.566,69	0,01
2.000.000	LEBANON GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.250% 23/03/2037	USD	239.365,14	0,08
200.000	LEBANON GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 8.250% 12/04/2021 EMTN	USD	23.709,14	0,01
			<b>286.640,97</b>	<b>0,10</b>
<b>Mazedonien</b>				
275.000	NORTH MACEDONIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 1.625% 10/03/2028	EUR	267.491,40	0,10
			<b>267.491,40</b>	<b>0,10</b>
<b>Marokko</b>				
257.000	OCP SA 5.125% 23/06/2051	USD	215.796,73	0,08
			<b>215.796,73</b>	<b>0,08</b>
<b>Irland</b>				
0,01	SADEREA DAC 12.500% 30/11/2026 EMTN	USD	0,01	0,00
			<b>0,01</b>	<b>0,00</b>
			<b>248.147.088,66</b>	<b>90,17</b>
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>			<b>248.147.088,66</b>	<b>90,17</b>

### Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022

Zu erhalten	Zu zahlen	Fälligkeits- datum	Engagement in USD	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in USD
<b>Devisentermingeschäfte</b>				
33.254.517,08	ZAR	2.161.876,61 USD 19/04/2022	2.161.876,61	109.554,22
1.388.520,22	USD	158.500.000,00 JPY 28/04/2022	1.388.520,22	82.050,79
406.419,06	AUD	295.529,62 USD 19/04/2022	295.529,62	9.723,63
34.630,83	USD	500.502,00 ZAR 04/04/2022	34.630,83	379,20
7.703,13	USD	6.899,66 EUR 04/04/2022	7.703,13	26,22
6.247,57	EUR	6.936,36 USD 01/04/2022	6.936,36	15,00
330,29	USD	4.800,00 ZAR 01/04/2022	330,29	1,80
368,07	USD	489,10 AUD 04/04/2022	368,07	0,78
14.985,33	USD	13.497,26 EUR 01/04/2022	14.985,33	(32,40)
38.722,08	EUR	43.231,27 USD 04/04/2022	43.231,27	(147,14)
28.665,58	USD	39.242,24 AUD 19/04/2022	28.665,58	(808,49)
412.305,37	USD	6.315.885,07 ZAR 19/04/2022	412.305,37	(19.097,56)
9.473.464,12	USD	8.550.000,00 EUR 30/06/2022	9.473.464,12	(73.538,96)
6.892.897,46	USD	6.264.790,76 EUR 19/04/2022	6.892.897,46	(80.649,78)

Zu erhalten	Zu zahlen	Fälligkeits- datum	Engagement in USD	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in USD
56.951.709,25	EUR	63.516.826,02 USD 19/04/2022	63.516.826,02	(121.981,77)
			<b>84.278.270,28</b>	<b>(94.504,46)</b>
<b>Zins-Futures</b>				
(16)	EURO-BOBL FUTURE 08/06/2022	EUR	2.294.017,22	41.123,54
(15)	EURO-BUND FUTURE 08/06/2022	EUR	2.647.995,69	129.334,81
(9)	EURO-BUXL 30Y BOND 08/06/2022	EUR	1.864.578,84	152.004,33
(136)	US LONG BOND (CBT) 21/06/2022	USD	20.408.500,00	732.062,51
(23)	US ULTRA BOND (CBT) 21/06/2022	USD	4.073.875,00	216.221,40
130	US 10YR NOTE (CBT) 21/06/2022	USD	15.973.750,00	(484.812,50)
90	US 2YR NOTE (CBT) 30/06/2022	USD	19.072.968,84	(123.391,81)
176	US 5YR NOTE (CBT) 30/06/2022	USD	20.185.000,00	(528.527,08)
			<b>86.520.685,59</b>	<b>134.015,20</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>				<b>39.510,74</b>

### Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick

		% NIW
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	<b>248.147.088,66</b>	<b>90,17</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	<b>39.510,74</b>	<b>0,01</b>
<b>Bankguthaben</b>	<b>22.181.925,83</b>	<b>8,06</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>	<b>4.844.595,39</b>	<b>1,76</b>
<b>Nettovermögen Gesamt</b>	<b>275.213.120,62</b>	<b>100,00</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Global Bond Opportunities

(ausgedrückt in EUR)

### Statistische Angaben

<b>Nettovermögen</b>	31.03.2022	EUR	53.278.850,83	Distribution P (EUR)	31.03.2022	EUR	231,36
	30.09.2021	EUR	60.444.945,35		30.09.2021	EUR	244,86
	30.09.2020	EUR	65.144.281,05		30.09.2020	EUR	234,75
<b>Nettoinventarwert pro Anteil**</b>				Distribution P Hedged (iii) (EUR)	31.03.2022	EUR	274,15
					30.09.2021	EUR	297,75
					30.09.2020	EUR	290,43
Capitalisation I (EUR)	31.03.2022	EUR	18.153,11	Distribution P (Q) (USD)	31.03.2022	USD	498,27
	30.09.2021	EUR	19.137,49		30.09.2021	USD	548,46
	30.09.2020	EUR	18.174,27		30.09.2020	USD	530,40
Capitalisation I Hedged (iii) (EUR)	31.03.2022	EUR	4.333,99	Distribution R (EUR)	31.03.2022	EUR	231,52
	30.09.2021	EUR	4.689,65		30.09.2021	EUR	245,48
	30.09.2020	EUR	4.533,54		30.09.2020	EUR	235,31
Capitalisation I Hedged (iii) (PLN)	31.03.2022	PLN	19.056,44	Distribution R Hedged (iii) (EUR)	31.03.2022	EUR	274,81
	30.09.2021	PLN	20.352,04		30.09.2021	EUR	298,36
	30.09.2020	PLN	19.579,90		30.09.2020	EUR	291,04
Capitalisation P (EUR)	31.03.2022	EUR	860,44	Distribution R (Q) (USD)	31.03.2022	USD	499,82
	30.09.2021	EUR	909,17		30.09.2021	USD	550,19
	30.09.2020	EUR	867,38		30.09.2020	USD	531,99
Capitalisation P (USD)	31.03.2022	USD	915,92	Distribution X (M) (USD)	31.03.2022	USD	85,45
	30.09.2021	USD	1.008,07		30.09.2021	USD	94,16
	30.09.2020	USD	973,10		30.09.2020	USD	91,21
Capitalisation P Hedged (iii) (EUR)	31.03.2022	EUR	203,72	<b>Anzahl der Anteile</b>			
	30.09.2021	EUR	220,90				
	30.09.2020	EUR	214,44				
Capitalisation R (EUR)	31.03.2022	EUR	874,80	Capitalisation I (EUR)	31.03.2022		521
	30.09.2021	EUR	922,55		30.09.2021		520
	30.09.2020	EUR	876,69		30.09.2020		520
Capitalisation R (USD)	31.03.2022	USD	930,89	Capitalisation I Hedged (iii) (EUR)	31.03.2022		127
	30.09.2021	USD	1.022,52		30.09.2021		154
	30.09.2020	USD	983,22		30.09.2020		214
Capitalisation R Hedged (iii) (EUR)	31.03.2022	EUR	207,19	Capitalisation I Hedged (iii) (PLN)	31.03.2022		2.285
	30.09.2021	EUR	224,26		30.09.2021		2.285
	30.09.2020	EUR	216,83		30.09.2020		2.094
Capitalisation X (EUR)	31.03.2022	EUR	834,84	Capitalisation P (EUR)	31.03.2022		3.139
	30.09.2021	EUR	883,22		30.09.2021		3.765
	30.09.2020	EUR	844,73		30.09.2020		4.798
Capitalisation X (USD)	31.03.2022	USD	888,40	Capitalisation P (USD)	31.03.2022		3.309
	30.09.2021	USD	979,00		30.09.2021		3.874
	30.09.2020	USD	947,39		30.09.2020		4.878
Capitalisation X Hedged (iii) (EUR)	31.03.2022	EUR	197,94	Capitalisation P Hedged (iii) (EUR)	31.03.2022		60.087
	30.09.2021	EUR	215,08		30.09.2021		61.319
	30.09.2020	EUR	209,42		30.09.2020		62.255
Distribution N Hedged (iii) (EUR)	31.03.2022	EUR	20,11	Capitalisation R (EUR)	31.03.2022		175
	30.09.2021	EUR	21,88		30.09.2021		175
	30.09.2020	EUR	21,35		30.09.2020		362

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

## NN (L) Global Bond Opportunities

(ausgedrückt in EUR)

### Statistische Angaben (Fortsetzung)

### Dividende

			Distribution N Hedged (iii) (EUR)	14.12.2021	EUR	0,10
Capitalisation R (USD)	31.03.2022	168	Distribution P (EUR)	14.12.2021	EUR	0,40
	30.09.2021	252	Distribution P Hedged (iii) (EUR)	14.12.2021	EUR	0,40
	30.09.2020	287	Distribution P (Q) (USD)	11.02.2022	USD	0,06
Capitalisation R Hedged (iii) (EUR)	31.03.2022	231	Distribution P (Q) (USD)	11.11.2021	USD	-
	30.09.2021	303	Distribution R (EUR)	14.12.2021	EUR	1,35
	30.09.2020	303	Distribution R Hedged (iii) (EUR)	14.12.2021	EUR	1,60
Capitalisation X (EUR)	31.03.2022	726	Distribution R (Q) (USD)	11.02.2022	USD	0,59
	30.09.2021	864	Distribution R (Q) (USD)	11.11.2021	USD	0,55
	30.09.2020	1.367	Distribution X (M) (USD)	02.03.2022	USD	-
Capitalisation X (USD)	31.03.2022	1.856	Distribution X (M) (USD)	02.02.2022	USD	-
	30.09.2021	2.102	Distribution X (M) (USD)	04.01.2022	USD	-
	30.09.2020	3.454	Distribution X (M) (USD)	02.12.2021	USD	-
Capitalisation X Hedged (iii) (EUR)	31.03.2022	1.778	Distribution X (M) (USD)	02.11.2021	USD	-
	30.09.2021	3.629	Distribution X (M) (USD)	04.10.2021	USD	-
	30.09.2020	4.936				
Distribution N Hedged (iii) (EUR)	31.03.2022	2.181				
	30.09.2021	2.180				
	30.09.2020	2.789				
Distribution P (EUR)	31.03.2022	6.106				
	30.09.2021	6.688				
	30.09.2020	8.004				
Distribution P Hedged (iii) (EUR)	31.03.2022	35.019				
	30.09.2021	37.197				
	30.09.2020	44.897				
			<b>Laufende Kosten in %*</b>			
Distribution P (Q) (USD)	31.03.2022	3.922	Capitalisation I (EUR)	31.03.2022		0,49%
	30.09.2021	4.373	Capitalisation I Hedged (iii) (EUR)	31.03.2022		0,51%
	30.09.2020	5.413	Capitalisation I Hedged (iii) (PLN)	31.03.2022		0,51%
Distribution R (EUR)	31.03.2022	947	Capitalisation P (EUR)	31.03.2022		0,95%
	30.09.2021	947	Capitalisation P (USD)	31.03.2022		0,95%
	30.09.2020	2.039	Capitalisation P Hedged (iii) (EUR)	31.03.2022		0,97%
Distribution R Hedged (iii) (EUR)	31.03.2022	150	Capitalisation R (EUR)	31.03.2022		0,56%
	30.09.2021	224	Capitalisation R (USD)	31.03.2022		0,56%
	30.09.2020	389	Capitalisation R Hedged (iii) (EUR)	31.03.2022		0,58%
Distribution R (Q) (USD)	31.03.2022	200	Capitalisation X (EUR)	31.03.2022		1,20%
	30.09.2021	260	Capitalisation X (USD)	31.03.2022		1,20%
	30.09.2020	341	Capitalisation X Hedged (iii) (EUR)	31.03.2022		1,22%
Distribution X (M) (USD)	31.03.2022	3.507				
	30.09.2021	3.695				
	30.09.2020	4.521				

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

## NN (L) Global Bond Opportunities

(ausgedrückt in EUR)

### Statistische Angaben (Fortsetzung)

Distribution N Hedged (iii) (EUR)	31.03.2022	0,57%
Distribution P (EUR)	31.03.2022	0,95%
Distribution P Hedged (iii) (EUR)	31.03.2022	0,97%
Distribution P (Q) (USD)	31.03.2022	0,95%
Distribution R (EUR)	31.03.2022	0,56%
Distribution R Hedged (iii) (EUR)	31.03.2022	0,58%
Distribution R (Q) (USD)	31.03.2022	0,56%
Distribution X (M) (USD)	31.03.2022	1,20%
<b>Portfolioumsatz in %*</b>	31.03.2022	54,09%

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

## NN (L) Global Bond Opportunities

(ausgedrückt in EUR)

### Finanzabschlüsse

#### Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022

	Erläuterungen	
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	2	<b>45.274.297,39</b>
Anleihen und andere Schuldtitel		45.274.297,39
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	2	<b>1.571.411,78</b>
Devisentermingeschäfte		242.015,30
Futures		1.329.396,48
<b>Bankguthaben</b>		<b>6.504.032,30</b>
<b>Hinterlegte Sicherheiten</b>		<b>167.081,07</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte</b>	4, 12	<b>2.876.286,70</b>
<b>Vermögenswerte Gesamt</b>		<b>56.393.109,24</b>
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>	4, 12	<b>(960.652,31)</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	2	<b>(2.153.606,10)</b>
Credit Default Swaps		(105.539,30)
Inflationsswap		(172.429,18)
Zinsswaps		(1.875.637,62)
<b>Verbindlichkeiten Gesamt</b>		<b>(3.114.258,41)</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Berichtszeitraums</b>		<b>53.278.850,83</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Global Bond Opportunities

(ausgedrückt in EUR)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW	Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
<b>Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>					10.000	BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE 2.500% 04/07/2044	EUR	14.044,41	0,03
					80.000	BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE 4.750% 04/07/2040	EUR	137.323,75	0,26
								<b>7.905.314,82</b>	<b>14,84</b>
<b>Anleihen und andere Schuldtitel</b>					<b>Japan</b>				
<b>Vereinigte Staaten</b>					139.200.000	JAPAN GOVERNMENT TEN YEAR BOND 0.100% 20/03/2026	JPY	1.034.654,13	1,94
200.000	ABBVIE INC 4.050% 21/11/2039	USD	185.425,59	0,35	178.200.000	JAPAN GOVERNMENT TEN YEAR BOND 0.600% 20/12/2023	JPY	1.334.246,79	2,50
300.000	AIR LEASE CORP 3.625% 01/04/2027	USD	264.459,25	0,50	164.650.000	JAPAN GOVERNMENT THIRTY YEAR BOND 1.400% 20/12/2045	JPY	1.382.245,87	2,59
250.000	AMERICAN TOWER CORP 3.950% 15/03/2029	USD	225.735,99	0,42	245.450.000	JAPAN GOVERNMENT TWENTY YEAR BOND 0.600% 20/12/2036	JPY	1.856.679,25	3,49
100.000	AT&T INC 4.850% 01/03/2039	USD	97.860,10	0,18	95.600.000	JAPAN GOVERNMENT TWO YEAR BOND 0.100% 01/06/2022	JPY	708.128,09	1,33
200.000	BAXTER INTERNATIONAL INC 2.539% 01/02/2032	USD	164.368,14	0,31				<b>6.315.954,13</b>	<b>11,85</b>
250.000	BOARDWALK PIPELINES LP 4.450% 15/07/2027	USD	229.755,81	0,43	<b>Frankreich</b>				
100.000	BRIXMOR OPERATING PARTNERSHIP LP 4.050% 01/07/2030	USD	90.152,73	0,17	1.820.489	FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 0.500% 25/05/2072	EUR	1.162.802,20	2,18
210.000	BROADCOM INC 3.187% 15/11/2036	USD	165.849,82	0,31	173.697	FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 1.750% 25/05/2066	EUR	188.914,66	0,35
300.000	BROWN & BROWN INC 2.375% 15/03/2031	USD	237.392,13	0,45	2.736.000	FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 2.000% 25/05/2048	EUR	3.136.821,43	5,90
200.000	CDW LLC / CDW FINANCE CORP 3.569% 01/12/2031	USD	167.013,29	0,31	140.000	FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 4.750% 25/04/2035	EUR	203.218,95	0,38
200.000	CHARTER COMMUNICATIONS OPERATING LLC / CHARTER COMMUNICATIONS OPERATING CAPITAL 4.800% 01/03/2050	USD	171.284,33	0,32				<b>4.691.757,24</b>	<b>8,81</b>
200.000	CITIGROUP INC 31/03/2031 FRN	USD	187.170,82	0,35	<b>China</b>				
190.000	CITIZENS FINANCIAL GROUP INC 3.250% 30/04/2030	USD	166.744,66	0,31	20.000.000	CHINA DEVELOPMENT BANK 3.090% 18/06/2030	CNY	2.820.218,04	5,29
200.000	CVS HEALTH CORP 1.300% 21/08/2027	USD	163.496,80	0,31	3.700.000	CHINA GOVERNMENT BOND 2.940% 17/10/2024	CNY	531.080,95	1,00
350.000	DAE FUNDING LLC 3.375% 20/03/2028	USD	295.219,46	0,55	2.600.000	CHINA GOVERNMENT BOND 3.120% 05/12/2026	CNY	376.308,23	0,71
200.000	DELL INTERNATIONAL LLC / EMC CORP 5.300% 01/10/2029	USD	195.795,71	0,37	3.100.000	CHINA GOVERNMENT BOND 3.130% 21/11/2029	CNY	447.466,66	0,84
250.000	DIAMONDBACK ENERGY INC 3.125% 24/03/2031	USD	214.643,45	0,40	2.400.000	CHINA GOVERNMENT BOND 3.390% 16/03/2050	CNY	337.487,56	0,63
150.000	EOG RESOURCES INC 4.375% 15/04/2030	USD	145.761,07	0,27				<b>4.512.561,44</b>	<b>8,47</b>
200.000	EQUINIX INC 3.200% 18/11/2029	USD	172.695,40	0,32	<b>Italien</b>				
250.000	FREEPORT-MCMORAN INC 4.625% 01/08/2030	USD	229.710,76	0,43	300.000	ENI SPA 4.250% 09/05/2029	USD	278.204,86	0,52
250.000	FULTON FINANCIAL CORP 15/03/2030 FRN	USD	218.497,82	0,41	807.000	ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 4.500% 01/03/2026	EUR	915.463,78	1,72
280.000	GENERAL MILLS INC 4.200% 17/04/2028	USD	262.780,23	0,49	470.000	ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 4.750% 01/09/2044	EUR	665.699,65	1,25
300.000	GOLDMAN SACHS GROUP INC 27/01/2032 FRN	USD	233.513,82	0,44	150.000	ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 5.000% 01/09/2040	EUR	211.304,64	0,40
250.000	LENNAR CORP 4.750% 29/11/2027	USD	234.285,30	0,44				<b>2.070.672,93</b>	<b>3,89</b>
150.000	MARSH & MCLENNAN COS INC 2.375% 15/12/2031	USD	123.591,95	0,23	<b>Vereinigtes Königreich</b>				
50.000	MERCK & CO INC 1.700% 10/06/2027	USD	42.574,04	0,08	200.000	STANDARD CHARTERED PLC 21/05/2025 FRN	USD	180.114,18	0,34
100.000	MERCK & CO INC 2.150% 10/12/2031	USD	83.278,91	0,16	50.000	UNITED KINGDOM GILT 2.250% 07/09/2023	GBP	59.919,72	0,11
100.000	MORGAN STANLEY 22/07/2028 FRN	USD	90.234,68	0,17	650.000	UNITED KINGDOM GILT 3.250% 22/01/2044	GBP	966.297,82	1,81
100.000	MPLX LP 4.700% 15/04/2048	USD	90.604,24	0,17	530.000	UNITED KINGDOM GILT 4.250% 07/06/2032	GBP	781.285,60	1,47
250.000	PLAINS ALL AMERICAN PIPELINE LP / PAA FINANCE CORP 4.900% 15/02/2045	USD	215.066,13	0,40				<b>1.987.617,32</b>	<b>3,73</b>
100.000	PRUDENTIAL FINANCIAL INC 01/10/2050 FRN	USD	82.266,68	0,15	<b>Spanien</b>				
100.000	PRUDENTIAL FINANCIAL INC 3.935% 07/12/2049	USD	91.201,55	0,17	751.000	SPAIN GOVERNMENT BOND 1.600% 30/04/2025	EUR	778.552,61	1,45
300.000	SAMMONS FINANCIAL GROUP INC 4.450% 12/05/2027	USD	277.213,36	0,52	130.000	SPAIN GOVERNMENT BOND 5.150% 31/10/2044	EUR	210.976,44	0,40
93.000	S&P GLOBAL INC 2.900% 01/03/2032	USD	81.112,84	0,15	350.000	SPAIN GOVERNMENT BOND 5.750% 30/07/2032	EUR	498.690,77	0,94
250.000	T-MOBILE USA INC 3.000% 15/02/2041	USD	189.833,54	0,36				<b>1.488.219,82</b>	<b>2,79</b>
5.420.000	UNITED STATES TREASURY NOTE 0.125% 30/06/2022	USD	4.865.925,39	9,14	<b>Kanada</b>				
2.740.000	UNITED STATES TREASURY NOTE 0.250% 30/09/2025	USD	2.274.624,50	4,28	120.000	CANADIAN GOVERNMENT BOND 2.750% 01/06/2022	CAD	86.639,84	0,16
150.000	VMWARE INC 4.700% 15/05/2030	USD	142.488,18	0,27	270.000	CANADIAN GOVERNMENT BOND 4.000% 01/06/2041	CAD	239.781,67	0,45
122.000	WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC 4.100% 15/04/2050	USD	106.117,93	0,20	570.000	CANADIAN GOVERNMENT BOND 5.750% 01/06/2033	CAD	541.810,58	1,02
75.000	WORKDAY INC 3.500% 01/04/2027	USD	67.607,32	0,13	75.000	CANADIAN PACIFIC RAILWAY CO 3.000% 02/12/2041	USD	60.844,64	0,11
			<b>13.543.353,72</b>	<b>25,42</b>					
<b>Deutschland</b>									
3.070.000	BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE ZCP 15/02/2031	EUR	2.943.216,09	5,52					
3.113.430	BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE ZCP 15/08/2026	EUR	3.073.857,81	5,77					
1.700.000	BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE 1.500% 15/05/2023	EUR	1.736.872,76	3,26					

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.



## NN (L) Global Bond Opportunities

(ausgedrückt in EUR)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
200.000	TECK RESOURCES LTD 3.900% 15/07/2030	USD	179.458,70	0,34
			<b>1.108.535,43</b>	<b>2,08</b>
<b>Österreich</b>				
728.000	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 1.750% 20/10/2023	EUR	750.031,05	1,40
186.000	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 2.400% 23/05/2034	EUR	216.030,85	0,41
			<b>966.061,90</b>	<b>1,81</b>
<b>Belgien</b>				
50.000	BELGIUM GOVERNMENT BOND 2.150% 22/06/2066	EUR	59.204,74	0,11
120.000	BELGIUM GOVERNMENT BOND 5.000% 28/03/2035	EUR	175.898,91	0,33
			<b>235.103,65</b>	<b>0,44</b>
<b>Niederlande</b>				
250.000	PROSUS NV 4.193% 19/01/2032	USD	197.001,72	0,37
			<b>197.001,72</b>	<b>0,37</b>
<b>Schweiz</b>				
200.000	UBS GROUP AG 3.491% 23/05/2023	USD	180.020,42	0,34
			<b>180.020,42</b>	<b>0,34</b>
<b>Australien</b>				
40.000	AUSTRALIA GOVERNMENT BOND 5.750% 15/07/2022	AUD	27.415,93	0,05
53.000	SANTOS FINANCE LTD 3.649% 29/04/2031	USD	44.706,92	0,09
			<b>72.122,85</b>	<b>0,14</b>
			<b>45.274.297,39</b>	<b>84,98</b>

**Wertpapierbestand Gesamt 45.274.297,39 84,98**

### Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022

Bezeichnung	Verkauf / Kauf	Zinssatz (%)	Fälligkeits- datum	Währung	Nennwert	Swap-Wert in EUR
<b>Credit Default Swaps</b>						
CDX NORTH AMERICA HIGH YIELD SERIES 38 VERSION 1	Verkauf	5,000	20/06/2027	USD	3.060.000,00	152.512,53
CDX NORTH AMERICA INVESTMENT GRADE SERIES 38 VERSION 1	Verkauf	1,000	20/06/2027	USD	6.920.000,00	100.570,03
CDX ITRAXX EUROPE SUBORDINATED FINANCIAL SERIES 37 VERSION 1	Verkauf	1,000	20/06/2027	EUR	360.000,00	(9.507,81)
CDX NORTH AMERICA INVESTMENT GRADE SERIES 38 VERSION 1	Kauf	1,000	20/06/2027	USD	7.070.000,00	(102.750,01)
CDX ITRAXX EUROPE CROSSOVER SERIES 37 VERSION 1	Kauf	5,000	20/06/2027	EUR	1.510.000,00	(110.099,02)

Bezeichnung	Verkauf / Kauf	Zinssatz (%)	Fälligkeits- datum	Währung	Nennwert	Swap-Wert in EUR
CDX ITRAXX EUROPE SERIES 37 VERSION 1	Kauf	1,000	20/06/2027	EUR	9.970.616,00	(136.265,02)
						<b>(105.539,30)</b>

Zu erhalten (%)	Zu zahlen (%)	Fälligkeits- datum	Währung	Nennwert	Swap-Wert in EUR
-----------------	---------------	-----------------------	---------	----------	---------------------

#### Zinsswaps

Floating	1,016	24/12/2050	USD	8.590.000,00	2.068.264,95
Floating	0,601	21/03/2072	EUR	1.400.000,00	91.277,47
Floating	0,633	18/03/2072	EUR	1.611.608,00	85.153,39
Floating	0,144	05/11/2071	EUR	320.464,00	78.678,01
Floating	0,166	05/11/2071	EUR	320.464,00	75.910,86
Floating	0,173	05/11/2071	EUR	320.464,00	75.030,41
Floating	0,174	05/11/2071	EUR	320.464,00	74.904,63
Floating	0,651	21/03/2072	EUR	1.268.392,00	57.644,41
2,527	Floating	17/01/2047	USD	250.000,00	9.554,61
2,498	Floating	17/01/2037	USD	350.000,00	4.804,41
0,106	Floating	21/10/2023	EUR	3.900.000,00	(11.677,65)
0,484	Floating	14/01/2026	EUR	2.070.000,00	(31.216,61)
1,154	Floating	21/03/2042	EUR	3.066.676,00	(39.962,31)
1,151	Floating	18/03/2042	EUR	3.763.324,00	(51.365,01)
0,139	Floating	19/07/2029	EUR	1.000.000,00	(66.129,79)
1,120	Floating	21/03/2042	EUR	3.600.000,00	(68.788,58)
0,375	Floating	14/01/2032	EUR	3.890.804,00	(290.674,15)
0,369	Floating	14/01/2032	EUR	3.909.196,00	(294.240,57)
0,256	Floating	29/10/2031	EUR	10.640.000,00	(890.669,40)
0,738	Floating	24/12/2030	USD	23.570.000,00	(2.752.136,70)
					<b>(1.875.637,62)</b>

Zu erhalten (%)	Zu zahlen (%)	Fälligkeits- datum	Währung	Nennwert	Swap-Wert in EUR
-----------------	---------------	-----------------------	---------	----------	---------------------

#### Inflationsswaps

2,541	Floating	15/03/2032	EUR	2.316.637,00	(49.861,30)
2,503	Floating	15/03/2032	EUR	2.360.763,00	(61.058,54)
2,500	Floating	15/03/2032	EUR	2.352.600,00	(61.509,34)
					<b>(172.429,18)</b>

Zu erhalten	Zu zahlen	Fälligkeits- datum	Engagement in EUR	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR
-------------	-----------	-----------------------	----------------------	---

#### Devisentermingeschäfte

8.665.565,45	EUR	1.127.500.000,00	JPY	10/06/2022	8.665.565,45	323.565,43
69.900.000,00	NOK	6.932.783,93	EUR	10/06/2022	6.932.783,93	229.941,61
3.190.565,81	EUR	409.491.256,00	JPY	20/04/2022	3.190.565,81	158.885,09
12.914.150.000,00	COP	3.256.354,91	USD	10/06/2022	2.907.502,29	135.047,74
77.610.000,00	MXN	3.311.456,50	EUR	10/06/2022	3.311.456,50	134.528,10

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Global Bond Opportunities

(ausgedrückt in EUR)

### Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Zu erhalten	Zu zahlen	Fälligkeits- datum	Engagement in EUR	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR	Zu erhalten	Zu zahlen	Fälligkeits- datum	Engagement in EUR	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR				
6.238.378,52	PLN	168.293.985,00	JPY	19/04/2022	1.327.623,20	97.017,63	24.984,54	MXN	5.148,75	PLN	20/04/2022	1.092,98	14,10
20.745.431,19	PLN	4.875.226,91	USD	19/04/2022	4.414.947,85	86.346,18	380.475,13	HUF	1.020,42	EUR	20/04/2022	1.020,42	12,85
3.178.653,54	USD	88.070.000,00	TWD	10/06/2022	2.802.798,29	82.243,17	5.504.905,87	COP	6.064,78	PLN	21/04/2022	1.268,93	8,97
5.369.652,18	EUR	5.900.000,00	USD	10/06/2022	5.369.652,18	80.667,43	9.268,00	CHF	9.046,51	EUR	20/04/2022	9.046,51	5,61
3.005.534,80	USD	96.930.000,00	THB	10/06/2022	2.648.281,61	78.669,27	11.061,15	ILS	3.109,21	EUR	20/04/2022	3.109,21	5,26
12.710.911,28	PLN	2.669.259,52	EUR	20/04/2022	2.669.259,52	66.791,07	20.024,51	DKK	2.692,35	EUR	20/04/2022	2.692,35	(0,34)
78.660.000,00	SEK	7.513.800,40	EUR	10/06/2022	7.513.800,40	65.385,03	16.210,58	NOK	1.666,80	EUR	20/04/2022	1.666,80	(1,71)
20.720.000,00	USD	18.532.173,38	EUR	10/06/2022	18.532.173,38	42.023,90	5.610,58	NZD	3.506,71	EUR	20/04/2022	3.506,71	(1,78)
11.540.000,00	ILS	3.582.825,68	USD	10/06/2022	3.182.949,56	36.434,92	1.598,63	NZD	4.652,02	PLN	20/04/2022	974,49	(2,70)
6.800.000,00	AUD	4.563.453,71	EUR	10/06/2022	4.563.453,71	19.482,27	51.410,39	EUR	382.439,24	DKK	20/04/2022	51.410,39	(2,96)
3.735.586,17	PLN	5.553.830,44	CNY	20/04/2022	794.990,37	18.031,54	482.982,51	HUF	6.114,41	PLN	20/04/2022	1.290,00	(4,49)
2.238.587,97	PLN	392.533,30	GBP	20/04/2022	476.406,06	17.625,43	7.229.130,83	COP	1.733,42	EUR	21/04/2022	1.733,42	(7,51)
1.155.062,77	EUR	963.586,86	GBP	20/04/2022	1.155.062,77	15.462,33	8.869,95	PEN	2.150,41	EUR	21/04/2022	2.150,41	(8,81)
825.000,00	CAD	579.554,07	EUR	10/06/2022	579.554,07	12.446,39	7.565,30	SGD	5.030,82	EUR	20/04/2022	5.030,82	(9,46)
1.110.000,00	NZD	681.017,53	EUR	10/06/2022	681.017,53	10.277,51	23.806,90	CZK	4.568,14	PLN	20/04/2022	966,58	(10,91)
847.171,00	EUR	710.000,00	GBP	10/06/2022	847.171,00	9.401,03	5.207,93	EUR	45.503,70	HKD	20/04/2022	5.207,93	(12,53)
1.400.000,00	CHF	1.359.745,68	EUR	10/06/2022	1.359.745,68	8.028,20	33.119,08	SEK	14.897,57	PLN	20/04/2022	3.127,84	(13,34)
2.437.859,51	RUB	18.174,29	EUR	21/04/2022	18.174,29	7.811,26	4.611,09	PEN	5.273,12	PLN	21/04/2022	1.102,79	(21,58)
4.410.000,00	SGD	3.251.459,47	USD	10/06/2022	2.896.762,88	6.256,13	27.437,20	PLN	24.563,45	PEN	21/04/2022	5.839,06	(25,56)
2.588.620.000,00	CLP	3.247.072,30	USD	10/06/2022	2.906.745,60	3.752,73	21.786,64	PLN	4.142.974,00	CLP	21/04/2022	4.636,53	(26,19)
537.457,46	PLN	151.616.750,00	KRW	20/04/2022	114.379,24	3.465,39	4.909,38	ILS	6.550,09	PLN	19/04/2022	1.367,00	(27,76)
933.899,98	RUB	33.715,29	PLN	20/04/2022	6.553,90	2.714,40	156.576,23	THB	4.260,42	EUR	20/04/2022	4.260,42	(29,90)
1.620.000,00	CZK	63.629,55	EUR	10/06/2022	63.629,55	1.982,78	9.673,79	DKK	6.225,57	PLN	20/04/2022	1.300,57	(39,57)
1.351.357,55	PLN	402.412,27	CAD	20/04/2022	287.589,74	1.479,79	3.335,84	SGD	10.493,10	PLN	20/04/2022	2.217,61	(44,54)
239.701,30	PLN	51.679,41	CHF	20/04/2022	51.012,14	1.120,54	78.001.415,00	IDR	4.927,12	EUR	21/04/2022	4.927,12	(46,92)
272.000,51	EUR	366.003.893,00	KRW	21/04/2022	272.000,51	1.105,61	39.909.569,00	IDR	11.893,03	PLN	21/04/2022	2.498,48	(62,70)
138.630,15	PLN	1.068.142,53	THB	20/04/2022	29.502,63	980,46	49.565,80	THB	6.513,41	PLN	20/04/2022	1.364,23	(62,82)
3.652.160.000,00	IDR	253.016,91	USD	10/06/2022	224.201,31	835,44	8.836,88	MYR	9.056,64	PLN	21/04/2022	1.891,60	(65,44)
198.389,78	PLN	670.017.843,00	IDR	21/04/2022	42.220,41	778,20	36.423,71	PLN	2.913.368,40	HUF	20/04/2022	7.751,53	(71,63)
150.938,64	PLN	148.789,82	MYR	21/04/2022	32.122,07	767,98	15.463,56	MYR	3.376,65	EUR	22/04/2022	3.376,65	(80,50)
73.064,90	EUR	2.678.218,83	THB	20/04/2022	73.064,90	702,55	15.462,38	EUR	77.120,28	RON	20/04/2022	15.462,38	(103,65)
74.548,43	CAD	53.114,29	EUR	20/04/2022	53.114,29	498,70	82.482,74	PLN	28.628,25	NZD	20/04/2022	17.553,60	(129,48)
98.953,47	PLN	154.732,46	DKK	20/04/2022	21.058,83	498,43	5.808,38	CHF	26.996,08	PLN	20/04/2022	5.668,85	(137,87)
452.372,13	USD	2.880.000,00	CNY	10/06/2022	398.882,05	347,71	23.512.191,00	KRW	17.544,06	EUR	21/04/2022	17.544,06	(141,70)
93.445,92	PLN	29.798,12	SGD	20/04/2022	19.886,73	336,34	78.876,53	EUR	370.999,04	MYR	22/04/2022	78.876,53	(204,01)
37.010,27	AUD	24.712,70	EUR	20/04/2022	24.712,70	259,33	53.779,42	PLN	288.421,16	CZK	20/04/2022	11.445,09	(204,44)
15.050.000,00	HUF	40.236,98	EUR	10/06/2022	40.236,98	242,36	121.902,02	EUR	125.030,51	CHF	20/04/2022	121.902,02	(216,22)
90.577,34	MXN	3.864,43	EUR	20/04/2022	3.864,43	204,57	45.270,74	PLN	41.800.955,24	COP	21/04/2022	9.634,31	(236,39)
85.040,86	SEK	8.019,70	EUR	20/04/2022	8.019,70	180,05	189.769,77	PLN	426.122,32	SEK	20/04/2022	40.385,94	(238,97)
32.806,41	PLN	34.391,68	RON	19/04/2022	6.981,71	119,75	39.947,40	CAD	134.912,04	PLN	20/04/2022	28.352,30	(311,13)
69.729,71	PLN	52.915,02	ILS	19/04/2022	14.839,56	112,06	15.388.690,00	KRW	54.407,67	PLN	20/04/2022	11.468,71	(320,99)
50.869,73	PLN	105.556,26	NOK	20/04/2022	10.825,86	107,44	48.857,80	EUR	74.117,78	SGD	20/04/2022	48.857,80	(336,85)
86.162,53	CZK	3.413,97	EUR	20/04/2022	3.413,97	105,35	111.331,78	PLN	541.354,87	MXN	20/04/2022	23.693,12	(354,83)
22.999,65	AUD	71.645,07	PLN	20/04/2022	15.172,47	96,85	27.727,11	EUR	273.716,50	NOK	20/04/2022	27.727,11	(388,12)
8.776,82	PLN	16.119,22	HKD	20/04/2022	1.867,84	39,94	12.104,06	EUR	10.980.434,00	CLP	21/04/2022	12.104,06	(392,99)

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Global Bond Opportunities

(ausgedrückt in EUR)

### Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Zu erhalten	Zu zahlen	Fälligkeitsdatum	Engagement in EUR	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR
13.133,62 EUR	56.090,81 PEN	21/04/2022	13.133,62	(409,19)
16.238,33 EUR	6.178.874,52 HUF	20/04/2022	16.238,33	(541,81)
35.922,62 EUR	129.678,87 ILS	20/04/2022	35.922,62	(590,80)
469.996,30 CNY	67.247,55 EUR	21/04/2022	67.247,55	(735,10)
102.051,68 EUR	1.644.224.601,00 IDR	21/04/2022	102.051,68	(820,20)
69.574,03 GBP	83.203,80 EUR	20/04/2022	83.203,80	(921,02)
23.125,72 EUR	101.868.528,35 COP	21/04/2022	23.125,72	(1.194,82)
29.699,61 EUR	757.811,39 CZK	20/04/2022	29.699,61	(1.253,21)
43.409,50 EUR	71.675,40 NZD	20/04/2022	43.409,50	(1.366,10)
309.007,09 CNY	209.621,25 PLN	20/04/2022	43.936,64	(1.386,11)
676.680,30 PLN	218.497,25 AUD	20/04/2022	144.008,01	(1.770,21)
39.817,71 GBP	227.604,93 PLN	20/04/2022	47.695,71	(1.901,43)
59.067,27 EUR	1.366.388,69 MXN	20/04/2022	59.067,27	(2.314,86)
35.559,72 PLN	933.900,00 RUB	20/04/2022	7.567,66	(2.317,38)
99.511,58 EUR	1.063.033,06 SEK	20/04/2022	99.511,58	(2.987,58)
924.324,38 USD	836.027,20 EUR	20/04/2022	836.027,20	(5.671,67)
21.693.316,00 JPY	166.477,53 EUR	20/04/2022	166.477,53	(5.870,41)
19.450,37 EUR	2.437.859,56 RUB	21/04/2022	19.450,37	(6.535,18)
13.588.610,00 JPY	497.866,50 PLN	19/04/2022	104.395,38	(6.576,13)
1.910.372,84 EUR	13.551.235,49 CNY	21/04/2022	1.910.372,84	(7.356,49)
3.121.787,68 USD	239.310.000,00 INR	10/06/2022	2.784.078,91	(8.125,19)
887.121,39 EUR	1.250.000,00 CAD	10/06/2022	887.121,39	(9.849,00)
682.199,76 EUR	3.226.459,23 PLN	20/04/2022	682.199,76	(12.302,41)
345.387,51 EUR	530.560,82 AUD	20/04/2022	345.387,51	(12.598,85)
2.899.114,04 EUR	13.630.000,00 PLN	10/06/2022	2.899.114,04	(12.775,14)
693.073,73 EUR	981.821,76 CAD	20/04/2022	693.073,73	(13.022,93)
462.106,49 USD	1.993.272,97 PLN	19/04/2022	416.664,29	(13.971,80)
1.836.341,84 EUR	18.070.000,00 NOK	10/06/2022	1.836.341,84	(15.309,81)
2.581.196,13 EUR	2.660.000,00 CHF	10/06/2022	2.581.196,13	(17.574,24)
4.576.600.000,00 KRW	3.811.943,09 USD	10/06/2022	3.388.873,79	(38.298,55)
10.629.360,47 EUR	11.882.668,35 USD	20/04/2022	10.629.360,47	(45.289,75)
103.020.000,00 THB	3.154.693,92 USD	10/06/2022	2.820.760,47	(48.045,64)
3.192.911,13 EUR	5.210.000,00 NZD	10/06/2022	3.192.911,13	(51.816,04)
3.590.000,00 GBP	4.288.845,23 EUR	10/06/2022	4.288.845,23	(52.797,05)
4.593.302,10 EUR	48.530.000,00 SEK	10/06/2022	4.593.302,10	(82.745,05)
6.292.259,77 USD	5.090.890.000,00 CLP	10/06/2022	5.611.575,64	(91.260,42)
3.072.543,04 EUR	11.270.000,00 ILS	10/06/2022	3.072.543,04	(99.675,20)
266.000.000,00 JPY	2.070.851,45 EUR	10/06/2022	2.070.851,45	(102.805,32)
3.570.364,57 USD	74.470.000,00 MXN	10/06/2022	3.179.688,75	(105.953,73)
13.950.000,00 PLN	3.452.649,13 USD	10/06/2022	3.070.481,36	(114.832,78)
175.570.000,00 TWD	6.286.567,51 USD	10/06/2022	5.578.494,36	(118.982,51)
6.131.119,13 EUR	9.310.000,00 AUD	10/06/2022	6.131.119,13	(143.459,39)
6.337.116,53 USD	25.098.150.000,00 COP	10/06/2022	5.677.402,37	(254.825,11)
			<b>172.460.032,22</b>	<b>242.015,30</b>

Stückzahl	Bezeichnung	Währung	Engagement in EUR	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR
<b>Zins-Futures</b>				
31	AUSTRALIA 10Y BOND FUTURE 15/06/2022	AUD	2.651.784,27	(106.144,67)
32	AUSTRALIA 3YR BOND FUTURE 15/06/2022	AUD	2.373.304,41	(37.845,64)
(33)	CANADA 10YR BOND FUTURE 21/06/2022	CAD	3.100.171,21	10.309,57
(1)	EURO-BTP FUTURE 08/06/2022	EUR	138.310,00	7.910,00
(46)	EURO-BUND FUTURE 08/06/2022	EUR	7.298.360,00	402.960,00
(14)	EURO-BUXL 30Y BOND 08/06/2022	EUR	2.606.800,00	224.001,37
(85)	EURO-OAT FUTURE 08/06/2022	EUR	12.878.350,00	622.408,52
(13)	EURO-SCHATZ FUTURE 08/06/2022	EUR	1.439.555,00	17.160,00
1	JPN 10Y BOND (OSE) 13/06/2022	JPY	1.108.495,61	(7.849,07)
30	KOREA 3YR BOND FUTURE 21/06/2022	KRW	2.363.139,29	(23.368,36)
(57)	LONG GILT FUTURE 28/06/2022	GBP	8.177.050,98	61.334,33
1	US LONG BOND (CBT) 21/06/2022	USD	134.869,46	(4.065,47)
56	US ULTRA BOND (CBT) 21/06/2022	USD	8.914.753,07	(336.583,83)
3	US 10YR NOTE (CBT) 21/06/2022	USD	331.303,64	(9.525,73)
(128)	US 10YR ULTRA FUTURE 21/06/2022	USD	15.584.415,58	508.695,46
			<b>69.100.662,52</b>	<b>1.329.396,48</b>

**Derivative Finanzinstrumente Gesamt (582.194,32)**

### Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick

		% NIW
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	<b>45.274.297,39</b>	<b>84,98</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	<b>(582.194,32)</b>	<b>(1,09)</b>
<b>Bankguthaben</b>	<b>6.504.032,30</b>	<b>12,21</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>	<b>2.082.715,46</b>	<b>3,90</b>
<b>Nettovermögen Gesamt</b>	<b>53.278.850,83</b>	<b>100,00</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Global Convertible Bond

(ausgedrückt in USD)

### Statistische Angaben

<b>Nettovermögen</b>	31.03.2022	USD	61.972.876,54	<b>Anzahl der Anteile</b>			
	30.09.2021	USD	84.468.070,37				
	30.09.2020	USD	101.891.790,82		Capitalisation R Hedged (i) (GBP)	31.03.2022	22
<b>Nettoinventarwert pro Anteil**</b>					30.09.2021	22	
					30.09.2020	73	
				Capitalisation Z (USD)	31.03.2022	9.466	
Capitalisation I (USD)	31.03.2022	USD	5.919,66		30.09.2021	12.525	
	30.09.2021	USD	6.202,84		30.09.2020	16.945	
	30.09.2020	USD	5.635,32				
Capitalisation I Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	EUR	5.454,67	<b>Laufende Kosten in %*</b>			
	30.09.2021	EUR	5.755,44		Capitalisation I (USD)	31.03.2022	0,65%
	30.09.2020	EUR	5.283,10		Capitalisation I Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	0,68%
Capitalisation I Hedged (i) (GBP)	31.03.2022	GBP	112,73	Capitalisation I Hedged (i) (GBP)	31.03.2022	0,67%	
	30.09.2021	GBP	118,46	Capitalisation P (USD)	31.03.2022	1,05%	
	30.09.2020	GBP	107,98	Capitalisation P Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	1,06%	
Capitalisation P (USD)	31.03.2022	USD	289,42	Capitalisation R Hedged (i) (GBP)	31.03.2022	0,80%	
	30.09.2021	USD	304,07	Capitalisation Z (USD)	31.03.2022	0,16%	
	30.09.2020	USD	277,44	<b>Portfolioumsatz in %*</b>	31.03.2022	97,52%	
Capitalisation P Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	EUR	266,72				
	30.09.2021	EUR	282,08				
	30.09.2020	EUR	260,08				
Capitalisation R Hedged (i) (GBP)	31.03.2022	GBP	112,47				
	30.09.2021	GBP	118,20				
	30.09.2020	GBP	107,94				
Capitalisation Z (USD)	31.03.2022	USD	6.071,30				
	30.09.2021	USD	6.348,95				
	30.09.2020	USD	5.734,96				
<b>Anzahl der Anteile</b>							
Capitalisation I (USD)	31.03.2022		0,53				
	30.09.2021		0,53				
	30.09.2020		814				
Capitalisation I Hedged (i) (EUR)	31.03.2022		739				
	30.09.2021		739				
	30.09.2020		7				
Capitalisation I Hedged (i) (GBP)	31.03.2022		19				
	30.09.2021		19				
	30.09.2020		365				
Capitalisation P (USD)	31.03.2022		9				
	30.09.2021		9				
	30.09.2020		32				
Capitalisation P Hedged (i) (EUR)	31.03.2022		7				
	30.09.2021		7				
	30.09.2020		29				

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

## NN (L) Global Convertible Bond

(ausgedrückt in USD)

### Finanzabschlüsse

#### Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022

	Erläuterungen	
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	2	<b>58.733.138,62</b>
Anleihen und andere Schuldtitel		58.733.138,62
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	2	<b>1.468,45</b>
Futures		1.468,45
<b>Bankguthaben</b>		<b>2.753.275,09</b>
<b>Hinterlegte Sicherheiten</b>		<b>47.488,36</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte</b>	4	<b>1.156.871,84</b>
<b>Vermögenswerte Gesamt</b>		<b>62.692.242,36</b>
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>	4, 12	<b>(509.719,51)</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	2	<b>(209.646,31)</b>
Devisentermingeschäfte		(209.646,31)
<b>Verbindlichkeiten Gesamt</b>		<b>(719.365,82)</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Berichtszeitraums</b>		<b>61.972.876,54</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Global Convertible Bond

(ausgedrückt in USD)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW	Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW
<b>Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarkttinstrumente</b>									
<b>Anleihen und andere Schuldtitel</b>									
<b>Vereinigte Staaten</b>									
1.000.000	AIRBNB INC ZCP 15/03/2026	USD	969.829,94	1,56					
1.360.000	AKAMAI TECHNOLOGIES INC 0.125% 01/05/2025	USD	1.796.454,52	2,90					
100.000	AKAMAI TECHNOLOGIES INC 0.375% 01/09/2027	USD	115.188,96	0,19					
550.000	BENTLEY SYSTEMS INC 0.375% 01/07/2027	USD	479.217,45	0,77					
485.000	CABLE ONE INC ZCP 15/03/2026	USD	427.533,82	0,69					
1.060.000	CHEGG INC ZCP 01/09/2026	USD	865.294,79	1,40					
250.000	CHEGG INC 0.125% 15/03/2025	USD	251.439,21	0,41					
400.000	COUPA SOFTWARE INC 0.125% 15/06/2025	USD	390.413,64	0,63					
1.505.000	DEXCOM INC 0.250% 15/11/2025	USD	1.722.299,17	2,78					
555.000	DROPBOX INC ZCP 01/03/2026	USD	521.139,63	0,84					
220.000	DROPBOX INC ZCP 01/03/2028	USD	206.316,70	0,33					
640.000	ENPHASE ENERGY INC ZCP 01/03/2028	USD	668.707,28	1,08					
450.000	ENVESTNET INC 0.750% 15/08/2025	USD	436.739,18	0,70					
800.000	ETSY INC 0.250% 15/06/2028	USD	714.111,61	1,15					
395.000	EURONET WORLDWIDE INC 0.750% 15/03/2049	USD	444.645,14	0,72					
525.000	EXPEDIA GROUP INC ZCP 15/02/2026	USD	632.547,33	1,02					
1.010.000	FORD MOTOR CO ZCP 15/03/2026	USD	1.197.104,02	1,93					
576.000	ILLUMINA INC ZCP 15/08/2023	USD	634.605,35	1,02					
200.000	JPMORGAN CHASE BANK NA ZCP 10/06/2024	EUR	244.853,20	0,40					
700.000	JPMORGAN CHASE BANK NA ZCP 18/02/2024	EUR	828.847,17	1,34					
429.000	JPMORGAN CHASE FINANCIAL CO LLC 0.250% 01/05/2023	USD	470.099,74	0,76					
300.000	LIBERTY MEDIA CORP 2.750% 01/12/2049	USD	297.228,05	0,48					
1.354.000	LUMENTUM HOLDINGS INC 0.500% 15/12/2026	USD	1.576.574,80	2,54					
470.000	MACOM TECHNOLOGY SOLUTIONS HOLDINGS INC 0.250% 15/03/2026	USD	477.455,87	0,77					
320.000	MARRIOTT VACATIONS WORLDWIDE CORP ZCP 15/01/2026	USD	348.703,40	0,56					
1.135.000	NEXTERA ENERGY PARTNERS LP ZCP 15/11/2025	USD	1.280.959,73	2,07					
220.000	NORTONLIFELOCK INC 2.000% 15/08/2022	USD	290.876,25	0,47					
1.213.000	NRG ENERGY INC 2.750% 01/06/2048	USD	1.334.468,62	2,15					
1.070.000	OKTA INC 0.375% 15/06/2026	USD	1.048.737,23	1,69					
350.000	PEBBLEBROOK HOTEL TRUST 1.750% 15/12/2026	USD	402.292,01	0,65					
427.000	PURE STORAGE INC 0.125% 15/04/2023	USD	600.009,02	0,97					
630.000	SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC ZCP 15/09/2025	USD	859.042,76	1,39					
1.250.000	SPLUNK INC 0.500% 15/09/2023	USD	1.431.646,48	2,31					
500.000	SPLUNK INC 1.125% 15/09/2025	USD	600.389,58	0,97					
580.000	TWITTER INC 0.250% 15/06/2024	USD	592.219,87	0,96					
380.000	TYLER TECHNOLOGIES INC 0.250% 15/03/2026	USD	419.233,86	0,68					
450.000	VAIL RESORTS INC ZCP 01/01/2026	USD	436.356,04	0,70					
427.000	VISHAY INTERTECHNOLOGY INC 2.250% 15/06/2025	USD	429.918,84	0,69					
520.000	ZENDESK INC 0.625% 15/06/2025	USD	655.796,54	1,06					
780.000	ZYNGA INC ZCP 15/12/2026	USD	794.515,40	1,28					
			<b>27.893.812,20</b>	<b>45,01</b>					
<b>Niederlande</b>									
400.000	AMERICA MOVIL BV ZCP 02/03/2024	EUR	475.166,72	0,77					
300.000	IBERDROLA INTERNATIONAL BV ZCP 11/11/2022 EMTN	EUR	406.252,04	0,66					
400.000	QIAGEN NV 0.500% 13/09/2023	USD	492.763,73	0,80					
600.000	QIAGEN NV 1.000% 13/11/2024	USD	710.818,44	1,14					
1.400.000	STMICROELECTRONICS NV ZCP 04/08/2025	USD	1.746.188,61	2,81					
			<b>3.831.189,54</b>	<b>6,18</b>					
<b>Deutschland</b>									
200.000	ADIDAS AG 0.050% 12/09/2023	EUR	228.931,65	0,37					
400.000	DEUTSCHE POST AG 0.050% 30/06/2025	EUR	483.529,23	0,78					
800.000	LEG IMMOBILIEN SE 0.875% 01/09/2025	EUR	979.583,93	1,58					
500.000	RAG-STIFTUNG ZCP 16/03/2023	EUR	556.202,38	0,90					
300.000	RAG-STIFTUNG ZCP 17/06/2026	EUR	354.874,06	0,57					
200.000	TAG IMMOBILIEN AG 0.625% 27/08/2026	EUR	209.846,44	0,34					
600.000	ZALANDO SE 0.050% 06/08/2025	EUR	617.718,82	1,00					
300.000	ZALANDO SE 0.625% 06/08/2027	EUR	304.824,07	0,49					
			<b>3.735.510,58</b>	<b>6,03</b>					
<b>Frankreich</b>									
673.680	ACCOR SA 0.700% 07/12/2027	EUR	771.741,65	1,25					
200.000	ATOS SE ZCP 06/11/2024	EUR	210.217,04	0,34					
200.000	CIE GENERALE DES ETABLISSEMENTS MICHELIN SCA ZCP 10/11/2023	USD	195.953,75	0,32					
375.033	EDENRED ZCP 06/09/2024	EUR	419.013,90	0,68					
889.702	ELECTRICITE ZCP 14/09/2024	EUR	1.154.379,59	1,85					
200.000	KERING SA ZCP 30/09/2022 EMTN	EUR	225.596,49	0,36					
257.602	SCHNEIDER ELECTRIC SE ZCP 15/06/2026	EUR	339.430,51	0,55					
200.000	SELENA SARL ZCP 25/06/2025	EUR	251.002,54	0,41					
			<b>3.567.335,47</b>	<b>5,76</b>					
<b>Japan</b>									
60.000.000	ANA HOLDINGS INC ZCP 10/12/2031	JPY	508.261,36	0,82					
20.000.000	DMG MORI CO LTD ZCP 16/07/2024	JPY	168.346,23	0,27					
30.000.000	mitsubishi chemical holdings corp zcp 29/03/2024	JPY	251.718,02	0,41					
30.000.000	NAGOYA RAILROAD CO LTD ZCP 11/12/2024	JPY	254.986,40	0,41					
90.000.000	NIPPON STEEL CORP ZCP 04/10/2024	JPY	790.838,18	1,28					
40.000.000	NIPPON STEEL CORP ZCP 05/10/2026	JPY	356.055,88	0,57					
30.000.000	ROHM CO LTD ZCP 05/12/2024	JPY	259.913,52	0,42					
			<b>2.590.119,59</b>	<b>4,18</b>					
<b>Spanien</b>									
400.000	AMADEUS IT GROUP SA 1.500% 09/04/2025	EUR	577.023,33	0,93					
1.100.000	CELLNEX TELECOM SA 0.500% 05/07/2028 EMTN	EUR	1.493.065,89	2,41					
400.000	INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP SA 1.125% 18/05/2028	EUR	386.834,57	0,62					
			<b>2.456.923,79</b>	<b>3,96</b>					
<b>Taiwan</b>									
1.000.000	GLOBALWAFERS CO LTD ZCP 01/06/2026	USD	972.680,73	1,57					
500.000	TAIWAN CEMENT CORP ZCP 07/12/2026	USD	494.304,68	0,80					
400.000	UNITED MICROELECTRONICS CORPORATION ZCP 07/07/2026	USD	383.282,77	0,62					
400.000	WIN SEMICONDUCTORS CORP ZCP 14/01/2026	USD	378.487,57	0,61					
			<b>2.228.755,75</b>	<b>3,60</b>					
<b>Italien</b>									
300.000	DIASORIN SPA ZCP 05/05/2028	EUR	325.342,11	0,52					
400.000	NEXI SPA ZCP 24/02/2028	EUR	365.870,65	0,59					
600.000	NEXI SPA 1.750% 24/04/2027	EUR	634.417,59	1,03					
300.000	PIRELLI & C SPA ZCP 22/12/2025	EUR	358.355,52	0,58					
300.000	PRYSMIAN SPA ZCP 02/02/2026	EUR	353.862,74	0,57					
			<b>2.037.848,61</b>	<b>3,29</b>					
<b>Israel</b>									
858.000	CYBERARK SOFTWARE LTD ZCP 15/11/2024	USD	1.067.105,50	1,72					
400.000	NICE LTD ZCP 15/09/2025	USD	419.206,80	0,68					
			<b>1.486.312,30</b>	<b>2,40</b>					

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Global Convertible Bond

(ausgedrückt in USD)

## Wertpapierbestand zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW
<b>Singapur</b>				
300.000	SGX TREASURY I PTE LTD ZCP 01/03/2024	EUR	341.136,12	0,55
1.250.000	SINGAPORE AIRLINES LTD 1.625% 03/12/2025	SGD	1.022.215,54	1,65
			<b>1.363.351,66</b>	<b>2,20</b>
<b>Südkorea</b>				
400.000	KAKAO CORP ZCP 28/04/2023	USD	456.981,48	0,74
600.000	LG DISPLAY CO LTD 1.500% 22/08/2024	USD	682.977,56	1,10
			<b>1.139.959,04</b>	<b>1,84</b>
<b>Malaysia</b>				
600.000	CERAH CAPITAL LTD ZCP 08/08/2024	USD	614.732,58	0,99
			<b>614.732,58</b>	<b>0,99</b>
<b>Vereinigte Arabische Emirate</b>				
600.000	ABU DHABI NATIONAL OIL CO 0.700% 04/06/2024	USD	569.291,72	0,91
			<b>569.291,72</b>	<b>0,91</b>
<b>Luxemburg</b>				
200.000	IWG INTERNATIONAL HOLDINGS 0.500% 09/12/2027	GBP	226.962,38	0,37
200.000	OLIVER CAPITAL SARL ZCP 29/12/2023	EUR	243.960,44	0,39
			<b>470.922,82</b>	<b>0,76</b>
<b>Jungferninseln</b>				
2.000.000	LINK CB LTD 1.600% 03/04/2024	HKD	254.594,41	0,41
200.000	UNIVERSE TREK LTD 2.500% 08/07/2025	USD	207.856,56	0,34
			<b>462.450,97</b>	<b>0,75</b>
<b>Belgien</b>				
200.000	SAGERPAR SA ZCP 01/04/2026	EUR	227.237,44	0,37
200.000	UMICORE SA ZCP 23/06/2025	EUR	222.515,32	0,36
			<b>449.752,76</b>	<b>0,73</b>
<b>Kaimaninseln</b>				
200.000	ESR CAYMAN LTD 1.500% 30/09/2025	USD	193.586,61	0,31
200.000	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING LTD ZCP 30/06/2025	USD	197.796,05	0,32
			<b>391.382,66</b>	<b>0,63</b>
<b>Neuseeland</b>				
400.000	XERO INVESTMENTS LTD ZCP 02/12/2025	USD	350.212,81	0,57
			<b>350.212,81</b>	<b>0,57</b>
<b>Dänemark</b>				
300.000	GN STORE NORD AS ZCP 21/05/2024	EUR	339.914,98	0,55
			<b>339.914,98</b>	<b>0,55</b>
<b>Schweden</b>				
200.000	GEELY SWEDEN FINANCIALS HOLDING AB ZCP 19/06/2024	EUR	258.760,75	0,42
			<b>258.760,75</b>	<b>0,42</b>
<b>Australien</b>				
300.000	SEVEN GROUP HOLDINGS LTD 2.200% 05/03/2025	AUD	231.778,26	0,37
			<b>231.778,26</b>	<b>0,37</b>

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW
<b>Österreich</b>				
200.000	AMS-OSRAM AG 2.125% 03/11/2027	EUR	202.868,00	0,32
			<b>202.868,00</b>	<b>0,32</b>
			<b>56.673.186,84</b>	<b>91,45</b>

## Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente

### Anleihen und andere Schuldtitel

#### Japan

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW
20.000.000	CYBERAGENT INC ZCP 17/02/2023	JPY	178.952,22	0,29
20.000.000	DIGITAL GARAGE INC ZCP 14/09/2023	JPY	174.018,96	0,28
40.000.000	MEDIPAL HOLDINGS CORP ZCP 07/10/2022	JPY	330.578,69	0,53
100.000.000	MENICON CO LTD ZCP 29/01/2025	JPY	876.280,13	1,41
20.000.000	SENKO GROUP HOLDINGS CO LTD ZCP 18/03/2025	JPY	165.621,27	0,27
40.000.000	SHIP HEALTHCARE HOLDINGS INC ZCP 13/12/2023	JPY	334.500,51	0,54
			<b>2.059.951,78</b>	<b>3,32</b>
			<b>2.059.951,78</b>	<b>3,32</b>

## Wertpapierbestand Gesamt

**58.733.138,62 94,77**

## Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022

Zu erhalten	Zu zahlen	Fälligkeits- datum	Engagement in USD	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in USD

### Devisentermingeschäfte

284.000,00	SGD	208.958,35	USD	30/06/2022	208.958,35	900,28
433.697,00	USD	3.390.262,79	HKD	30/06/2022	433.697,00	175,52
225,22	USD	169,63	GBP	19/04/2022	225,22	1,90
4.787,93	GBP	6.391,98	USD	19/04/2022	6.391,98	(88,62)
11.802,12	USD	11.000,00	CHF	30/06/2022	11.802,12	(198,41)
259.913,26	USD	346.000,00	AUD	30/06/2022	259.913,26	(332,60)
264.133,71	USD	201.681,75	GBP	30/06/2022	264.133,71	(1.339,36)
232.946,49	USD	211.152,89	EUR	19/04/2022	232.946,49	(2.094,83)
4.226.766,45	EUR	4.716.717,01	USD	19/04/2022	4.716.717,01	(11.762,51)
4.620.041,01	USD	569.172.559,00	JPY	30/06/2022	4.620.041,01	(81.130,76)
15.475.152,39	USD	13.960.961,83	EUR	30/06/2022	15.475.152,39	(113.776,92)
					<b>26.229.978,54</b>	<b>(209.646,31)</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Global Convertible Bond

(ausgedrückt in USD)

### Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl	Bezeichnung	Währung	Engagement in USD	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in USD
<b>Future auf Aktienindizes</b>				
1	HANG SENG INDEX FUTURE 28/04/2022	HKD	140.396,35	1.468,45
			<b>140.396,35</b>	<b>1.468,45</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>				<b>(208.177,86)</b>

### Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick

		%
		NIW
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	<b>58.733.138,62</b>	<b>94,77</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	<b>(208.177,86)</b>	<b>(0,34)</b>
<b>Bankguthaben</b>	<b>2.753.275,09</b>	<b>4,44</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>	<b>694.640,69</b>	<b>1,13</b>
<b>Nettovermögen Gesamt</b>	<b>61.972.876,54</b>	<b>100,00</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.



## NN (L) Global Convertible Opportunities

(ausgedrückt in USD)

### Statistische Angaben

<b>Nettovermögen</b>	31.03.2022	USD	851.272.594,97	Distribution I (Q) (USD)	31.03.2022	USD	6.596,01
	30.09.2021	USD	1.015.834.241,01		30.09.2021	USD	6.866,44
	30.09.2020	USD	1.205.349.629,65		30.09.2020	USD	6.277,20
<b>Nettoinventarwert pro Anteil**</b>				Distribution I (Q) Hedged (i) (GBP)	31.03.2022	GBP	115,28
					30.09.2021	GBP	120,24
					30.09.2020	GBP	110,43
Capitalisation I (USD)	31.03.2022	USD	180,73	Distribution N Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	EUR	27,96
	30.09.2021	USD	187,71		30.09.2021	EUR	29,30
	30.09.2020	USD	170,72		30.09.2020	EUR	27,04
Capitalisation I Hedged (i) (CHF)	31.03.2022	CHF	5.285,98	Distribution P Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	EUR	268,93
	30.09.2021	CHF	5.529,98		30.09.2021	EUR	283,11
	30.09.2020	CHF	5.091,29		30.09.2020	EUR	263,37
Capitalisation I Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	EUR	148,20	<b>Anzahl der Anteile</b>			
	30.09.2021	EUR	154,85		Capitalisation I (USD)	31.03.2022	151.395
	30.09.2020	EUR	142,31		30.09.2021	240.166	
Capitalisation I Hedged (i) (GBP)	31.03.2022	GBP	166,94	30.09.2020	615.572		
	30.09.2021	GBP	173,76	Capitalisation I Hedged (i) (CHF)	31.03.2022	235	
	30.09.2020	GBP	158,70	30.09.2021	235		
Capitalisation P (USD)	31.03.2022	USD	301,99	30.09.2020	369		
	30.09.2021	USD	314,62	Capitalisation I Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	3.113.599	
	30.09.2020	USD	287,90	30.09.2021	3.351.716		
Capitalisation P Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	EUR	139,05	30.09.2020	3.765.292		
	30.09.2021	EUR	145,74	Capitalisation I Hedged (i) (GBP)	31.03.2022	432.660	
	30.09.2020	EUR	134,79	30.09.2021	467.207		
Capitalisation R (USD)	31.03.2022	USD	279,89	30.09.2020	469.044		
	30.09.2021	USD	290,73	Capitalisation P (USD)	31.03.2022	8.865	
	30.09.2020	USD	264,47	30.09.2021	9.596		
Capitalisation R Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	EUR	266,38	30.09.2020	24.014		
	30.09.2021	EUR	278,35	Capitalisation P Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	12.670	
	30.09.2020	EUR	255,81	30.09.2021	15.799		
Capitalisation R Hedged (i) (GBP)	31.03.2022	GBP	119,79	30.09.2020	51.950		
	30.09.2021	GBP	124,69	Capitalisation R (USD)	31.03.2022	1.149	
	30.09.2020	GBP	113,94	30.09.2021	1.357		
Capitalisation X (USD)	31.03.2022	USD	326,06	30.09.2020	645		
	30.09.2021	USD	340,22	Capitalisation R Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	110.912	
	30.09.2020	USD	312,27	30.09.2021	115.420		
Capitalisation Z Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	EUR	6.111,33	30.09.2020	112.991		
	30.09.2021	EUR	6.362,01	Capitalisation R Hedged (i) (GBP)	31.03.2022	240	
	30.09.2020	EUR	5.802,70	30.09.2021	259		
Capitalisation Zz Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	EUR	5.990,27	30.09.2020	1.021		
	30.09.2021	EUR	6.229,84	Capitalisation X (USD)	31.03.2022	2.134	
	30.09.2020	EUR	5.673,24	30.09.2021	2.047		
Distribution I Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	EUR	-	30.09.2020	1.931		
	30.09.2021	EUR	-				
	30.09.2020	EUR	5.004,88				

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

## NN (L) Global Convertible Opportunities

(ausgedrückt in USD)

### Statistische Angaben (Fortsetzung)

<b>Anzahl der Anteile</b>			Capitalisation P Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	1,52%
Capitalisation Z Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	4.932	Capitalisation R (USD)	31.03.2022	0,90%
	30.09.2021	5.539	Capitalisation R Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	0,92%
	30.09.2020	8.581	Capitalisation R Hedged (i) (GBP)	31.03.2022	0,92%
Capitalisation Zz Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	3.669	Capitalisation X (USD)	31.03.2022	1,80%
	30.09.2021	4.442	Capitalisation Z Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	0,19%
	30.09.2020	5.645	Capitalisation Zz Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	0,01%
Distribution I Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	-	Distribution I (Q) (USD)	31.03.2022	0,88%
	30.09.2021	-	Distribution I (Q) Hedged (i) (GBP)	31.03.2022	0,91%
	30.09.2020	10.000	Distribution N Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	0,82%
Distribution I (Q) (USD)	31.03.2022	12.415	Distribution P Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	1,52%
	30.09.2021	14.865			
	30.09.2020	20.158	<b>Portfolioumsatz in %*</b>	31.03.2022	68,41%
Distribution I (Q) Hedged (i) (GBP)	31.03.2022	213.417			
	30.09.2021	218.191			
	30.09.2020	257.045			
Distribution N Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	70.955			
	30.09.2021	85.164			
	30.09.2020	132.382			
Distribution P Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	3.288			
	30.09.2021	3.288			
	30.09.2020	5.224			
<b>Dividende</b>					
Distribution I (Q) (USD)	11.02.2022	USD	8,62		
Distribution I (Q) (USD)	11.11.2021	USD	6,85		
Distribution I (Q) Hedged (i) (GBP)	11.02.2022	GBP	0,15		
Distribution I (Q) Hedged (i) (GBP)	11.11.2021	GBP	0,10		
Distribution N Hedged (i) (EUR)	14.12.2021	EUR	0,10		
Distribution P Hedged (i) (EUR)	14.12.2021	EUR	1,15		
<b>Laufende Kosten in %*</b>					
Capitalisation I (USD)	31.03.2022		0,88%		
Capitalisation I Hedged (i) (CHF)	31.03.2022		0,91%		
Capitalisation I Hedged (i) (EUR)	31.03.2022		0,91%		
Capitalisation I Hedged (i) (GBP)	31.03.2022		0,91%		
Capitalisation P (USD)	31.03.2022		1,50%		

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

## NN (L) Global Convertible Opportunities

(ausgedrückt in USD)

### Finanzabschlüsse

#### Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022

	Erläuterungen	
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	2	<b>796.811.461,11</b>
Organismen für gemeinsame Anlagen		26.106.590,00
Anleihen und andere Schuldtitel		770.704.871,11
<b>Bankguthaben</b>		<b>67.466.942,39</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte</b>	4, 12	<b>61.437.266,05</b>
<b>Vermögenswerte Gesamt</b>		<b>925.715.669,55</b>
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>	4, 12	<b>(69.138.785,09)</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	2	<b>(5.304.289,49)</b>
Devisentermingeschäfte		(5.304.289,49)
<b>Verbindlichkeiten Gesamt</b>		<b>(74.443.074,58)</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Berichtszeitraums</b>		<b>851.272.594,97</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Global Convertible Opportunities

(ausgedrückt in USD)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW
<b>Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>				
<b>Anleihen und andere Schuldtitel</b>				
<b>Vereinigte Staaten</b>				
25.840.000	AKAMAI TECHNOLOGIES INC 0.125% 01/05/2025	USD	34.132.635,85	4,01
13.850.000	ARES CAPITAL CORP 4.625% 01/03/2024	USD	15.587.024,76	1,83
31.750.000	CHEGG INC ZCP 01/09/2026	USD	25.918.027,92	3,04
9.800.000	CHEGG INC 0.125% 15/03/2025	USD	9.856.417,03	1,16
30.765.000	DEXCOM INC 0.250% 15/11/2025	USD	35.206.999,29	4,14
14.960.000	ENPHASE ENERGY INC ZCP 01/03/2026	USD	15.204.923,18	1,79
24.400.000	HAEMONETICS CORP ZCP 01/03/2026	USD	20.522.838,29	2,41
11.390.000	ILLUMINA INC ZCP 15/08/2023	USD	12.548.880,11	1,47
17.100.000	JPMORGAN CHASE BANK NA ZCP 18/02/2024	EUR	20.247.552,34	2,38
27.080.000	LUMENTUM HOLDINGS INC 0.500% 15/12/2026	USD	31.531.495,97	3,70
10.630.000	MACOM TECHNOLOGY SOLUTIONS HOLDINGS INC 0.250% 15/03/2026	USD	10.798.629,64	1,27
21.550.000	NEXTERA ENERGY PARTNERS LP ZCP 15/11/2025	USD	24.321.305,86	2,86
26.600.000	NRG ENERGY INC 2.750% 01/06/2048	USD	29.263.697,67	3,44
18.700.000	OKTA INC 0.375% 15/06/2026	USD	18.328.398,28	2,15
13.250.000	ON SEMICONDUCTOR CORP ZCP 01/05/2027	USD	17.987.989,46	2,11
14.605.000	RINGCENTRAL INC ZCP 01/03/2025	USD	12.759.311,09	1,50
13.670.000	SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC ZCP 15/09/2025	USD	18.639.864,38	2,19
35.400.000	SPLUNK INC 1.125% 15/09/2025	USD	42.507.582,26	4,99
20.455.000	STARWOOD PROPERTY TRUST INC 4.375% 01/04/2023	USD	21.008.242,91	2,47
6.603.000	VIAVI SOLUTIONS INC 1.000% 01/03/2024	USD	8.548.005,50	1,00
16.700.000	ZYNGA INC ZCP 15/12/2026	USD	17.010.778,48	2,00
			<b>441.930.600,27</b>	<b>51,91</b>
<b>Niederlande</b>				
6.500.000	IBERDROLA INTERNATIONAL BV ZCP 11/11/2022 EMTN	EUR	8.802.127,47	1,03
19.000.000	JUST EAT TAKEAWAY.COM NV 2.250% 25/01/2024	EUR	20.456.060,18	2,40
18.200.000	QIAGEN NV 0.500% 13/09/2023	USD	22.420.749,81	2,63
28.200.000	STMICROELECTRONICS NV ZCP 04/08/2025	USD	35.173.227,76	4,13
			<b>86.852.165,22</b>	<b>10,19</b>
<b>Deutschland</b>				
19.200.000	LEG IMMOBILIEN SE 0.875% 01/09/2025	EUR	23.510.014,36	2,76
19.500.000	ZALANDO SE 0.050% 06/08/2025	EUR	20.075.861,64	2,36
			<b>43.585.876,00</b>	<b>5,12</b>
<b>Spanien</b>				
7.500.000	AMADEUS IT GROUP SA 1.500% 09/04/2025	EUR	10.819.187,32	1,27
23.200.000	CELLNEX TELECOM SA 0.500% 05/07/2028 EMTN	EUR	31.490.116,91	3,70
			<b>42.309.304,23</b>	<b>4,97</b>
<b>Frankreich</b>				
15.542.760	ACCOR SA 0.700% 07/12/2027	EUR	17.805.182,25	2,09
11.525.401	ELECTRICITE ZCP 14/09/2024	EUR	14.954.094,27	1,76
			<b>32.759.276,52</b>	<b>3,85</b>
<b>Singapur</b>				
32.750.000	SINGAPORE AIRLINES LTD 1.625% 03/12/2025	SGD	26.782.047,13	3,15
			<b>26.782.047,13</b>	<b>3,15</b>

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW
<b>Taiwan</b>				
23.800.000	GLOBALWAFERS CO LTD ZCP 01/06/2026	USD	23.149.801,37	2,72
			<b>23.149.801,37</b>	<b>2,72</b>
<b>Israel</b>				
16.150.000	CYBERARK SOFTWARE LTD ZCP 15/11/2024	USD	20.085.960,11	2,36
			<b>20.085.960,11</b>	<b>2,36</b>
<b>Italien</b>				
18.500.000	NEXI SPA 1.750% 24/04/2027	EUR	19.561.208,97	2,30
			<b>19.561.208,97</b>	<b>2,30</b>
<b>Südkorea</b>				
12.000.000	KAKAO CORP ZCP 28/04/2023	USD	13.709.444,28	1,61
			<b>13.709.444,28</b>	<b>1,61</b>
			<b>750.725.684,10</b>	<b>88,18</b>
<b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>				
<b>Anleihen und andere Schuldtitel</b>				
<b>Japan</b>				
2.280.000.000	MENICON CO LTD ZCP 29/01/2025	JPY	19.979.187,01	2,35
			<b>19.979.187,01</b>	<b>2,35</b>
			<b>19.979.187,01</b>	<b>2,35</b>
<b>Organismen für gemeinsame Anlagen</b>				
<b>Offene Fonds</b>				
<b>Luxemburg</b>				
4.300	NN (L) GLOBAL CONVERTIBLE BOND - Z CAP USD	USD	26.106.590,00	3,07
			<b>26.106.590,00</b>	<b>3,07</b>
			<b>26.106.590,00</b>	<b>3,07</b>
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>			<b>796.811.461,11</b>	<b>93,60</b>

### Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022

Zu erhalten	Zu zahlen	Fälligkeits- datum	Engagement in USD	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in USD		
<b>Devisentermingeschäfte</b>						
8.367.056,07	USD	6.325.822,14	GBP	19/04/2022	8.367.056,07	39.047,39
43.586,91	USD	40.244,22	CHF	19/04/2022	43.586,91	(166,60)
251.453,95	USD	192.000,00	GBP	30/06/2022	251.453,95	(1.275,06)
1.273.902,54	CHF	1.387.754,85	USD	19/04/2022	1.387.754,85	(2.768,06)
34.334.741,86	USD	30.921.739,37	EUR	19/04/2022	34.334.741,86	(85.276,02)
25.501.953,49	USD	34.660.278,78	SGD	30/06/2022	25.501.953,49	(109.872,18)
19.530.096,77	USD	2.406.038.200,00	JPY	30/06/2022	19.530.096,77	(342.960,52)

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Global Convertible Opportunities

(ausgedrückt in USD)

### Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Zu erhalten	Zu zahlen	Fälligkeits- datum	Engagement in USD	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in USD
188.744.713,50 USD	170.271.734,17 EUR	30/06/2022	188.744.713,50	(1.382.160,22)
575.188.031,32 EUR	641.783.973,85 USD	19/04/2022	641.783.973,85	(1.523.020,54)
102.566.453,91 GBP	136.925.609,12 USD	19/04/2022	136.925.609,12	(1.895.837,68)
			<b>1.056.870.940,37</b>	<b>(5.304.289,49)</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>				<b>(5.304.289,49)</b>

### Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick

		% NIW
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	<b>796.811.461,11</b>	<b>93,60</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	<b>(5.304.289,49)</b>	<b>(0,62)</b>
<b>Bankguthaben</b>	<b>67.466.942,39</b>	<b>7,93</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>	<b>(7.701.519,04)</b>	<b>(0,91)</b>
<b>Nettovermögen Gesamt</b>	<b>851.272.594,97</b>	<b>100,00</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Global Enhanced Index Sustainable Equity

(ausgedrückt in USD)

### Statistische Angaben

<b>Nettovermögen</b>	31.03.2022	USD	789.045.733,05	<b>Anzahl der Anteile</b>				
	30.09.2021	USD	762.250.900,82		Capitalisation X Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	8	
	30.09.2020	USD	60.869.513,39			30.09.2021	8	
<b>Nettoinventarwert pro Anteil</b>					30.09.2020	-		
	Capitalisation I (EUR)	31.03.2022	EUR	4.829,72	Distribution Z (EUR)	31.03.2022	93.317	
		30.09.2021	EUR	-		30.09.2021	95.633	
					30.09.2020	10.000		
	Capitalisation I (USD)	31.03.2022	USD	7.314,81	<b>Dividende</b>			
		30.09.2021	USD	7.151,20		Distribution Z (EUR)	14.12.2021	EUR 87,70
		30.09.2020	USD	5.573,63				
	Capitalisation I Hedged (i) (CZK)	31.03.2022	CZK	151.793,31	<b>Laufende Kosten in %*</b>			
		30.09.2021	CZK	-		Capitalisation I (EUR)	31.03.2022	0,19%
		30.09.2020	CZK	-		Capitalisation I (USD)	31.03.2022	0,19%
	Capitalisation P (USD)	31.03.2022	USD	362,53	Capitalisation I Hedged (i) (CZK)	31.03.2022	0,21%	
		30.09.2021	USD	354,97	Capitalisation P (USD)	31.03.2022	0,53%	
		30.09.2020	USD	277,68	Capitalisation R (USD)	31.03.2022	0,28%	
	Capitalisation R (USD)	31.03.2022	USD	364,71	Capitalisation X Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	1,02%	
		30.09.2021	USD	356,69	Distribution Z (EUR)	31.03.2022	0,11%	
		30.09.2020	USD	278,38	<b>Portfolioumsatz in %*</b>	31.03.2022	46,55%	
	Capitalisation X Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	EUR	256,77				
		30.09.2021	EUR	254,12				
		30.09.2020	EUR	-				
	Distribution Z (EUR)	31.03.2022	EUR	6.986,99				
		30.09.2021	EUR	6.636,47				
		30.09.2020	EUR	5.185,91				
<b>Anzahl der Anteile</b>								
Capitalisation I (EUR)	31.03.2022		3.903					
	30.09.2021		-					
	30.09.2020		-					
Capitalisation I (USD)	31.03.2022		5.816					
	30.09.2021		3.733					
	30.09.2020		7					
Capitalisation I Hedged (i) (CZK)	31.03.2022		10					
	30.09.2021		-					
	30.09.2020		-					
Capitalisation P (USD)	31.03.2022		9					
	30.09.2021		9					
	30.09.2020		29					
Capitalisation R (USD)	31.03.2022		9					
	30.09.2021		9					
	30.09.2020		29					

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

## NN (L) Global Enhanced Index Sustainable Equity

(ausgedrückt in USD)

### Finanzabschlüsse

#### Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022

	Erläuterungen	
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	2	<b>785.749.365,93</b>
Aktien		785.749.365,93
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>		<b>2.690,32</b>
Devisentermingeschäfte		2.690,32
<b>Bankguthaben</b>		<b>1.823.009,45</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte</b>	4	<b>1.641.664,79</b>
<b>Vermögenswerte Gesamt</b>		<b>789.216.730,49</b>
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>	4	<b>(170.997,44)</b>
<b>Verbindlichkeiten Gesamt</b>		<b>(170.997,44)</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Berichtszeitraums</b>		<b>789.045.733,05</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Global Enhanced Index Sustainable Equity

(ausgedrückt in USD)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW	Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW
<b>Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>									
<b>Aktien</b>									
<b>Vereinigte Staaten</b>									
2.342	A O SMITH CORP	USD	149.630,38	0,02	531	BIO-RAD LABORATORIES INC - A	USD	299.075,13	0,04
28.245	ABBOTT LABORATORIES	USD	3.343.078,20	0,42	492	BIO-TECHNE CORP	USD	213.055,68	0,03
27.033	ABBVIE INC	USD	4.382.319,63	0,56	330	BLACK KNIGHT INC	USD	19.136,70	0,00
252	ABIOMED INC	USD	83.472,48	0,01	7.344	BLOCK INC - A	USD	995.846,40	0,13
6.786	ADOBE INC	USD	3.091.837,32	0,39	821	BOOKING HOLDINGS INC	USD	1.928.077,45	0,24
31.030	ADVANCED MICRO DEVICES INC	USD	3.392.820,20	0,43	4.717	BOSTON PROPERTIES INC	USD	607.549,60	0,08
15.652	AFLAC INC	USD	1.007.832,28	0,13	20.277	BOSTON SCIENTIFIC CORP	USD	898.068,33	0,11
7.892	AGILENT TECHNOLOGIES INC	USD	1.044.348,36	0,13	41.208	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	USD	3.009.420,24	0,38
21.943	AGNC INVESTMENT CORP	USD	287.453,30	0,04	617	BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS INC	USD	96.073,07	0,01
4.718	AIR PRODUCTS AND CHEMICALS INC	USD	1.179.075,38	0,15	2.898	BROWN & BROWN INC	USD	209.438,46	0,03
3.311	AKAMAI TECHNOLOGIES INC	USD	395.300,29	0,05	8.605	BROWN-FORMAN CORP - B	USD	576.707,10	0,07
2.084	ALBEMARLE CORP	USD	460.876,60	0,06	631	BURLINGTON STORES INC	USD	114.949,27	0,01
3.196	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC	USD	643.195,00	0,08	3.786	CADENCE DESIGN SYSTEMS INC	USD	622.645,56	0,08
1.437	ALIGN TECHNOLOGY INC	USD	626.532,00	0,08	5.037	CAMPBELL SOUP CO	USD	224.499,09	0,03
24	ALLEGHANY CORP	USD	20.328,00	0,00	4.437	CARDINAL HEALTH INC	USD	251.577,90	0,03
7.162	ALLSTATE CORP/THE	USD	992.008,62	0,13	1.199	CARMAX INC	USD	115.679,52	0,01
6.657	ALLY FINANCIAL INC	USD	289.446,36	0,04	13.562	CARRIER GLOBAL CORP	USD	622.088,94	0,08
681	ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	USD	111.200,49	0,01	1.344	CARVANA CO - A	USD	160.325,76	0,02
4.059	ALPHABET INC - A	USD	11.289.499,65	1,43	2.176	CATALENT INC	USD	241.318,40	0,03
4.095	ALPHABET INC - C	USD	11.437.294,05	1,45	1.484	CBOE GLOBAL MARKETS INC	USD	169.799,28	0,02
6.217	AMAZON.COM INC	USD	20.267.109,15	2,57	6.588	CBRE GROUP INC - A	USD	602.933,76	0,08
11.989	AMERICAN EXPRESS CO	USD	2.241.943,00	0,28	7.031	CENTENE CORP	USD	591.939,89	0,08
17.367	AMERICAN INTERNATIONAL GROUP INC	USD	1.090.126,59	0,14	329	CERIDIAN HCM HOLDING INC	USD	22.490,44	0,00
7.657	AMERICAN TOWER CORP	USD	1.923.591,54	0,24	2.872	CERNER CORP	USD	268.704,32	0,03
2.491	AMERIPRISE FINANCIAL INC	USD	748.196,76	0,09	3.380	CH ROBINSON WORLDWIDE INC	USD	364.059,80	0,05
1.473	AMERISOURCEBERGEN CORP - A	USD	227.887,83	0,03	381	CHARLES RIVER LABORATORIES INTERNATIONAL INC	USD	108.192,57	0,01
9.103	AMGEN INC	USD	2.201.287,46	0,28	22.957	CHARLES SCHWAB CORP/THE	USD	1.935.504,67	0,25
47.262	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	USD	332.724,48	0,04	1.948	CHARTER COMMUNICATIONS INC - A	USD	1.062.672,96	0,13
970	ANSYS INC	USD	308.120,50	0,04	33.876	CHENIERE ENERGY INC	USD	4.696.907,40	0,60
3.809	ANTHEM INC	USD	1.871.056,98	0,24	3.655	CHURCH & DWIGHT CO INC	USD	363.233,90	0,05
223.615	APPLE INC	USD	39.045.415,15	4,96	5.221	CIGNA CORP	USD	1.251.003,81	0,16
17.951	APPLIED MATERIALS INC	USD	2.365.941,80	0,30	2.492	CINCINNATI FINANCIAL CORP	USD	338.812,32	0,04
6.056	ARAMARK	USD	227.705,60	0,03	1.965	CINTAS CORP	USD	835.891,35	0,11
4.952	ARISTA NETWORKS INC	USD	688.228,96	0,09	68.557	CISCO SYSTEMS INC/DELAWARE	USD	3.822.738,32	0,48
1.087	ARROW ELECTRONICS INC	USD	128.950,81	0,02	10.117	CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	USD	458.603,61	0,06
2.883	ARTHUR J GALLAGHER & CO	USD	503.371,80	0,06	1.143	CITRIX SYSTEMS INC	USD	115.328,70	0,01
135.116	AT&T INC	USD	3.192.791,08	0,41	980	CLOROX CO/THE	USD	136.249,40	0,02
3.843	AUTODESK INC	USD	823.747,05	0,10	4.985	CLOUDFLARE INC - A	USD	596.704,50	0,08
7.460	AUTOMATIC DATA PROCESSING INC	USD	1.697.448,40	0,22	6.382	CME GROUP INC - A	USD	1.518.022,52	0,19
216	AUTOZONE INC	USD	441.629,28	0,06	3.581	COGNEX CORP	USD	276.274,15	0,04
1.254	AVALARA INC	USD	124.785,54	0,02	9.280	COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORP - A	USD	832.137,60	0,11
3.718	AVALONBAY COMMUNITIES INC	USD	923.439,66	0,12	14.885	COLGATE-PALMOLIVE CO	USD	1.128.729,55	0,14
5.940	AVANTOR INC	USD	200.890,80	0,03	68.396	COMCAST CORP - A	USD	3.202.300,72	0,41
1.512	AVERY DENNISON CORP	USD	263.042,64	0,03	4.225	CONSTELLATION BRANDS INC - A	USD	973.102,00	0,12
79.674	BAKER HUGHES CO - A	USD	2.900.930,34	0,37	838	COOPER COS INC/THE	USD	349.940,42	0,04
110.075	BANK OF AMERICA CORP	USD	4.537.291,50	0,58	4.561	COPART INC	USD	572.268,67	0,07
17.838	BANK OF NEW YORK MELLON CORP/THE	USD	885.299,94	0,11	21.906	CORTEVA INC	USD	1.259.156,88	0,16
11.207	BAXTER INTERNATIONAL INC	USD	868.990,78	0,11	7.690	COSTAR GROUP INC	USD	512.230,90	0,06
5.185	BECTON DICKINSON AND CO	USD	1.379.210,00	0,17	7.960	COSTCO WHOLESALE CORP	USD	4.583.766,00	0,58
3.446	BEST BUY CO INC	USD	313.241,40	0,04	370	COUPA SOFTWARE INC	USD	37.603,10	0,00
1.325	BILL.COM HOLDINGS INC	USD	300.496,75	0,04	2.640	CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	USD	599.491,20	0,08
2.467	BIOGEN INC	USD	519.550,20	0,07	7.437	CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	USD	1.372.870,20	0,17
3.403	BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	USD	262.371,30	0,03	2.260	CROWN HOLDINGS INC	USD	282.703,40	0,04
					51.876	CSX CORP	USD	1.942.756,20	0,25
					3.455	CUMMINS INC	USD	708.655,05	0,09
					21.974	CVS HEALTH CORP	USD	2.223.988,54	0,28
					10.803	DANAHER CORP	USD	3.168.843,99	0,40
					5.327	DEERE & CO	USD	2.213.155,42	0,28
					8.134	DELL TECHNOLOGIES INC - C	USD	408.245,46	0,05
					17.085	DELTA AIR LINES INC	USD	676.053,45	0,09

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.



# NN (L) Global Enhanced Index Sustainable Equity

(ausgedrückt in USD)

## Wertpapierbestand zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW	Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW
6.816	DENTSPLY SIRONA INC	USD	335.483,52	0,04	2.201	HASBRO INC	USD	180.305,92	0,02
1.640	DEXCOM INC	USD	839.024,00	0,11	3.901	HCA HEALTHCARE INC	USD	977.668,62	0,12
5.143	DISCOVER FINANCIAL SERVICES	USD	566.707,17	0,07	15.537	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	USD	533.385,21	0,07
6.350	DISH NETWORK CORP - A	USD	200.977,50	0,03	2.311	HENRY SCHEIN INC	USD	201.496,09	0,03
2.778	DOCUSIGN INC - A	USD	297.579,36	0,04	4.837	HERSHEY CO/THE	USD	1.047.839,31	0,13
681	DOMINO'S PIZZA INC	USD	277.173,81	0,04	34.919	HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	USD	583.496,49	0,07
4.161	DOVER CORP	USD	652.860,90	0,08	6.842	HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	USD	1.038.205,08	0,13
5.498	DR HORTON INC	USD	409.655,98	0,05	4.605	HOLOGIC INC	USD	353.756,10	0,04
3.680	DROPBOX INC - A	USD	85.560,00	0,01	15.365	HOME DEPOT INC/THE	USD	4.599.205,45	0,58
8.978	DUPONT DE NEMOURS INC	USD	660.601,24	0,08	23.117	HOST HOTELS & RESORTS INC	USD	449.163,31	0,06
1.384	DYNATRACE INC	USD	65.186,40	0,01	21.700	HP INC	USD	787.710,00	0,10
11.464	EBAY INC	USD	656.428,64	0,08	699	HUBSPOT INC	USD	331.983,06	0,04
6.362	ECOLAB INC	USD	1.123.274,72	0,14	1.909	HUMANA INC	USD	830.739,53	0,11
12.563	EDWARDS LIFESCIENCES CORP	USD	1.478.916,36	0,19	25.321	HUNTINGTON BANCSHARES INC/OH	USD	370.193,02	0,05
9.133	ELANCO ANIMAL HEALTH INC	USD	238.279,97	0,03	1.762	IDEX CORP	USD	337.828,26	0,04
3.703	ELECTRONIC ARTS INC	USD	468.466,53	0,06	1.248	IDEXX LABORATORIES INC	USD	682.730,88	0,09
12.391	ELI LILLY & CO	USD	3.548.410,67	0,45	6.857	ILLINOIS TOOL WORKS INC	USD	1.435.855,80	0,18
15.577	EMERSON ELECTRIC CO	USD	1.527.324,85	0,19	2.699	ILLUMINA INC	USD	943.030,60	0,12
2.802	ENPHASE ENERGY INC	USD	565.387,56	0,07	2.008	INCYTE CORP	USD	159.475,36	0,02
1.182	ENTEGRIS INC	USD	155.149,32	0,02	9.426	INGERSOLL-RAND PLC	USD	474.599,10	0,06
847	EPAM SYSTEMS INC	USD	251.228,67	0,03	1.117	INSULET CORP	USD	297.557,63	0,04
1.028	EQUINIX INC	USD	762.385,36	0,10	74.529	INTEL CORP	USD	3.693.657,24	0,47
17.000	EQUITABLE HOLDINGS INC	USD	525.470,00	0,07	8.370	INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	USD	1.105.844,40	0,14
4.724	EQUITY RESIDENTIAL	USD	424.782,08	0,05	15.224	INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP	USD	1.979.424,48	0,25
385	ERIE INDEMNITY CO - A	USD	67.810,05	0,01	6.804	INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCES INC	USD	893.569,32	0,11
41.189	ESSENTIAL UTILITIES INC	USD	2.105.993,57	0,27	12.367	INTERNATIONAL PAPER CO	USD	570.737,05	0,07
582	ESSEX PROPERTY TRUST INC	USD	201.069,36	0,03	11.558	INTERPUBLIC GROUP OF COS INC/THE	USD	409.731,10	0,05
4.483	ESTEE LAUDER COS INC/THE - A	USD	1.220.810,56	0,15	4.232	INTUIT INC	USD	2.034.914,88	0,26
2.072	ETSY INC	USD	257.508,16	0,03	6.488	INTUITIVE SURGICAL INC	USD	1.957.299,84	0,25
38.876	EVERSOURCE ENERGY	USD	3.428.474,44	0,43	4.548	IQVIA HOLDINGS INC	USD	1.051.543,08	0,13
3.887	EXACT SCIENCES CORP	USD	271.779,04	0,03	5.185	IRON MOUNTAIN INC	USD	287.300,85	0,04
3.657	EXPEDIA GROUP INC	USD	715.565,19	0,09	3.996	J M SMUCKER CO/THE	USD	541.098,36	0,07
5.349	EXPEDITORS INTERNATIONAL OF WASHINGTON INC	USD	551.802,84	0,07	371	JACK HENRY & ASSOCIATES INC	USD	73.105,55	0,01
317	FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	USD	137.625,55	0,02	42.692	JPMORGAN CHASE & CO	USD	5.819.773,44	0,74
181	FAIR ISAAC CORP	USD	84.429,26	0,01	7.143	JUNIPER NETWORKS INC	USD	265.433,88	0,03
12.963	FASTENAL CO	USD	770.002,20	0,10	27.676	KEURIG DR PEPPER INC	USD	1.048.920,40	0,13
4.963	FEDEX CORP	USD	1.148.388,57	0,15	17.808	KEYCORP	USD	398.543,04	0,05
4.306	FIDELITY NATIONAL FINANCIAL INC	USD	210.305,04	0,03	2.977	KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	USD	470.276,69	0,06
11.572	FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES INC	USD	1.162.060,24	0,15	6.337	KIMCO REALTY CORP	USD	156.523,90	0,02
16.340	FIFTH THIRD BANCORP	USD	703.273,60	0,09	341.347	KINDER MORGAN INC/DE	USD	6.454.871,77	0,83
1.598	FIRST REPUBLIC BANK/CA	USD	259.035,80	0,03	3.462	KLA CORP	USD	1.267.299,72	0,16
11.391	FISERV INC	USD	1.155.047,40	0,15	18.521	KRAFT HEINZ CO/THE	USD	729.542,19	0,09
1.331	FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	USD	331.498,86	0,04	16.450	KROGER CO/THE	USD	943.736,50	0,12
77.719	FMC CORP	USD	1.015.588,83	0,13	1.374	LABORATORY CORP OF AMERICA HOLDINGS	USD	362.268,84	0,05
77.647	FORD MOTOR CO	USD	1.313.010,77	0,17	2.909	LAM RESEARCH CORP	USD	1.563.907,49	0,20
2.290	FORTINET INC	USD	782.584,60	0,10	1.751	LEAR CORP	USD	249.675,09	0,03
7.083	FORTIVE CORP	USD	431.567,19	0,05	4.457	LENNAR CORP - A	USD	361.774,69	0,05
5.204	FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	USD	386.553,12	0,05	187	LENNOX INTERNATIONAL INC	USD	48.219,82	0,01
6.396	FOX CORP - A	USD	252.322,20	0,03	220	LIBERTY BROADBAND CORP - A	USD	28.833,20	0,00
9.288	FRANKLIN RESOURCES INC	USD	259.320,96	0,03	2.277	LIBERTY BROADBAND CORP - C	USD	308.123,64	0,04
449	F5 INC	USD	93.818,55	0,01	1.416	LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY FORMULA ONE - C	USD	98.893,44	0,01
1.249	GARTNER INC	USD	371.527,54	0,05	3.351	LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM - C	USD	153.241,23	0,02
1.205	GENERAC HOLDINGS INC	USD	358.198,30	0,05	6.285	LINCOLN NATIONAL CORP	USD	410.787,60	0,05
14.660	GENERAL MILLS INC	USD	992.775,20	0,13	5.303	LKQ CORP	USD	240.809,23	0,03
20.293	GILEAD SCIENCES INC	USD	1.206.418,85	0,15	4.554	LOEWS CORP	USD	295.190,28	0,04
5.734	GLOBAL PAYMENTS INC	USD	784.640,56	0,10	10.995	LOWE'S COS INC	USD	2.223.079,05	0,28
834	GLOBE LIFE INC	USD	83.900,40	0,01	2.045	LULULEMON ATHLETICA INC	USD	746.895,35	0,09
3.931	GODADDY INC - A	USD	329.024,70	0,04	10.652	LYFT INC - A	USD	409.036,80	0,05
115.244	HALLIBURTON CO	USD	4.364.290,28	0,55	239	MARKEL CORP	USD	352.582,36	0,04
6.529	HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP INC/THE	USD	468.847,49	0,06	691	MARKETAXESS HOLDINGS INC	USD	235.078,20	0,03
					7.563	MARRIOTT INTERNATIONAL INC/MD - A	USD	1.329.197,25	0,17

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Global Enhanced Index Sustainable Equity

(ausgedrückt in USD)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW	Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW
10.634	MARSH & MCLENNAN COS INC	USD	1.812.246,28	0,23	1.973	PULTEGROUP INC	USD	82.668,70	0,01
3.785	MASCO CORP	USD	193.035,00	0,02	9.102	QORVO INC	USD	1.129.558,20	0,14
952	MASIMO CORP	USD	138.554,08	0,02	1.883	QUEST DIAGNOSTICS INC	USD	257.707,38	0,03
12.203	MASTERCARD INC - A	USD	4.361.108,14	0,55	2.986	RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	USD	328.191,26	0,04
5.069	MATCH GROUP INC	USD	551.203,06	0,07	12.569	REALTY INCOME CORP	USD	871.031,70	0,11
3.490	MCCORMICK & CO INC/MD	USD	348.302,00	0,04	6.986	REGENCY CENTERS CORP	USD	498.381,24	0,06
12.970	MCDONALD'S CORP	USD	3.207.221,60	0,41	1.584	REGENERON PHARMACEUTICALS INC	USD	1.106.297,28	0,14
836	MERCADOLIBRE INC	USD	994.405,28	0,13	14.577	REGIONS FINANCIAL CORP	USD	324.484,02	0,04
41.842	MERCK & CO INC	USD	3.433.136,10	0,44	2.764	RESMED INC	USD	670.297,64	0,08
21.480	METLIFE INC	USD	1.509.614,40	0,19	796	RINGCENTRAL INC - A	USD	93.299,16	0,01
529	METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL INC	USD	726.417,51	0,09	3.056	ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	USD	348.934,08	0,04
96.939	MICROSOFT CORP	USD	29.887.263,09	3,79	2.961	ROCKWELL AUTOMATION INC	USD	829.168,83	0,11
35.817	MONDELEZ INTERNATIONAL INC - A	USD	2.248.591,26	0,28	1.947	ROKU INC - A	USD	243.900,69	0,03
1.378	MONGODB INC - A	USD	611.267,02	0,08	4.581	ROLLINS INC	USD	160.564,05	0,02
10.214	MONSTER BEVERAGE CORP	USD	816.098,60	0,10	2.667	ROPER TECHNOLOGIES INC	USD	1.259.437,41	0,16
3.123	MOODY'S CORP	USD	1.053.731,43	0,13	5.876	ROSS STORES INC	USD	531.542,96	0,07
23.255	MORGAN STANLEY	USD	2.032.487,00	0,26	5.711	RPM INTERNATIONAL INC	USD	465.103,84	0,06
2.195	MOTOROLA SOLUTIONS INC	USD	531.629,00	0,07	14.236	SALESFORCE.COM INC	USD	3.022.587,52	0,38
1.350	MSCI INC - A	USD	678.888,00	0,09	987	SBA COMMUNICATIONS CORP - A	USD	339.626,70	0,04
1.594	M&T BANK CORP	USD	270.183,00	0,03	1.879	SEAGEN INC	USD	270.669,95	0,03
1.290	NASDAQ INC	USD	229.878,00	0,03	3.040	SERVICENOW INC	USD	1.692.945,60	0,21
4.682	NETAPP INC	USD	388.606,00	0,05	5.856	SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	USD	1.461.774,72	0,19
6.440	NETFLIX INC	USD	2.412.359,60	0,31	470	SIGNATURE BANK/NEW YORK NY	USD	137.940,30	0,02
1.214	NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	USD	113.812,50	0,01	6.125	SIMON PROPERTY GROUP INC	USD	805.805,00	0,10
6.352	NEWS CORP - A	USD	140.696,80	0,02	18.805	SIRIUS XM HOLDINGS INC	USD	124.489,10	0,02
19.478	NIKE INC - B	USD	2.620.959,68	0,33	7.916	SKYWORKS SOLUTIONS INC	USD	1.055.044,48	0,13
1.778	NORDSON CORP	USD	403.748,24	0,05	19.590	SNAP INC - A	USD	705.044,10	0,09
5.776	NORFOLK SOUTHERN CORP	USD	1.647.430,72	0,21	1.051	SNAP-ON INC	USD	215.959,48	0,03
4.305	NORTHERN TRUST CORP	USD	501.317,25	0,06	3.474	SNOWFLAKE INC - A	USD	795.997,62	0,10
6.364	NORTONLIFELOCK INC	USD	168.773,28	0,02	772	SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	USD	248.869,64	0,03
38.443	NVIDIA CORP	USD	10.489.556,98	1,33	10.386	SOUTHWEST AIRLINES CO	USD	475.678,80	0,06
21	NVR INC	USD	93.812,67	0,01	6.650	S&P GLOBAL INC	USD	2.727.697,00	0,35
3.066	OKTA INC - A	USD	462.843,36	0,06	2.497	SPLUNK INC	USD	371.079,17	0,05
4.136	OMNICOM GROUP INC	USD	351.063,68	0,04	4.437	STANLEY BLACK & DECKER INC	USD	620.248,23	0,08
43.222	ONEOK INC	USD	3.052.769,86	0,39	23.447	STARBUCKS CORP	USD	2.132.973,59	0,27
27.732	ORACLE CORP	USD	2.294.268,36	0,29	8.592	STATE STREET CORP	USD	748.535,04	0,09
6.765	OTIS WORLDWIDE CORP	USD	520.566,75	0,07	4.854	STRYKER CORP	USD	1.297.716,90	0,16
2.222	OWENS CORNING	USD	203.313,00	0,03	5.513	SUNRUN INC	USD	167.429,81	0,02
7.587	PACCAR INC	USD	668.187,09	0,08	621	SVB FINANCIAL GROUP	USD	347.418,45	0,04
3.085	PACKAGING CORP OF AMERICA	USD	481.599,35	0,06	11.494	SYNCHRONY FINANCIAL	USD	400.106,14	0,05
1.595	PALO ALTO NETWORKS INC	USD	992.903,45	0,13	2.871	SYNOPSIS INC	USD	956.818,17	0,12
10.512	PARAMOUNT GLOBAL - B	USD	397.458,72	0,05	10.948	SYSCO CORP	USD	893.904,20	0,11
3.824	PAYCHEX INC	USD	521.861,28	0,07	1.845	TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC	USD	283.650,30	0,04
699	PAYCOM SOFTWARE INC	USD	242.119,62	0,03	7.653	TARGET CORP	USD	1.624.119,66	0,21
15.977	PAYPAL HOLDINGS INC	USD	1.847.740,05	0,23	2.849	TELADOC HEALTH INC	USD	205.498,37	0,03
5.253	PELOTON INTERACTIVE INC - A	USD	138.784,26	0,02	1.029	TELEFLEX INC	USD	365.120,07	0,05
20.659	PEPSICO INC	USD	3.457.903,42	0,44	2.505	TERADYNE INC	USD	296.166,15	0,04
2.664	PERKINELMER INC	USD	464.761,44	0,06	11.725	TESLA INC	USD	12.634.860,00	1,60
88.423	PFIZER INC	USD	4.577.658,71	0,58	22.346	TEXAS INSTRUMENTS INC	USD	4.100.044,08	0,52
14.202	PINTEREST INC - A	USD	349.511,22	0,04	6.458	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	USD	3.814.417,70	0,48
9.600	PLUG POWER INC	USD	274.656,00	0,03	21.064	TJX COS INC/THE	USD	1.276.057,12	0,16
8.694	PNC FINANCIAL SERVICES GROUP INC/THE	USD	1.603.608,30	0,20	11.650	T-MOBILE US INC	USD	1.495.277,50	0,19
715	POOL CORP	USD	302.337,75	0,04	1.735	TRACTOR SUPPLY CO	USD	404.896,95	0,05
4.710	PPG INDUSTRIES INC	USD	617.339,70	0,08	7.321	TRADE DESK INC/THE - A	USD	506.979,25	0,06
6.383	PRINCIPAL FINANCIAL GROUP INC	USD	468.576,03	0,06	4.274	TRANSUNION	USD	441.675,16	0,06
39.392	PROCTER & GAMBLE CO/THE	USD	6.019.097,60	0,76	5.509	TRAVELERS COS INC/THE	USD	1.006.659,57	0,13
10.773	PROGRESSIVE CORP/THE	USD	1.228.014,27	0,16	2.981	TRIMBLE INC	USD	215.049,34	0,03
14.072	PROLOGIS INC	USD	2.272.346,56	0,29	20.679	TRUIST FINANCIAL CORP	USD	1.172.499,30	0,15
12.553	PRUDENTIAL FINANCIAL INC	USD	1.483.388,01	0,19	3.395	TWILIO INC - A	USD	559.529,95	0,07
1.415	PTC INC	USD	152.423,80	0,02	16.188	TWITTER INC	USD	626.313,72	0,08
3.606	PUBLIC STORAGE	USD	1.407.349,68	0,18	470	TYLER TECHNOLOGIES INC/THE	USD	209.098,30	0,03

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Global Enhanced Index Sustainable Equity

(ausgedrückt in USD)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW	Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW
1.651	UNITED RENTALS INC	USD	586.451,71	0,07	3.300	FUJITSU LTD	JPY	500.675,59	0,06
13.157	UNITEDHEALTH GROUP INC	USD	6.709.675,29	0,85	3.100	HITACHI CONSTRUCTION MACHINERY CO LTD	JPY	81.602,47	0,01
1.450	UNITY SOFTWARE INC	USD	143.854,50	0,02	24.500	HITACHI LTD	JPY	1.244.428,42	0,16
25.802	US BANCORP	USD	1.371.376,30	0,17	17.400	ISUZU MOTORS LTD	JPY	227.651,49	0,03
943	VAIL RESORTS INC	USD	245.434,61	0,03	43.500	ITOCHU CORP	JPY	1.485.182,29	0,19
9.426	VENTAS INC	USD	582.149,76	0,07	49.100	JAPAN POST BANK CO LTD	JPY	398.463,44	0,05
1.234	VERISIGN INC	USD	274.515,64	0,03	11.000	KAJIMA CORP	JPY	135.126,67	0,02
4.024	VERISK ANALYTICS INC - A	USD	863.671,12	0,11	5.000	KAKAKU.COM INC	JPY	113.573,64	0,01
71.804	VERIZON COMMUNICATIONS INC	USD	3.657.695,76	0,46	14.000	KAO CORP	JPY	579.608,65	0,07
4.112	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	USD	1.073.108,64	0,14	38.100	KDDI CORP	JPY	1.257.182,29	0,16
7.085	VF CORP	USD	402.853,10	0,05	32.000	KIRIN HOLDINGS CO LTD	JPY	482.208,03	0,06
24.330	VISA INC - A	USD	5.395.664,10	0,68	2.000	KOEI TECMO HOLDINGS CO LTD	JPY	66.158,60	0,01
3.388	VMWARE INC - A	USD	385.791,56	0,05	23.600	KOMATSU LTD	JPY	572.233,16	0,07
10.170	VORNADO REALTY TRUST	USD	460.904,40	0,06	300	KOSE CORP	JPY	31.859,94	0,00
999	W R BERKLEY CORP	USD	66.523,41	0,01	28.300	KUBOTA CORP	JPY	536.971,37	0,07
19.308	WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	USD	864.419,16	0,11	1.600	KURITA WATER INDUSTRIES LTD	JPY	59.913,49	0,01
27.119	WALT DISNEY CO/THE	USD	3.719.642,04	0,47	13.900	KYOCERA CORP	JPY	788.134,29	0,10
8.956	WASTE MANAGEMENT INC	USD	1.419.526,00	0,18	4.500	KYOWA KIRIN CO LTD	JPY	105.590,11	0,01
1.284	WATERS CORP	USD	398.540,76	0,05	6.200	MAKITA CORP	JPY	201.005,15	0,03
1.190	WAYFAIR INC - A	USD	131.828,20	0,02	164.800	MARUBENI CORP	JPY	1.936.187,85	0,26
407	WEST PHARMACEUTICAL SERVICES INC	USD	167.158,97	0,02	40.100	MAZDA MOTOR CORP	JPY	300.316,37	0,04
4.471	WESTERN UNION CO/THE	USD	83.786,54	0,01	4.500	MEIJI HOLDINGS CO LTD	JPY	245.066,94	0,03
5.163	WESTINGHOUSE AIR BRAKE TECHNOLOGIES CORP	USD	496.525,71	0,06	1.900	MERCARI INC	JPY	50.484,04	0,01
10.395	WEYERHAEUSER CO	USD	393.970,50	0,05	31.100	MINEBEA MITSUMI INC	JPY	690.285,48	0,09
613	WHIRLPOOL CORP	USD	105.914,14	0,01	63.400	mitsubishi electric corp	JPY	736.510,81	0,09
2.683	WORKDAY INC - A	USD	642.471,18	0,08	23.200	MITSUBISHI ESTATE CO LTD	JPY	347.689,39	0,04
1.058	WW GRAINGER INC	USD	545.705,82	0,07	348.800	MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP INC	JPY	2.184.903,32	0,29
4.064	XYLEM INC/NY	USD	346.496,64	0,04	10.500	MITSUI CHEMICALS INC	JPY	267.312,05	0,03
6.580	YUM! BRANDS INC	USD	779.927,40	0,10	19.500	MITSUI OSK LINES LTD	JPY	549.454,17	0,07
923	ZEBRA TECHNOLOGIES CORP - A	USD	381.845,10	0,05	70.820	MIZUHO FINANCIAL GROUP INC	JPY	914.314,64	0,12
1.100	ZENDESK INC	USD	132.319,00	0,02	6.400	MONOTARO CO LTD	JPY	138.888,57	0,02
4.618	ZILLOW GROUP INC - C	USD	227.621,22	0,03	13.300	NEXON CO LTD	JPY	321.281,98	0,04
4.512	ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	USD	577.084,80	0,07	8.100	NIDEC CORP	JPY	650.535,94	0,08
9.147	ZOETIS INC - A	USD	1.725.032,73	0,22	2.900	NIHON M&A CENTER INC	JPY	41.263,03	0,01
2.834	ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS INC - A	USD	332.229,82	0,04	28.600	NIPPON PAINT HOLDINGS CO LTD	JPY	254.955,30	0,03
1.001	ZSCALER INC	USD	241.521,28	0,03	24	NIPPON PROLOGIS REIT INC	JPY	70.492,28	0,01
1.690	10X GENOMICS INC - A	USD	128.558,30	0,02	7.100	NIPPON YUSEN KK	JPY	629.421,22	0,08
10.394	3M CO	USD	1.547.458,72	0,20	2.000	NITORI HOLDINGS CO LTD	JPY	253.099,90	0,03
			<b>509.938.992,08</b>	<b>64,63</b>	10.100	NITTO DENKO CORP	JPY	733.940,27	0,09
	<b>Japan</b>				74.600	NOMURA HOLDINGS INC	JPY	316.654,34	0,04
4.000	ADVANTEST CORP	JPY	318.681,77	0,04	5.300	NOMURA RESEARCH INSTITUTE LTD	JPY	175.538,62	0,02
14.400	AEON CO LTD	JPY	309.592,58	0,04	13.800	NTT DATA CORP	JPY	274.919,88	0,03
9.200	AGC INC	JPY	371.789,91	0,05	24.000	OLYMPUS CORP	JPY	462.500,51	0,06
10.100	AISIN CORP	JPY	349.079,30	0,04	1.200	OMRON CORP	JPY	81.209,47	0,01
12.800	ANA HOLDINGS INC	JPY	270.605,97	0,03	500	ORACLE CORP JAPAN	JPY	35.015,45	0,00
18.200	ASAHI GROUP HOLDINGS LTD	JPY	668.920,29	0,08	22	ORIX JREIT INC	JPY	29.961,69	0,00
50.300	ASTELLAS PHARMA INC	JPY	791.953,04	0,10	4.800	OSAKA SECURITIES EXCHANGE CO LTD	JPY	90.404,12	0,01
3.400	BANDAI NAMCO HOLDINGS INC	JPY	260.290,83	0,03	9.500	PAN PACIFIC INTERNATIONAL HOLDINGS CORP	JPY	153.721,94	0,02
18.400	BRIDGESTONE CORP	JPY	721.295,16	0,09	8.800	PERSOL HOLDINGS CO LTD	JPY	200.397,12	0,03
4.300	CONCORDIA FINANCIAL GROUP LTD	JPY	16.225,75	0,00	2.100	POLA ORBIS HOLDINGS INC	JPY	27.665,50	0,00
16.200	DAI NIPPON PRINTING CO LTD	JPY	384.128,53	0,05	26.000	RAKUTEN GROUP INC	JPY	207.143,15	0,03
2.700	DAIFUKU CO LTD	JPY	195.534,50	0,02	23.600	RECRUIT HOLDINGS CO LTD	JPY	1.052.691,25	0,13
34.300	DAIICHI SANKYO CO LTD	JPY	757.355,30	0,10	74.100	RESONA HOLDINGS INC	JPY	319.965,48	0,04
5.900	DAIKIN INDUSTRIES LTD	JPY	1.089.342,95	0,14	25.000	RICOH CO LTD	JPY	218.743,56	0,03
14.100	DENSO CORP	JPY	913.087,54	0,12	1.600	RINNAI CORP	JPY	120.881,57	0,02
5.300	EISAI CO LTD	JPY	247.588,05	0,03	13.200	SANTEN PHARMACEUTICAL CO LTD	JPY	133.440,99	0,02
4.600	FANUC CORP	JPY	820.325,44	0,10	8.300	SEIKO EPSON CORP	JPY	125.893,31	0,02
1.100	FAST RETAILING CO LTD	JPY	570.867,15	0,07	13.800	SEKISUI CHEMICAL CO LTD	JPY	199.993,41	0,03
12.500	FUJII ELECTRIC CO LTD	JPY	634.397,53	0,08	18.600	SEKISUI HOUSE LTD	JPY	363.341,71	0,05
6.200	FUJIFILM HOLDINGS CORP	JPY	383.212,36	0,05	12.800	SHARP CORP/JAPAN	JPY	121.171,58	0,02
					15.400	SHIMIZU CORP	JPY	93.256,44	0,01

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Global Enhanced Index Sustainable Equity

(ausgedrückt in USD)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW	Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW
8.900	SHISEIDO CO LTD	JPY	455.943,98	0,06	21.400	SHAW COMMUNICATIONS INC - B	CAD	664.761,22	0,08
66.700	SOFTBANK CORP	JPY	784.738,21	0,10	2.014	SHOPIFY INC - A	CAD	1.363.257,34	0,17
23.200	SOFTBANK GROUP CORP	JPY	1.062.564,78	0,13	6.367	SUN LIFE FINANCIAL INC	CAD	355.803,69	0,05
4.100	SOMPO HOLDINGS INC	JPY	181.768,07	0,02	24.531	TELUS CORP	CAD	641.433,46	0,08
21.900	SONY GROUP CORP	JPY	2.296.906,28	0,29	5.973	THOMSON REUTERS CORP	CAD	649.065,52	0,08
2.000	SQUARE ENIX HOLDINGS CO LTD	JPY	89.474,77	0,01	32.023	TORONTO-DOMINION BANK/THE	CAD	2.543.021,79	0,32
60.500	SUBARU CORP	JPY	970.990,73	0,12	4.334	WEST FRASER TIMBER CO LTD	CAD	356.907,44	0,05
55.200	SUMITOMO CORP	JPY	963.697,63	0,12	3.129	WSP GLOBAL INC	CAD	415.621,78	0,05
7.300	SUMITOMO ELECTRIC INDUSTRIES LTD	JPY	87.930,79	0,01				<b>35.740.424,27</b>	<b>4,53</b>
33.200	SUMITOMO METAL MINING CO LTD	JPY	1.685.780,43	0,21		<b>Vereinigtes Königreich</b>			
33.500	SUMITOMO MITSUI FINANCIAL GROUP INC	JPY	1.078.348,09	0,14	43.819	ABRDN PLC	GBP	123.985,02	0,02
9.500	SUMITOMO MITSUI TRUST HOLDINGS INC	JPY	313.157,57	0,04	8.320	ASHTEAD GROUP PLC	GBP	529.432,32	0,07
15.000	SUNTORY BEVERAGE & FOOD LTD	JPY	575.901,13	0,07	14.044	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	GBP	307.320,95	0,04
6.600	TAISEI CORP	JPY	192.222,45	0,02	24.029	ASTRAZENECA PLC	GBP	3.205.540,04	0,41
33.900	TAKEDA PHARMACEUTICAL CO LTD	JPY	976.990,32	0,12	11.266	AUTO TRADER GROUP PLC	GBP	93.865,62	0,01
3.700	TDK CORP	JPY	135.958,81	0,02	25.460	AVIVA PLC	GBP	151.552,55	0,02
16.900	TERUMO CORP	JPY	518.521,94	0,07	293.836	BARCLAYS PLC	GBP	573.741,79	0,07
8.700	TOKIO MARINE HOLDINGS INC	JPY	510.925,64	0,06	13.795	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	GBP	94.884,48	0,01
2.700	TOKYO ELECTRON LTD	JPY	1.407.003,09	0,18	258	BERKELEY GROUP HOLDINGS PLC	GBP	12.704,62	0,00
2.600	UNICHARM CORP	JPY	93.375,08	0,01	22.383	BRITISH LAND CO PLC/THE	GBP	156.311,93	0,02
3.000	WELCIA HOLDINGS CO LTD	JPY	74.273,94	0,01	152.345	BT GROUP PLC	GBP	365.465,94	0,05
96.300	YAHOO JAPAN CORP	JPY	425.584,51	0,06	2.772	BUNZL PLC	GBP	108.324,69	0,01
2.400	YAMAHA CORP	JPY	105.787,85	0,01	3.259	BURBERRY GROUP PLC	GBP	71.830,71	0,01
12.000	YAMAHA MOTOR CO LTD	JPY	272.477,86	0,03	4.570	COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC	USD	222.147,70	0,03
5.200	YASKAWA ELECTRIC CORP	JPY	206.286,30	0,03	35.429	COMPASS GROUP PLC	GBP	769.685,25	0,10
2.900	ZOZO INC	JPY	78.488,16	0,01	4.410	CRODA INTERNATIONAL PLC	GBP	457.546,39	0,06
			<b>50.607.856,09</b>	<b>6,41</b>	45.402	DIAGEO PLC	GBP	2.309.543,94	0,29
	<b>Kanada</b>				89.207	GLAXOSMITHKLINE PLC	GBP	1.934.708,74	0,25
9.961	BALLARD POWER SYSTEMS INC	CAD	116.034,23	0,01	3.003	HARGREAVES LANSDOWN PLC	GBP	39.855,31	0,01
11.999	BANK OF MONTREAL	CAD	1.413.212,35	0,18	333.586	HSBC HOLDINGS PLC	GBP	2.307.640,81	0,29
24.685	BANK OF NOVA SCOTIA/THE	CAD	1.770.766,58	0,22	47.084	INFORMA PLC	GBP	373.074,75	0,05
17.582	BCE INC	CAD	975.487,45	0,12	1.610	INTERTEK GROUP PLC	GBP	110.738,69	0,01
15.480	BLACKBERRY LTD	CAD	114.886,99	0,01	17.209	J SAINSBURY PLC	GBP	57.257,34	0,01
19.705	BROOKFIELD RENEWABLE CORP - A	CAD	861.369,04	0,11	8.050	JOHNSON MATTHEY PLC	GBP	199.102,82	0,03
7.766	CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	CAD	943.509,47	0,12	11.499	KINGFISHER PLC	GBP	38.667,97	0,00
15.869	CANADIAN NATIONAL RAILWAY CO	CAD	2.130.604,30	0,27	18.432	LAND SECURITIES GROUP PLC	GBP	190.653,27	0,02
5.180	CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	USD	427.557,20	0,05	81.155	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	GBP	290.639,42	0,04
16.335	CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	CAD	1.349.381,77	0,17	12.044	LIBERTY GLOBAL PLC - C	USD	312.060,04	0,04
291	CANADIAN TIRE CORP LTD - A	CAD	43.976,75	0,01	1.588.386	LLOYDS BANKING GROUP PLC	GBP	984.083,96	0,12
532	CGI INC	CAD	42.417,74	0,01	5.945	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	GBP	623.537,37	0,08
122	CONSTELLATION SOFTWARE INC/CANADA	CAD	208.729,83	0,03	65.705	M&G PLC	GBP	191.361,19	0,02
2.390	EMPIRE CO LTD - A	CAD	84.842,56	0,01	18.291	MONDI PLC	GBP	359.195,63	0,05
1.460	GEORGE WESTON LTD	CAD	179.950,36	0,02	114.601	NATWEST GROUP PLC	GBP	325.770,22	0,04
100.257	HYDRO ONE LTD	CAD	2.703.379,18	0,34	185	NMC HEALTH PLC	GBP	0,03	0,00
1.687	INTACT FINANCIAL CORP	CAD	249.487,72	0,03	19.707	PEARSON PLC	GBP	194.759,84	0,02
78.387	IVANHOE MINES LTD	CAD	731.750,07	0,09	3.794	PERSIMMON PLC	GBP	107.450,41	0,01
1.772	LIGHTSPEED COMMERCE INC	CAD	54.094,20	0,01	44.695	PRUDENTIAL PLC	GBP	667.332,57	0,08
7.573	LOBLAW COS LTD	CAD	680.148,22	0,09	10.845	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	GBP	832.755,29	0,11
75.080	LUNDIN MINING CORP	CAD	761.589,69	0,10	35.358	RELX PLC	GBP	1.109.384,42	0,14
37.740	MANULIFE FINANCIAL CORP	CAD	805.530,92	0,10	15.227	RENTOKIL INITIAL PLC	GBP	105.455,79	0,01
3.339	METRO INC	CAD	192.365,75	0,02	8.761	ROYALTY PHARMA PLC - A	USD	341.328,56	0,04
1.331	NATIONAL BANK OF CANADA	CAD	102.117,39	0,01	18.792	SEGRO PLC	GBP	332.910,15	0,04
31.083	NORTHLAND POWER INC	CAD	1.034.233,60	0,13	5.745	SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING PLC	USD	292.133,25	0,04
22.428	NUTRIEN LTD	CAD	2.320.280,34	0,29	32.367	SEVERN TRENT PLC	GBP	1.311.720,76	0,17
102.078	PEMBINA PIPELINE CORP	CAD	3.838.600,26	0,50	11.303	SMITH & NEPHEW PLC	GBP	181.561,55	0,02
6.259	RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	CAD	366.004,05	0,05	197	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	GBP	32.513,29	0,00
7.034	RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	CAD	142.082,24	0,02	35.826	STANDARD CHARTERED PLC	GBP	240.662,87	0,03
2.117	RITCHIE BROS AUCTIONEERS INC	CAD	125.150,54	0,02	81.655	TAYLOR WIMPEY PLC	GBP	140.516,95	0,02
10.729	ROGERS COMMUNICATIONS INC - B	CAD	607.809,17	0,08	212.510	TESCO PLC	GBP	772.251,54	0,10
30.611	ROYAL BANK OF CANADA	CAD	3.373.202,07	0,43	41.932	UNILEVER PLC	GBP	1.907.497,41	0,24

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.



## NN (L) Global Enhanced Index Sustainable Equity

(ausgedrückt in USD)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW	Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW
<b>Irland</b>									
9.664	ACCENTURE PLC - A	USD	3.258.990,72	0,41	6.461	HEINEKEN NV	EUR	622.409,03	0,08
1.359	ALLEGION PLC	USD	149.191,02	0,02	38.484	ING GROEP NV	EUR	407.253,61	0,05
4.071	AON PLC - A	USD	1.325.639,73	0,17	17.038	KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	EUR	551.942,67	0,07
18.637	CRH PLC	EUR	753.770,24	0,10	3.383	KONINKLIJKE DSM NV	EUR	611.665,42	0,08
1.143	DCC PLC	GBP	89.182,20	0,01	15.005	PROSUS NV	EUR	810.974,83	0,10
2.487	HORIZON THERAPEUTICS PLC	USD	261.657,27	0,03	42.013	STELLANTIS NV	EUR	691.837,30	0,10
1.554	JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	USD	241.911,18	0,03	33.902	STMICROELECTRONICS NV	EUR	1.493.376,75	0,19
13.257	JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	USD	869.261,49	0,11				<b>10.897.569,49</b>	<b>1,38</b>
890	KINGSPAN GROUP PLC	EUR	88.172,62	0,01	<b>Schweden</b>				
10.770	LINDE PLC	USD	3.440.261,10	0,44	5.610	ALFA LAVAL AB	SEK	195.820,87	0,02
24.073	MEDTRONIC PLC	USD	2.670.899,35	0,34	20.905	ASSA ABLOY AB - B	SEK	571.784,07	0,07
2.858	PENTAIR PLC	USD	154.932,18	0,02	12.079	ATLAS COPCO AB - A	SEK	637.299,00	0,08
5.802	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	EUR	261.128,83	0,03	9.206	ATLAS COPCO AB - B	SEK	424.273,77	0,05
1.576	STERIS PLC	USD	381.029,52	0,05	34.830	BOLIDEN AB	SEK	1.786.834,24	0,23
4.216	TRANE TECHNOLOGIES PLC	USD	643.783,20	0,08	4.068	EQT AB	SEK	162.424,92	0,02
2.371	WILLIS TOWERS WATSON PLC	USD	560.077,62	0,07	13.719	H & M HENNES & MAURITZ AB - B	SEK	185.748,38	0,02
			<b>15.149.888,27</b>	<b>1,92</b>	2.575	INDUSTRIVARDEN AB - A	SEK	74.270,88	0,01
<b>Australien</b>					4.562	INVESTMENT AB LATOUR - B	SEK	147.344,46	0,02
2.653	ASX LTD	AUD	162.967,71	0,02	16.532	INVESTOR AB	SEK	390.975,04	0,05
55.051	AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP LTD	AUD	1.140.999,09	0,14	18.153	NIBE INDUSTRIER AB	SEK	204.623,97	0,03
59.982	BRAMBLES LTD	AUD	446.380,90	0,06	24.164	SANDVIK AB	SEK	521.167,03	0,07
599	COCHLEAR LTD	AUD	101.357,72	0,01	1.770	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB - A	SEK	19.457,96	0,00
12.683	COMPUTERSHARE LTD	AUD	235.250,17	0,03	2.348	SKANSKA AB - B	SEK	53.261,71	0,01
7.857	CSL LTD	AUD	1.582.142,36	0,20	1.494	SKF AB - B	SEK	24.679,84	0,00
34.892	DEXUS	AUD	286.913,50	0,04	18.506	SVENSKA CELLULOSA AB SCA - B	SEK	364.285,87	0,05
2.231	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES LTD	AUD	147.181,20	0,02	9.483	TELEZ AB - B	SEK	144.798,04	0,02
60.535	FORTESCUE METALS GROUP LTD	AUD	939.177,91	0,12	19.600	TELIA CO AB	SEK	79.372,49	0,01
37.084	GOODMAN GROUP	AUD	637.445,95	0,08	24.769	VOLVO AB - A SHS	SEK	481.059,83	0,06
41.187	GPT GROUP/THE	AUD	160.214,17	0,02				<b>6.469.482,37</b>	<b>0,82</b>
7.788	IDP EDUCATION LTD	AUD	184.692,42	0,02	<b>Spanien</b>				
36.623	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	AUD	120.458,94	0,02	2.298	AENA SME SA	EUR	386.215,16	0,05
6.207	MACQUARIE GROUP LTD	AUD	947.471,24	0,12	6.368	AMADEUS IT GROUP SA	EUR	419.311,31	0,05
18.215	MINERAL RESOURCES LTD	AUD	720.996,57	0,09	85.236	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA	EUR	494.105,11	0,06
94.648	MIRVAC GROUP	AUD	176.979,02	0,02	296.642	BANCO SANTANDER SA	EUR	1.023.182,02	0,14
57.533	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	AUD	1.397.662,49	0,18	40.140	EDP RENOVAVEIS SA	EUR	1.042.405,72	0,13
35.033	QBE INSURANCE GROUP LTD	AUD	302.542,35	0,04	44.590	ENAGAS SA	EUR	999.703,21	0,13
2.877	REA GROUP LTD	AUD	292.680,64	0,04	7.288	FERROVIAL SA	EUR	195.670,00	0,02
10.790	SEEK LTD	AUD	241.624,01	0,03	13.176	INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL SA	EUR	289.980,26	0,04
3.899	SONIC HEALTHCARE LTD	AUD	103.883,81	0,01	53.291	RED ELECTRICA CORP SA	EUR	1.103.465,62	0,14
35.561	STOCKLAND	AUD	114.028,35	0,01	1.920	SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY SA	EUR	34.127,20	0,00
28.388	SUNCORP GROUP LTD	AUD	237.055,80	0,03	65.615	TELEFONICA SA	EUR	320.389,15	0,04
118.453	TRANSURBAN GROUP	AUD	1.205.303,35	0,16				<b>6.308.554,76</b>	<b>0,80</b>
11.493	TREASURY WINE ESTATES LTD	AUD	99.943,14	0,01	<b>Dänemark</b>				
113.115	VICINITY CENTRES	AUD	158.420,02	0,02	1.759	AMBU AS - B	DKK	26.311,26	0,00
4.809	WISETECH GLOBAL LTD	AUD	184.466,14	0,02	3.031	CHR HANSEN HOLDING AS	DKK	225.193,55	0,03
30.459	WOOLWORTHS GROUP LTD	AUD	852.254,88	0,11	912	COLOPLAST AS - B	DKK	139.759,92	0,02
			<b>13.180.493,85</b>	<b>1,67</b>	4.340	DSV A/S	DKK	844.259,46	0,11
<b>Niederlande</b>					346	GENMAB AS	DKK	127.575,97	0,02
249	ADYEN NV	EUR	501.183,17	0,06	24.347	NOVO NORDISK AS - B	DKK	2.727.376,77	0,34
9.734	AEON NV	EUR	52.008,23	0,01	8.257	ORSTED AS	DKK	1.048.837,29	0,13
4.689	AERCAP HOLDINGS NV	USD	235.762,92	0,03	594	PANDORA AS	DKK	57.539,90	0,01
4.028	AKZO NOBEL NV	EUR	350.562,81	0,04	12.549	VESTAS WIND SYSTEMS AS	DKK	374.948,62	0,05
340	ARGENX SE	EUR	106.870,03	0,01				<b>5.571.802,74</b>	<b>0,71</b>
5.931	ASML HOLDING NV	EUR	4.025.467,49	0,51	<b>Hongkong</b>				
7.106	CNH INDUSTRIAL NV	EUR	113.813,93	0,01	215.800	AIA GROUP LTD	HKD	2.271.970,53	0,29
1.218	FERRARI NV	EUR	269.279,77	0,03	163.500	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	HKD	620.061,55	0,08
672	HEINEKEN HOLDING NV	EUR	53.161,53	0,01	15.600	HANG SENG BANK LTD	HKD	301.187,53	0,04

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.



## NN (L) Global Enhanced Index Sustainable Equity

(ausgedrückt in USD)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW	Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW
21.300	HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LTD	HKD	1.010.141,23	0,13	3.332	WIX.COM LTD	USD	348.060,72	0,04
45.500	SUN HUNG KAI PROPERTIES LTD	HKD	543.810,81	0,07				<b>2.471.804,19</b>	<b>0,31</b>
108.400	SWIRE PROPERTIES LTD	HKD	269.359,76	0,03					
31.500	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	HKD	510.425,98	0,06					
			<b>5.526.957,39</b>	<b>0,70</b>					
	<b>Singapur</b>					<b>Belgien</b>			
109.102	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	SGD	181.386,56	0,02	1.539	AGEAS SA/NV	EUR	78.494,96	0,01
32.637	DBS GROUP HOLDINGS LTD	SGD	864.065,99	0,11	16.212	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	EUR	978.757,15	0,13
111.500	KEPPEL CORP LTD	SGD	528.931,91	0,07	3.106	ELIA GROUP SA/NV	EUR	477.604,11	0,06
98.288	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP LTD	SGD	899.106,25	0,11	2.558	KBC GROUP NV	EUR	186.081,85	0,02
10.700	SINGAPORE EXCHANGE LTD	SGD	78.825,88	0,01	1.281	UCB SA	EUR	154.574,29	0,02
648.100	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS LTD	SGD	1.264.258,32	0,16	7.016	UMICORE SA	EUR	307.258,02	0,04
32.100	UNITED OVERSEAS BANK LTD	SGD	759.479,81	0,10				<b>2.182.770,38</b>	<b>0,28</b>
			<b>4.576.054,72</b>	<b>0,58</b>					
	<b>Norwegen</b>					<b>Luxemburg</b>			
22.013	ADEVINTA ASA - B	NOK	203.564,87	0,03	6.160	AROUNDTOWN SA	EUR	35.599,28	0,00
30.027	DNB BANK ASA	NOK	687.145,78	0,09	839	EUROFINS SCIENTIFIC SE	EUR	83.932,18	0,01
15.743	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	NOK	393.755,04	0,05	122.783	TENARIS SA	EUR	1.879.132,49	0,24
18.866	MOWI ASA	NOK	513.507,32	0,07				<b>1.998.663,95</b>	<b>0,25</b>
173.908	NORSK HYDRO ASA	NOK	1.712.428,96	0,21					
39.717	ORKLA ASA	NOK	355.926,82	0,04					
5.746	SCHIBSTED ASA - A	NOK	143.321,43	0,02					
			<b>4.009.650,22</b>	<b>0,51</b>					
	<b>Curacao</b>					<b>Österreich</b>			
94.559	SCHLUMBERGER NV	USD	3.906.232,29	0,50	3.497	ERSTE GROUP BANK AG	EUR	128.751,10	0,02
			<b>3.906.232,29</b>	<b>0,50</b>	6.081	RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	EUR	87.620,02	0,01
					10.429	VERBUND AG	EUR	1.108.165,44	0,13
					9.394	VOESTALPINE AG	EUR	282.419,36	0,04
								<b>1.606.955,92</b>	<b>0,20</b>
	<b>Italien</b>					<b>Bermuda</b>			
36.195	INTESA SANPAOLO SPA	EUR	83.907,47	0,01	6.326	ARCH CAPITAL GROUP LTD	USD	306.304,92	0,04
483	MONCLER SPA	EUR	27.268,18	0,00	5.597	BUNGE LTD	USD	620.203,57	0,08
267.907	SNAM SPA	EUR	1.559.589,70	0,19	509	EVEREST RE GROUP LTD	USD	153.402,42	0,02
126.699	TELECOM ITALIA SPA/MILANO	EUR	47.014,05	0,01	7.328	INVESCO LTD	USD	168.983,68	0,02
218.955	TERNA - RETE ELETTRICA NAZIONALE	EUR	1.896.827,47	0,24				<b>1.248.894,59</b>	<b>0,16</b>
18.474	UNICREDIT SPA	EUR	202.570,47	0,03					
			<b>3.817.177,34</b>	<b>0,48</b>					
	<b>Finnland</b>					<b>Neuseeland</b>			
45.897	NESTE OYJ	EUR	2.118.271,44	0,27	13.819	AUCKLAND INTERNATIONAL AIRPORT LTD	NZD	75.260,42	0,01
54.644	NOKIA OYJ	EUR	303.116,63	0,03	6.665	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE CORP LTD	NZD	112.882,69	0,01
29.187	NORDEA BANK ABP	SEK	304.729,39	0,04	73.836	MERCURY NZ LTD	NZD	305.571,87	0,04
4.475	WARTSILA OYJ	EUR	41.356,48	0,01	183.933	MERIDIAN ENERGY LTD	NZD	646.069,56	0,09
			<b>2.767.473,94</b>	<b>0,35</b>	1.109	XERO LTD	AUD	85.570,56	0,01
								<b>1.225.355,10</b>	<b>0,16</b>
	<b>Jersey</b>					<b>Kaimaninseln</b>			
18.803	AMCOR PLC	USD	213.037,99	0,03	66.000	CK ASSET HOLDINGS LTD	HKD	452.562,76	0,05
6.020	APTIV PLC	USD	720.654,20	0,09	15.600	ESR CAYMAN LTD	HKD	48.504,74	0,01
18.157	EXPERIAN PLC	GBP	705.478,25	0,09	48.000	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT CO LTD	HKD	238.118,34	0,03
4.340	FERGUSON PLC	GBP	593.140,27	0,08				<b>739.185,84</b>	<b>0,09</b>
1.501	NOVOCURE LTD	USD	124.357,85	0,02					
23.978	WPP PLC	GBP	316.653,44	0,03					
			<b>2.673.322,00</b>	<b>0,34</b>					
	<b>Israel</b>					<b>Panama</b>			
103.835	BANK HAPAOALIM BM	ILS	1.033.062,67	0,13	32.447	CARNIVAL CORP	USD	656.078,34	0,08
3.893	CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES LTD	USD	538.246,18	0,07				<b>656.078,34</b>	<b>0,08</b>
1.147	CYBERARK SOFTWARE LTD	USD	193.556,25	0,02					
1.634	NICE LTD	ILS	358.878,37	0,05					
						<b>Liberia</b>			
					7.543	ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	USD	631.952,54	0,09
								<b>631.952,54</b>	<b>0,09</b>
						<b>Supranational-Multinational</b>			
					885	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	EUR	67.136,52	0,01
					3.431	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	EUR	260.277,29	0,04
								<b>327.413,81</b>	<b>0,05</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Global Enhanced Index Sustainable Equity

(ausgedrückt in USD)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW
<b>Portugal</b>				
4.819	JERONIMO MARTINS SGPS SA	EUR	116.513,22	0,01
			<b>116.513,22</b>	<b>0,01</b>
			<b>785.749.365,93</b>	<b>99,58</b>
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>			<b>785.749.365,93</b>	<b>99,58</b>

### Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022

Zu erhalten	Zu zahlen	Fälligkeits- datum	Engagement in USD	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in USD	
<b>Devisentermingeschäfte</b>					
1.489.118,17	CZK	64.896,24 USD	19/04/2022	64.896,24	2.818,41
180,40	USD	162,62 EUR	19/04/2022	180,40	(0,62)
2.166,19	EUR	2.416,54 USD	19/04/2022	2.416,54	(5,28)
2.196,80	USD	50.997,15 CZK	19/04/2022	2.196,80	(122,19)
			<b>69.689,98</b>	<b>2.690,32</b>	
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>				<b>2.690,32</b>	

### Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick

		% NIW
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	<b>785.749.365,93</b>	<b>99,58</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	<b>2.690,32</b>	<b>0,00</b>
<b>Bankguthaben</b>	<b>1.823.009,45</b>	<b>0,23</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>	<b>1.470.667,35</b>	<b>0,19</b>
<b>Nettovermögen Gesamt</b>	<b>789.045.733,05</b>	<b>100,00</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.



## NN (L) Global Equity Impact Opportunities

(ausgedrückt in EUR)

### Statistische Angaben

<b>Nettovermögen</b>	31.03.2022	EUR	407.643.201,38	Capitalisation X (HUF)	31.03.2022	HUF	145.877,73
	30.09.2021	EUR	477.295.733,09		30.09.2021	HUF	157.914,27
	30.09.2020	EUR	358.534.001,52		30.09.2020	HUF	127.365,27
<b>Nettoinventarwert pro Anteil**</b>				Capitalisation X (USD)	31.03.2022	USD	473,21
					30.09.2021	USD	545,45
					30.09.2020	USD	440,24
Capitalisation I (EUR)	31.03.2022	EUR	14.109,65	Capitalisation X Hedged (i) (CZK)	31.03.2022	CZK	14.545,34
	30.09.2021	EUR	15.499,29		30.09.2021	CZK	15.851,84
	30.09.2020	EUR	12.181,36		30.09.2020	CZK	12.581,62
Capitalisation I (USD)	31.03.2022	USD	11.879,53	Distribution N (EUR)	31.03.2022	EUR	-
	30.09.2021	USD	13.592,48		30.09.2021	EUR	-
	30.09.2020	USD	10.809,27		30.09.2020	EUR	548,91
Capitalisation I Hedged (i) (CZK)	31.03.2022	CZK	244.162,32	Distribution P (EUR)	31.03.2022	EUR	604,64
	30.09.2021	CZK	264.716,32		30.09.2021	EUR	667,48
	30.09.2020	CZK	207.244,48		30.09.2020	EUR	529,81
Capitalisation I Hedged (i) (NOK)	31.03.2022	NOK	50.090,87	Distribution R (EUR)	31.03.2022	EUR	74,49
	30.09.2021	NOK	54.774,91		30.09.2021	EUR	81,92
	30.09.2020	NOK	-		30.09.2020	EUR	64,54
Capitalisation I Hedged (i) (PLN)	31.03.2022	PLN	59.629,88	<b>Anzahl der Anteile</b>	Capitalisation I (EUR)	31.03.2022	8.589
	30.09.2021	PLN	64.726,78			30.09.2021	10.040
	30.09.2020	PLN	50.575,24			30.09.2020	9.795
Capitalisation M (EUR)	31.03.2022	EUR	614,87	Capitalisation I (USD)	31.03.2022	129	
	30.09.2021	EUR	677,38		30.09.2021	184	
	30.09.2020	EUR	535,47		30.09.2020	3	
Capitalisation N (EUR)	31.03.2022	EUR	660,46	Capitalisation I Hedged (i) (CZK)	31.03.2022	2.556	
	30.09.2021	EUR	724,75		30.09.2021	2.449	
	30.09.2020	EUR	568,41		30.09.2020	2.475	
Capitalisation O (EUR)	31.03.2022	EUR	660,43	Capitalisation I Hedged (i) (NOK)	31.03.2022	314	
	30.09.2021	EUR	724,71		30.09.2021	338	
	30.09.2020	EUR	568,35		30.09.2020	-	
Capitalisation P (EUR)	31.03.2022	EUR	604,09	Capitalisation I Hedged (i) (PLN)	31.03.2022	4.157	
	30.09.2021	EUR	666,88		30.09.2021	4.190	
	30.09.2020	EUR	529,33		30.09.2020	1.395	
Capitalisation P (USD)	31.03.2022	USD	224,27	Capitalisation M (EUR)	31.03.2022	7.057	
	30.09.2021	USD	257,88		30.09.2021	7.433	
	30.09.2020	USD	207,13		30.09.2020	9.944	
Capitalisation R (EUR)	31.03.2022	EUR	287,97	Capitalisation N (EUR)	31.03.2022	40.717	
	30.09.2021	EUR	316,71		30.09.2021	42.621	
	30.09.2020	EUR	249,98		30.09.2020	45.888	
Capitalisation R (USD)	31.03.2022	USD	313,24	Capitalisation O (EUR)	31.03.2022	76.828	
	30.09.2021	USD	358,84		30.09.2021	82.893	
	30.09.2020	USD	286,05		30.09.2020	107.686	
Capitalisation X (EUR)	31.03.2022	EUR	560,18				
	30.09.2021	EUR	619,95				
	30.09.2020	EUR	494,56				

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

## NN (L) Global Equity Impact Opportunities

(ausgedrückt in EUR)

### Statistische Angaben (Fortsetzung)

Anzahl der Anteile			Laufende Kosten in %*		
Capitalisation P (EUR)	31.03.2022	56.742	Capitalisation I (EUR)	31.03.2022	0,81%
	30.09.2021	61.858	Capitalisation I (USD)	31.03.2022	0,81%
	30.09.2020	75.321	Capitalisation I Hedged (i) (CZK)	31.03.2022	0,83%
Capitalisation P (USD)	31.03.2022	989	Capitalisation I Hedged (i) (NOK)	31.03.2022	0,83%
	30.09.2021	1.040	Capitalisation I Hedged (i) (PLN)	31.03.2022	0,83%
	30.09.2020	499	Capitalisation M (EUR)	31.03.2022	1,39%
Capitalisation R (EUR)	31.03.2022	215	Capitalisation N (EUR)	31.03.2022	0,60%
	30.09.2021	275	Capitalisation O (EUR)	31.03.2022	0,60%
	30.09.2020	1.541	Capitalisation P (EUR)	31.03.2022	1,80%
Capitalisation R (USD)	31.03.2022	709	Capitalisation P (USD)	31.03.2022	1,80%
	30.09.2021	709	Capitalisation R (EUR)	31.03.2022	1,05%
	30.09.2020	709	Capitalisation R (USD)	31.03.2022	1,05%
Capitalisation X (EUR)	31.03.2022	114.905	Capitalisation X (EUR)	31.03.2022	2,30%
	30.09.2021	110.529	Capitalisation X (HUF)	31.03.2022	2,30%
	30.09.2020	97.075	Capitalisation X (USD)	31.03.2022	2,30%
Capitalisation X (HUF)	31.03.2022	327	Capitalisation X Hedged (i) (CZK)	31.03.2022	2,32%
	30.09.2021	761	Distribution P (EUR)	31.03.2022	1,80%
	30.09.2020	269	Distribution R (EUR)	31.03.2022	1,05%
Capitalisation X (USD)	31.03.2022	4.646	<b>Portfolioumsatz in %*</b>	31.03.2022	9,38%
	30.09.2021	6.081			
	30.09.2020	5.473			
Capitalisation X Hedged (i) (CZK)	31.03.2022	12.495			
	30.09.2021	12.069			
	30.09.2020	11.887			
Distribution N (EUR)	31.03.2022	-			
	30.09.2021	-			
	30.09.2020	74			
Distribution P (EUR)	31.03.2022	10.906			
	30.09.2021	11.920			
	30.09.2020	15.074			
Distribution R (EUR)	31.03.2022	97.143			
	30.09.2021	99.956			
	30.09.2020	121.765			

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

## NN (L) Global Equity Impact Opportunities

(ausgedrückt in EUR)

### Finanzabschlüsse

#### Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022

	Erläuterungen	
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	2	<b>402.138.443,09</b>
Aktien		402.138.443,09
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	2	<b>2.081.994,64</b>
Devisentermingeschäfte		2.081.994,64
<b>Bankguthaben</b>		<b>5.812.606,22</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte</b>	4	<b>4.465.918,38</b>
<b>Vermögenswerte Gesamt</b>		<b>414.498.962,33</b>
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>	4, 12	<b>(6.855.760,95)</b>
<b>Verbindlichkeiten Gesamt</b>		<b>(6.855.760,95)</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Berichtszeitraums</b>		<b>407.643.201,38</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Global Equity Impact Opportunities

(ausgedrückt in EUR)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
<b>Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>				
<b>Aktien</b>				
<b>Vereinigte Staaten</b>				
22.000	ADOBE INC	USD	9.008.798,81	2,21
104.000	AMERICAN WATER WORKS CO INC	USD	15.472.179,03	3,80
43.000	ANSYS INC	USD	12.276.052,67	3,01
71.200	BLOCK INC - A	USD	8.677.230,04	2,13
58.000	DANAHER CORP	USD	15.290.648,45	3,75
14.500	DEXCOM INC	USD	6.667.146,00	1,64
64.000	EDWARDS LIFESCIENCES CORP	USD	6.771.293,76	1,66
49.000	ETSY INC	USD	5.473.167,66	1,34
140.000	HOLOGIC INC	USD	9.665.932,68	2,37
22.500	ILLUMINA INC	USD	7.065.564,19	1,73
39.000	INTUIT INC	USD	16.854.141,01	4,13
35.000	INTUITIVE SURGICAL INC	USD	9.489.776,66	2,33
23.500	PAYCOM SOFTWARE INC	USD	7.315.804,61	1,79
453.000	SHOALS TECHNOLOGIES GROUP INC - A	USD	6.937.599,42	1,71
53.000	SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	USD	15.355.781,24	3,77
31.500	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	USD	16.721.767,85	4,10
18.500	TYLER TECHNOLOGIES INC/THE	USD	7.397.173,41	1,81
45.000	UNITEDHEALTH GROUP INC	USD	20.625.219,07	5,06
52.000	VEEVA SYSTEMS INC - A	USD	9.929.375,81	2,44
			<b>206.994.652,37</b>	<b>50,78</b>
<b>Vereinigtes Königreich</b>				
1.500.000	GB GROUP PLC	GBP	9.798.104,82	2,40
520.000	HALMA PLC	GBP	15.445.031,90	3,79
8.700.000	HELIOS TOWERS PLC	GBP	11.880.557,10	2,91
705.000	RWS HOLDINGS PLC	GBP	3.086.758,02	0,76
			<b>40.210.451,84</b>	<b>9,86</b>
<b>Niederlande</b>				
114.000	ALFEN BEHEER BV	EUR	10.522.200,00	2,58
17.500	ASML HOLDING NV	EUR	10.675.000,00	2,62
			<b>21.197.200,00</b>	<b>5,20</b>
<b>Irland</b>				
37.000	ICON PLC - ADR	USD	8.088.024,09	1,98
62.000	TRANE TECHNOLOGIES PLC	USD	8.508.875,21	2,09
			<b>16.596.899,30</b>	<b>4,07</b>
<b>Färöer-Inseln</b>				
248.000	BAKKAFROST P/F	NOK	15.116.026,21	3,71
			<b>15.116.026,21</b>	<b>3,71</b>
<b>Hongkong</b>				
1.520.000	AIA GROUP LTD	HKD	14.382.562,42	3,53
			<b>14.382.562,42</b>	<b>3,53</b>
<b>Indien</b>				
460.000	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP LTD	INR	13.041.990,82	3,20
			<b>13.041.990,82</b>	<b>3,20</b>
<b>Dänemark</b>				
60.000	CHR HANSEN HOLDING AS	DKK	4.006.477,24	0,98

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
133.900	NETCOMPANY GROUP AS	DKK	8.039.269,09	1,97
			<b>12.045.746,33</b>	<b>2,95</b>
<b>Kanada</b>				
160.000	DESCARTES SYSTEMS GROUP INC	CAD	10.537.680,87	2,59
			<b>10.537.680,87</b>	<b>2,59</b>
<b>Schweiz</b>				
31.500	SIKA AG - REG	CHF	9.456.926,40	2,32
			<b>9.456.926,40</b>	<b>2,32</b>
<b>Frankreich</b>				
62.000	SCHNEIDER ELECTRIC SE	EUR	9.433.920,00	2,31
			<b>9.433.920,00</b>	<b>2,31</b>
<b>Norwegen</b>				
179.000	TOMRA SYSTEMS ASA	NOK	8.303.278,92	2,04
			<b>8.303.278,92</b>	<b>2,04</b>
<b>Kenia</b>				
27.000.000	SAFARICOM PLC	KES	7.153.309,22	1,75
			<b>7.153.309,22</b>	<b>1,75</b>
<b>Schweden</b>				
84.000	MIPS AB	SEK	7.128.783,40	1,75
			<b>7.128.783,40</b>	<b>1,75</b>
<b>Japan</b>				
240.000	SMS CO LTD	JPY	6.033.414,99	1,48
			<b>6.033.414,99</b>	<b>1,48</b>
<b>Deutschland</b>				
110.000	HELLOFRESH SE	EUR	4.505.600,00	1,11
			<b>4.505.600,00</b>	<b>1,11</b>
			<b>402.138.443,09</b>	<b>98,65</b>
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>			<b>402.138.443,09</b>	<b>98,65</b>

### Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022

Zu erhalten	Zu zahlen	Fälligkeits- datum	Engagement in EUR	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR		
<b>Devisentermingeschäfte</b>						
849.972.870,17	CZK	33.502.685,11	EUR	19/04/2022	33.502.685,11	1.219.843,02
269.255.852,83	PLN	56.922.240,88	EUR	19/04/2022	56.922.240,88	1.043.213,28
15.983.996,92	NOK	1.620.377,53	EUR	19/04/2022	1.620.377,53	21.516,09
11.393,42	EUR	278.227,33	CZK	04/04/2022	11.393,42	2,54
64.261,77	EUR	1.574.092,12	CZK	01/04/2022	64.261,77	(182,98)
2.014.148,04	EUR	51.267.006,27	CZK	19/04/2022	2.014.148,04	(80.177,71)

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Global Equity Impact Opportunities

(ausgedrückt in EUR)

### Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Zu erhalten	Zu zahlen	Fälligkeits- datum	Engagement in EUR	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR
3.651.037,34 EUR	17.527.189,76 PLN	19/04/2022	3.651.037,34	(122.219,60)
			<b>97.786.144,09</b>	<b>2.081.994,64</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>				<b>2.081.994,64</b>

### Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick

		% NIW
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	<b>402.138.443,09</b>	<b>98,65</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	<b>2.081.994,64</b>	<b>0,51</b>
<b>Bankguthaben</b>	<b>5.812.606,22</b>	<b>1,43</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>	<b>(2.389.842,57)</b>	<b>(0,59)</b>
<b>Nettovermögen Gesamt</b>	<b>407.643.201,38</b>	<b>100,00</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Global High Dividend

(ausgedrückt in EUR)

### Statistische Angaben

<b>Nettovermögen</b>	31.03.2022	EUR	636.190.350,44	Distribution P (Q) (USD)	31.03.2022	USD	148,80
	30.09.2021	EUR	551.562.636,65		30.09.2021	USD	145,75
	30.09.2020	EUR	349.857.303,39		30.09.2020	USD	116,29
<b>Nettoinventarwert pro Anteil**</b>				Distribution R (EUR)	31.03.2022	EUR	317,83
					30.09.2021	EUR	300,76
					30.09.2020	EUR	235,62
Capitalisation I (EUR)	31.03.2022	EUR	711,84	Distribution X (M) (USD)	31.03.2022	USD	291,92
	30.09.2021	EUR	660,10		30.09.2021	USD	287,29
	30.09.2020	EUR	504,37		30.09.2020	USD	230,99
Capitalisation I (USD)	31.03.2022	USD	792,58	Distribution X (M) Hedged (ii) (AUD)	31.03.2022	AUD	304,13
	30.09.2021	USD	765,53		30.09.2021	AUD	298,18
	30.09.2020	USD	591,84		30.09.2020	AUD	240,36
Capitalisation I Hedged (i) (CZK)	31.03.2022	CZK	232.654,40	Distribution X (Q) (EUR)	31.03.2022	EUR	391,80
	30.09.2021	CZK	213.075,35		30.09.2021	EUR	369,45
	30.09.2020	CZK	162.482,18		30.09.2020	EUR	292,75
Capitalisation I Hedged (i) (PLN)	31.03.2022	PLN	81.064,41	Distribution Y (M) (USD)	31.03.2022	USD	260,40
	30.09.2021	PLN	74.419,45		30.09.2021	USD	257,78
	30.09.2020	PLN	56.600,99		30.09.2020	USD	209,72
Capitalisation P (EUR)	31.03.2022	EUR	598,92	Distribution Y (M) Hedged (ii) (AUD)	31.03.2022	AUD	273,54
	30.09.2021	EUR	558,13		30.09.2021	AUD	269,71
	30.09.2020	EUR	430,70		30.09.2020	AUD	220,12
Capitalisation P (USD)	31.03.2022	USD	657,19	Distribution Zz (EUR)	31.03.2022	EUR	249.889,78
	30.09.2021	USD	637,88		30.09.2021	EUR	-
	30.09.2020	USD	498,06		30.09.2020	EUR	-
Capitalisation R (EUR)	31.03.2022	EUR	350,06	<b>Anzahl der Anteile</b>			
	30.09.2021	EUR	325,00		Capitalisation I (EUR)	31.03.2022	273.412
	30.09.2020	EUR	248,92		30.09.2021	289.718	
Capitalisation R (USD)	31.03.2022	USD	312,36	30.09.2020	178.778		
	30.09.2021	USD	302,04	Capitalisation I (USD)	31.03.2022	13	
	30.09.2020	USD	234,07	30.09.2021	52		
Capitalisation X (EUR)	31.03.2022	EUR	541,96	30.09.2020	52		
	30.09.2021	EUR	506,32	Capitalisation I Hedged (i) (CZK)	31.03.2022	5.736	
	30.09.2020	EUR	392,67	30.09.2021	5.800		
Capitalisation X (HUF)	31.03.2022	HUF	154.515,59	30.09.2020	5.759		
	30.09.2021	HUF	141.203,21	Capitalisation I Hedged (i) (PLN)	31.03.2022	7.075	
	30.09.2020	HUF	110.716,93	30.09.2021	6.114		
Capitalisation X (USD)	31.03.2022	USD	593,55	30.09.2020	5.955		
	30.09.2021	USD	577,54	Capitalisation P (EUR)	31.03.2022	102.664	
	30.09.2020	USD	453,17	30.09.2021	105.490		
Capitalisation X Hedged (i) (CZK)	31.03.2022	CZK	14.071,35	30.09.2020	121.999		
	30.09.2021	CZK	12.983,93	Capitalisation P (USD)	31.03.2022	9.397	
	30.09.2020	CZK	10.039,03	30.09.2021	66.620		
Distribution P (EUR)	31.03.2022	EUR	1.361,33	30.09.2020	57.879		
	30.09.2021	EUR	1.293,12				
	30.09.2020	EUR	1.020,83				

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

## NN (L) Global High Dividend

(ausgedrückt in EUR)

### Statistische Angaben (Fortsetzung)

Anzahl der Anteile			Anzahl der Anteile			
Capitalisation R (EUR)	31.03.2022	1.544	Distribution Zz (EUR)	31.03.2022	254	
	30.09.2021	1.898		30.09.2021	-	
	30.09.2020	3.628		30.09.2020	-	
Capitalisation R (USD)	31.03.2022	33	<b>Dividende</b>			
	30.09.2021	33		Distribution P (EUR)	14.12.2021 EUR	25,65
	30.09.2020	33		Distribution P (Q) (USD)	11.02.2022 USD	0,73
Capitalisation X (EUR)	31.03.2022	44.391		Distribution P (Q) (USD)	11.11.2021 USD	0,65
	30.09.2021	46.730		Distribution R (EUR)	14.12.2021 EUR	5,95
	30.09.2020	47.948		Distribution X (M) (USD)	02.03.2022 USD	0,55
Capitalisation X (HUF)	31.03.2022	1.933		Distribution X (M) (USD)	07.02.2022 USD	0,55
	30.09.2021	1.230		Distribution X (M) (USD)	04.01.2022 USD	0,55
	30.09.2020	1.256		Distribution X (M) (USD)	02.12.2021 USD	0,55
Capitalisation X (USD)	31.03.2022	5.553		Distribution X (M) (USD)	02.11.2021 USD	0,55
	30.09.2021	7.327		Distribution X (M) (USD)	04.10.2021 USD	0,55
	30.09.2020	5.465		Distribution X (M) Hedged (ii) (AUD)	02.03.2022 AUD	0,60
Capitalisation X Hedged (i) (CZK)	31.03.2022	92.100		Distribution X (M) Hedged (ii) (AUD)	07.02.2022 AUD	0,60
	30.09.2021	83.791	Distribution X (M) Hedged (ii) (AUD)	04.01.2022 AUD	0,60	
	30.09.2020	68.994	Distribution X (M) Hedged (ii) (AUD)	02.12.2021 AUD	0,60	
Distribution P (EUR)	31.03.2022	11.284	Distribution X (M) Hedged (ii) (AUD)	02.11.2021 AUD	0,60	
	30.09.2021	12.326	Distribution X (M) Hedged (ii) (AUD)	04.10.2021 AUD	0,60	
	30.09.2020	16.328	Distribution X (Q) (EUR)	11.02.2022 EUR	1,88	
Distribution P (Q) (USD)	31.03.2022	1.578	Distribution X (Q) (EUR)	11.11.2021 EUR	1,75	
	30.09.2021	1.578	Distribution Y (M) (USD)	02.03.2022 USD	0,53	
	30.09.2020	9.978	Distribution Y (M) (USD)	07.02.2022 USD	0,53	
Distribution R (EUR)	31.03.2022	990	Distribution Y (M) (USD)	04.01.2022 USD	0,53	
	30.09.2021	990	Distribution Y (M) (USD)	02.12.2021 USD	0,53	
	30.09.2020	1.604	Distribution Y (M) (USD)	02.11.2021 USD	0,53	
Distribution X (M) (USD)	31.03.2022	19.046	Distribution Y (M) (USD)	04.10.2021 USD	0,60	
	30.09.2021	18.895	Distribution Y (M) (USD)			
	30.09.2020	18.899				
Distribution X (M) Hedged (ii) (AUD)	31.03.2022	14.895				
	30.09.2021	15.882				
	30.09.2020	16.690				
Distribution X (Q) (EUR)	31.03.2022	744				
	30.09.2021	751				
	30.09.2020	1.132				
Distribution Y (M) (USD)	31.03.2022	105.067				
	30.09.2021	89.868				
	30.09.2020	4.461				
Distribution Y (M) Hedged (ii) (AUD)	31.03.2022	13.259				
	30.09.2021	8.465				
	30.09.2020	3.769				

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

## NN (L) Global High Dividend

(ausgedrückt in EUR)

### Statistische Angaben (Fortsetzung)

				Laufende Kosten in %*		
Distribution Y (M) Hedged (ii) (AUD)	02.03.2022	AUD	0,58	Capitalisation I (EUR)	31.03.2022	0,81%
Distribution Y (M) Hedged (ii) (AUD)	07.02.2022	AUD	0,58	Capitalisation I (USD)	31.03.2022	0,81%
Distribution Y (M) Hedged (ii) (AUD)	04.01.2022	AUD	0,58	Capitalisation I Hedged (i) (CZK)	31.03.2022	0,83%
Distribution Y (M) Hedged (ii) (AUD)	02.12.2021	AUD	0,58	Capitalisation I Hedged (i) (PLN)	31.03.2022	0,83%
Distribution Y (M) Hedged (ii) (AUD)	02.11.2021	AUD	0,58	Capitalisation P (EUR)	31.03.2022	1,80%
Distribution Y (M) Hedged (ii) (AUD)	04.10.2021	AUD	0,58	Capitalisation P (USD)	31.03.2022	1,80%
				Capitalisation R (EUR)	31.03.2022	1,05%
				Capitalisation R (USD)	31.03.2022	1,05%
				Capitalisation X (EUR)	31.03.2022	2,30%
				Capitalisation X (HUF)	31.03.2022	2,30%
				Capitalisation X (USD)	31.03.2022	2,30%
				Capitalisation X Hedged (i) (CZK)	31.03.2022	2,32%
				Distribution P (EUR)	31.03.2022	1,80%
				Distribution P (Q) (USD)	31.03.2022	1,80%
				Distribution R (EUR)	31.03.2022	1,05%
				Distribution X (M) (USD)	31.03.2022	2,30%
				Distribution X (M) Hedged (ii) (AUD)	31.03.2022	2,32%
				Distribution X (Q) (EUR)	31.03.2022	2,30%
				Distribution Y (M) (USD)	31.03.2022	3,30%
				Distribution Y (M) Hedged (ii) (AUD)	31.03.2022	3,32%
				Distribution Zz (EUR)	31.03.2022	0,01%
				<b>Portfolioumsatz in %*</b>	31.03.2022	122,27%

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.



## NN (L) Global High Dividend

(ausgedrückt in EUR)

### Finanzabschlüsse

#### Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022

	Erläuterungen	
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	2	<b>620.556.479,07</b>
Aktien		620.556.479,07
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	2	<b>5.578.784,13</b>
Devisentermingeschäfte		5.578.784,13
<b>Bankguthaben</b>		<b>16.712.214,59</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte</b>	4	<b>8.103.984,52</b>
<b>Vermögenswerte Gesamt</b>		<b>650.951.462,31</b>
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>	4, 12	<b>(14.761.111,87)</b>
<b>Verbindlichkeiten Gesamt</b>		<b>(14.761.111,87)</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Berichtszeitraums</b>		<b>636.190.350,44</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Global High Dividend

(ausgedrückt in EUR)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW	Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
<b>Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>					306.427	UNILEVER PLC	EUR	12.546.653,52	1,97
					<b>Frankreich</b>				
					136.834	COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	EUR	7.425.981,18	1,17
					167.995	DANONE SA	EUR	8.404.789,85	1,32
					400.758	ENGIE SA	EUR	4.782.645,97	0,75
					67.865	SANOFI	EUR	6.278.191,15	0,99
					209.182	TOTALENERGIES SE	EUR	9.628.647,46	1,51
					70.812	VINCI SA	EUR	6.584.807,88	1,04
					<b>43.105.063,49 6,78</b>				
					<b>Japan</b>				
					417.100	ANRITSU CORP	JPY	4.796.493,09	0,76
					175.700	BRIDGESTONE CORP	JPY	6.190.252,68	0,97
					111.100	HONDA MOTOR CO LTD	JPY	2.868.654,10	0,45
					145.100	MURATA MANUFACTURING CO LTD	JPY	8.721.177,71	1,37
					83.500	SONY GROUP CORP	JPY	7.870.948,24	1,24
					116.900	TOKIO MARINE HOLDINGS INC	JPY	6.170.130,93	0,97
					70.800	TREND MICRO INC/JAPAN	JPY	3.753.690,47	0,59
					<b>40.371.347,22 6,35</b>				
					<b>Deutschland</b>				
					79.754	CONTINENTAL AG	EUR	5.215.911,60	0,82
					365.941	DEUTSCHE TELEKOM AG - REG	EUR	6.196.113,01	0,98
					60.542	HENKEL AG & CO KGAA	EUR	3.629.492,90	0,57
					30.331	SAP SE	EUR	3.067.070,72	0,48
					51.177	SIEMENS AG - REG	EUR	6.430.901,82	1,01
					58.779	VOLKSWAGEN AG - PREF	EUR	9.228.303,00	1,45
					<b>33.767.793,05 5,31</b>				
					<b>Schweiz</b>				
					24.360	CHUBB LTD	USD	4.683.057,57	0,74
					9.743	DORMAKABA HOLDING AG - REG	CHF	4.517.924,87	0,71
					17.438	ROCHE HOLDING AG - GENUSSSCHEIN	CHF	6.240.896,66	0,98
					456.086	UBS GROUP AG - REG	CHF	8.082.380,76	1,27
					<b>23.524.259,86 3,70</b>				
					<b>Niederlande</b>				
					43.355	AIRBUS SE	EUR	4.784.657,80	0,75
					60.397	AKZO NOBEL NV	EUR	4.724.253,34	0,74
					270.721	KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	EUR	7.882.041,92	1,25
					106.326	KONINKLIJKE PHILIPS NV	EUR	2.948.419,98	0,46
					68.074	SIGNIFY NV	EUR	2.888.379,82	0,45
					<b>23.227.752,86 3,65</b>				
					<b>Irland</b>				
					173.705	MEDTRONIC PLC	USD	17.321.322,74	2,72
					160.614	NVENT ELECTRIC PLC	USD	5.020.585,92	0,79
					<b>22.341.908,66 3,51</b>				
					<b>Italien</b>				
					1.275.491	ENEL SPA	EUR	7.739.679,39	1,22
					1.539.437	INTESA SANPAOLO SPA	EUR	3.207.416,99	0,50
					<b>10.947.096,38 1,72</b>				
					<b>Australien</b>				
					102.481	BHP GROUP LTD	AUD	3.579.366,17	0,56
					417.463	GOODMAN GROUP	AUD	6.449.353,81	1,02
					<b>10.028.719,98 1,58</b>				
<b>Aktien</b>									
<b>Vereinigte Staaten</b>									
36.911	ADVANCE AUTO PARTS INC	USD	6.865.681,54	1,08					
108.401	AFLAC INC	USD	6.273.257,89	0,99					
75.478	ALLSTATE CORP/THE	USD	9.395.998,54	1,48					
42.884	AMERICAN TOWER CORP	USD	9.682.576,26	1,52					
22.719	AMERISOURCEBERGEN CORP - A	USD	3.158.995,63	0,50					
30.201	ATMOS ENERGY CORP	USD	3.243.353,70	0,51					
216.693	BAKER HUGHES CO - A	USD	7.090.991,89	1,11					
341.617	BANK OF NEW YORK MELLON CORP/THE	USD	15.237.902,04	2,40					
26.418	BECTON DICKINSON AND CO	USD	6.315.721,93	0,99					
10.719	BLACKROCK INC - A	USD	7.361.828,27	1,16					
116.849	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	USD	7.669.511,95	1,21					
123.507	CARDINAL HEALTH INC	USD	6.293.845,23	0,99					
57.268	CHEVRON CORP	USD	8.380.846,12	1,32					
21.845	CIGNA CORP	USD	4.704.336,90	0,74					
351.248	CISCO SYSTEMS INC/DELAWARE	USD	17.602.649,96	2,76					
379.223	CONAGRA BRANDS INC	USD	11.441.617,86	1,79					
36.248	CONOCOPHILLIPS	USD	3.257.807,94	0,51					
69.039	CVS HEALTH CORP	USD	6.279.995,68	0,99					
89.484	EDISON INTERNATIONAL	USD	5.637.737,29	0,89					
122.632	EMERSON ELECTRIC CO	USD	10.806.693,57	1,70					
97.989	EXXON MOBIL CORP	USD	7.273.546,50	1,14					
284.383	FIRST HAWAIIAN INC	USD	7.128.424,81	1,12					
208.926	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	USD	6.446.258,55	1,01					
184.463	INTEL CORP	USD	8.216.407,93	1,29					
102.345	JOHNSON & JOHNSON	USD	16.302.165,42	2,56					
113.395	JPMORGAN CHASE & CO	USD	13.892.964,00	2,18					
71.457	KIMBERLY-CLARK CORP	USD	7.909.624,88	1,24					
182.789	MERCK & CO INC	USD	13.479.384,76	2,12					
132.792	MSC INDUSTRIAL DIRECT CO INC - A	USD	10.169.600,79	1,60					
75.285	NORTHERN TRUST CORP	USD	7.879.331,55	1,24					
92.075	ORACLE CORP	USD	6.846.146,36	1,08					
44.293	PACKAGING CORP OF AMERICA	USD	6.214.515,10	0,98					
65.357	PINNACLE WEST CAPITAL CORP	USD	4.587.589,72	0,72					
80.128	PROSPERITY BANCSHARES INC	USD	4.996.432,52	0,79					
36.129	QUALCOMM INC	USD	4.962.237,70	0,78					
66.535	QUEST DIAGNOSTICS INC	USD	8.184.047,18	1,29					
52.907	RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	USD	4.710.822,35	0,74					
50.727	REGENCY CENTERS CORP	USD	3.252.473,09	0,51					
63.610	REINSURANCE GROUP OF AMERICA INC - A	USD	6.257.808,48	0,98					
118.671	SONOCO PRODUCTS CO	USD	6.672.410,70	1,05					
59.240	T ROWE PRICE GROUP INC	USD	8.049.697,21	1,27					
180.646	TRUIST FINANCIAL CORP	USD	9.205.615,60	1,45					
134.095	US BANCORP	USD	6.405.562,62	1,01					
416.022	VERIZON COMMUNICATIONS INC	USD	19.046.565,12	2,98					
			<b>354.790.983,13</b>	<b>55,77</b>					
<b>Vereinigtes Königreich</b>									
313.698	GLAXOSMITHKLINE PLC	GBP	6.114.625,01	0,96					
339.876	MONDI PLC	GBP	5.998.677,31	0,94					
484.923	PRUDENTIAL PLC	GBP	6.507.251,35	1,02					
725.157	SMITH & NEPHEW PLC	GBP	10.468.961,89	1,64					
226.883	SSE PLC	GBP	4.694.391,84	0,74					

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Global High Dividend

(ausgedrückt in EUR)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
<b>Kanada</b>				
165.680	OPEN TEXT CORP	CAD	6.319.598,50	0,99
			<b>6.319.598,50</b>	<b>0,99</b>
<b>Schweden</b>				
692.244	SVENSKA HANDELSBANKEN AB - A	SEK	5.801.395,02	0,91
			<b>5.801.395,02</b>	<b>0,91</b>
			<b>620.556.479,07</b>	<b>97,54</b>
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>			<b>620.556.479,07</b>	<b>97,54</b>

### Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022

Zu erhalten	Zu zahlen	Fälligkeits- datum	Engagement in EUR	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR	
<b>Devisentermingeschäfte</b>					
2.748.520.751,33	CZK	108.294.025,96 EUR	19/04/2022	108.294.025,96	3.986.721,40
607.847.929,77	PLN	128.567.653,98 EUR	19/04/2022	128.567.653,98	2.289.970,62
5.604.821,78	AUD	4.081.987,18 USD	20/04/2022	3.624.630,93	114.749,00
7.896.365,83	EUR	6.607.521,00 GBP	30/06/2022	7.896.365,83	107.196,72
549.297,73	AUD	46.063.591,00 JPY	20/04/2022	355.885,00	29.595,56
1.300.291,70	AUD	859.501,85 EUR	20/04/2022	859.501,85	17.846,52
1.293.024,03	EUR	172.484.104,00 JPY	30/06/2022	1.293.024,03	17.143,08
436.155,81	AUD	238.123,43 GBP	20/04/2022	283.500,00	12.668,02
295.283,45	AUD	198.771,37 CHF	20/04/2022	192.461,45	5.095,69
301.188,41	AUD	278.060,85 CAD	20/04/2022	195.087,20	3.248,46
63.792,52	AUD	309.033,13 DKK	20/04/2022	41.240,38	1.497,88
71.092,31	AUD	405.319,58 HKD	20/04/2022	46.168,27	1.467,59
34.399.202,00	DKK	4.623.945,79 EUR	30/06/2022	4.623.945,79	553,87
32.463,27	AUD	32.225,28 SGD	20/04/2022	21.154,63	514,92
92.714,74	AUD	645.444,35 SEK	20/04/2022	60.315,21	322,93
100.678,21	SEK	14.228,13 AUD	20/04/2022	9.667,27	107,36
42.839,63	CHF	61.939,16 AUD	20/04/2022	41.928,23	49,46
129.242,40	EUR	3.156.099,44 CZK	04/04/2022	129.242,40	28,84
25.558,11	DKK	5.063,09 AUD	20/04/2022	3.435,12	19,68
35.419,41	HKD	6.068,82 AUD	20/04/2022	4.106,10	(31,31)
15.210,74	CAD	16.295,96 AUD	20/04/2022	10.904,26	(56,30)
22.318,85	EUR	232.293,00 SEK	30/06/2022	22.318,85	(56,40)
101.792,44	EUR	2.493.405,91 CZK	01/04/2022	101.792,44	(289,85)
1.332.084,38	EUR	1.363.780,00 CHF	30/06/2022	1.332.084,38	(365,72)
357.210,99	EUR	530.832,78 AUD	20/04/2022	357.210,99	(958,86)
2.232.263,00	JPY	26.515,80 AUD	20/04/2022	17.788,80	(1.364,43)
51.414,56	GBP	92.328,09 AUD	20/04/2022	61.857,30	(1.490,51)
3.803.551,00	SGD	2.537.043,61 EUR	30/06/2022	2.537.043,61	(19.965,96)

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

Zu erhalten	Zu zahlen	Fälligkeits- datum	Engagement in EUR	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR	
6.061.618,00	AUD	4.120.326,28 EUR	30/06/2022	4.120.326,28	(37.177,57)
43.659.326,00	HKD	5.056.443,57 EUR	30/06/2022	5.056.443,57	(56.637,56)
23.064.081,00	CAD	16.608.456,86 EUR	30/06/2022	16.608.456,86	(75.338,05)
4.832.623,48	EUR	22.878.197,35 PLN	19/04/2022	4.832.623,48	(92.599,45)
3.313.201,37	EUR	84.218.770,45 CZK	19/04/2022	3.313.201,37	(127.248,00)
62.178.826,00	USD	56.281.839,94 EUR	30/06/2022	56.281.839,94	(596.433,50)
				<b>351.197.231,76</b>	<b>5.578.784,13</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>					<b>5.578.784,13</b>

### Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick

		% NIW
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	<b>620.556.479,07</b>	<b>97,54</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	<b>5.578.784,13</b>	<b>0,88</b>
<b>Bankguthaben</b>	<b>16.712.214,59</b>	<b>2,63</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>	<b>(6.657.127,35)</b>	<b>(1,05)</b>
<b>Nettovermögen Gesamt</b>	<b>636.190.350,44</b>	<b>100,00</b>

## NN (L) Global High Yield

(ausgedrückt in EUR)

### Statistische Angaben

<b>Nettovermögen</b>	31.03.2022	EUR	2.597.685.997,22	Distribution I (Q) Hedged (iii) (EUR)	31.03.2022	EUR	4.177,20
	30.09.2021	EUR	2.161.764.602,16		30.09.2021	EUR	4.479,21
	30.09.2020	EUR	1.720.274.544,64		30.09.2020	EUR	4.253,90
<b>Nettoinventarwert pro Anteil**</b>				Distribution N (Q) Hedged (iii) (EUR)	31.03.2022	EUR	205,50
					30.09.2021	EUR	220,32
					30.09.2020	EUR	209,29
Capitalisation I (USD)	31.03.2022	USD	7.947,00	Distribution P Hedged (iii) (EUR)	31.03.2022	EUR	740,82
	30.09.2021	USD	8.428,67		30.09.2021	EUR	808,58
	30.09.2020	USD	7.611,36		30.09.2020	EUR	765,93
Capitalisation I Hedged (iii) (EUR)	31.03.2022	EUR	598,36	Distribution R Hedged (iii) (EUR)	31.03.2022	EUR	740,01
	30.09.2021	EUR	629,89		30.09.2021	EUR	809,48
	30.09.2020	EUR	571,90		30.09.2020	EUR	766,43
Capitalisation I Hedged (iii) (PLN)	31.03.2022	PLN	43.639,94	Distribution X (M) (USD)	31.03.2022	USD	61,51
	30.09.2021	PLN	45.542,81		30.09.2021	USD	69,18
	30.09.2020	PLN	41.196,38		30.09.2020	USD	69,41
Capitalisation N Hedged (iii) (EUR)	31.03.2022	EUR	575,65	Distribution X (M) Hedged (iii) (AUD)	31.03.2022	AUD	156,30
	30.09.2021	EUR	605,85		30.09.2021	AUD	173,06
	30.09.2020	EUR	549,74		30.09.2020	AUD	173,00
Capitalisation P Hedged (iii) (EUR)	31.03.2022	EUR	553,18	Distribution X (M) Hedged (iii) (EUR)	31.03.2022	EUR	622,08
	30.09.2021	EUR	583,21		30.09.2021	EUR	690,57
	30.09.2020	EUR	531,91		30.09.2020	EUR	693,59
Capitalisation R Hedged (iii) (EUR)	31.03.2022	EUR	265,87	Distribution X (M) Hedged (iii) (USD)	31.03.2022	USD	164,34
	30.09.2021	EUR	280,02		30.09.2021	USD	182,38
	30.09.2020	EUR	254,28		30.09.2020	USD	182,22
Capitalisation X (HUF)	31.03.2022	HUF	111.714,29	Distribution X (M) Hedged (iii) (ZAR)	31.03.2022	ZAR	3.028,40
	30.09.2021	HUF	111.774,88		30.09.2021	ZAR	3.431,63
	30.09.2020	HUF	101.806,09		30.09.2020	ZAR	3.583,89
Capitalisation X (USD)	31.03.2022	USD	405,83	Distribution Y (M) (USD)	31.03.2022	USD	133,98
	30.09.2021	USD	432,38		30.09.2021	USD	151,44
	30.09.2020	USD	394,11		30.09.2020	USD	153,64
Capitalisation X Hedged (iii) (EUR)	31.03.2022	EUR	510,65	Distribution Y (M) Hedged (iii) (AUD)	31.03.2022	AUD	138,09
	30.09.2021	EUR	539,64		30.09.2021	AUD	153,68
	30.09.2020	EUR	494,60		30.09.2020	AUD	155,62
Capitalisation Zz (EUR)	31.03.2022	EUR	4.849,48	Distribution Y (M) Hedged (iii) (USD)	31.03.2022	USD	151,15
	30.09.2021	EUR	-		30.09.2021	USD	168,58
	30.09.2020	EUR	-		30.09.2020	USD	170,29
Capitalisation Zz Hedged (iii) (EUR)	31.03.2022	EUR	4.819,66	Distribution Y (M) Hedged (iii) (ZAR)	31.03.2022	ZAR	2.975,74
	30.09.2021	EUR	-		30.09.2021	ZAR	3.391,62
	30.09.2020	EUR	-		30.09.2020	ZAR	3.576,17
Distribution I Hedged (iii) (PLN)	31.03.2022	PLN	19.620,65	Distribution Z Hedged (iii) (EUR)	31.03.2022	EUR	4.429,25
	30.09.2021	PLN	21.247,54		30.09.2021	EUR	4.824,79
	30.09.2020	PLN	19.888,56		30.09.2020	EUR	4.567,49
Distribution I (M) Hedged (iii) (PLN)	31.03.2022	PLN	19.801,11				
	30.09.2021	PLN	20.944,56				
	30.09.2020	PLN	-				

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

## NN (L) Global High Yield

(ausgedrückt in EUR)

### Statistische Angaben (Fortsetzung)

			<b>Anzahl der Anteile</b>			
Distribution Zz Hedged (iii) (EUR)	31.03.2022	EUR	4.478,41	Distribution I (Q) Hedged (iii) (EUR)	31.03.2022	19.434
	30.09.2021	EUR	4.874,27		30.09.2021	19.434
	30.09.2020	EUR	4.613,18		30.09.2020	57.603
<b>Anzahl der Anteile</b>				Distribution N (Q) Hedged (iii) (EUR)	31.03.2022	1.461
Capitalisation I (USD)	31.03.2022		448		30.09.2021	1.461
	30.09.2021		298		30.09.2020	1.484
	30.09.2020		134	Distribution P Hedged (iii) (EUR)	31.03.2022	15.740
Capitalisation I Hedged (iii) (EUR)	31.03.2022		17.564		30.09.2021	24.329
	30.09.2021		21.003		30.09.2020	35.387
	30.09.2020		17.945	Distribution R Hedged (iii) (EUR)	31.03.2022	1.851
Capitalisation I Hedged (iii) (PLN)	31.03.2022		9.617		30.09.2021	2.031
	30.09.2021		11.868		30.09.2020	2.518
	30.09.2020		7.441	Distribution X (M) (USD)	31.03.2022	8.939.101
Capitalisation N Hedged (iii) (EUR)	31.03.2022		17.093		30.09.2021	9.179.004
	30.09.2021		16.887		30.09.2020	8.554.021
	30.09.2020		17.008	Distribution X (M) Hedged (iii) (AUD)	31.03.2022	1.884.606
Capitalisation P Hedged (iii) (EUR)	31.03.2022		16.137		30.09.2021	2.053.422
	30.09.2021		17.300		30.09.2020	2.324.744
	30.09.2020		20.107	Distribution X (M) Hedged (iii) (EUR)	31.03.2022	44.669
Capitalisation R Hedged (iii) (EUR)	31.03.2022		853		30.09.2021	48.302
	30.09.2021		959		30.09.2020	40.916
	30.09.2020		979	Distribution X (M) Hedged (iii) (USD)	31.03.2022	267.145
Capitalisation X (HUF)	31.03.2022		6.438		30.09.2021	258.067
	30.09.2021		8.310		30.09.2020	114.025
	30.09.2020		4.652	Distribution X (M) Hedged (iii) (ZAR)	31.03.2022	385.152
Capitalisation X (USD)	31.03.2022		17.239		30.09.2021	258.265
	30.09.2021		28.173		30.09.2020	17.020
	30.09.2020		21.952	Distribution Y (M) (USD)	31.03.2022	1.167.475
Capitalisation X Hedged (iii) (EUR)	31.03.2022		16.366		30.09.2021	1.438.641
	30.09.2021		41.022		30.09.2020	79.148
	30.09.2020		37.407	Distribution Y (M) Hedged (iii) (AUD)	31.03.2022	171.690
Capitalisation Zz (EUR)	31.03.2022		134.217		30.09.2021	200.941
	30.09.2021		-		30.09.2020	25.512
	30.09.2020		-	Distribution Y (M) Hedged (iii) (USD)	31.03.2022	575.227
Capitalisation Zz Hedged (iii) (EUR)	31.03.2022		62.900		30.09.2021	604.868
	30.09.2021		-		30.09.2020	62.437
	30.09.2020		-	Distribution Y (M) Hedged (iii) (ZAR)	31.03.2022	347.652
Distribution I Hedged (iii) (PLN)	31.03.2022		75		30.09.2021	272.548
	30.09.2021		75		30.09.2020	11.339
	30.09.2020		6.317	Distribution Z Hedged (iii) (EUR)	31.03.2022	25.143
Distribution I (M) Hedged (iii) (PLN)	31.03.2022		8.014		30.09.2021	22.377
	30.09.2021		14.169		30.09.2020	14.361
	30.09.2020		-			

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

## NN (L) Global High Yield

(ausgedrückt in EUR)

### Statistische Angaben (Fortsetzung)

#### Anzahl der Anteile

Distribution Zz Hedged (iii) (EUR)	31.03.2022	29.708
	30.09.2021	92.156
	30.09.2020	86.938

#### Dividende

Distribution I Hedged (iii) (PLN)	14.12.2021	PLN	799,10
Distribution I (M) Hedged (iii) (PLN)	02.03.2022	PLN	49,09
Distribution I (M) Hedged (iii) (PLN)	02.02.2022	PLN	49,09
Distribution I (M) Hedged (iii) (PLN)	04.01.2022	PLN	49,09
Distribution I (M) Hedged (iii) (PLN)	02.12.2021	PLN	54,35
Distribution I (M) Hedged (iii) (PLN)	02.11.2021	PLN	54,35
Distribution I (M) Hedged (iii) (PLN)	04.10.2021	PLN	54,35
Distribution I (Q) Hedged (iii) (EUR)	11.02.2022	EUR	36,86
Distribution I (Q) Hedged (iii) (EUR)	11.11.2021	EUR	42,45
Distribution N (Q) Hedged (iii) (EUR)	11.02.2022	EUR	1,86
Distribution N (Q) Hedged (iii) (EUR)	11.11.2021	EUR	2,15
Distribution P Hedged (iii) (EUR)	14.12.2021	EUR	27,05
Distribution R Hedged (iii) (EUR)	14.12.2021	EUR	30,30
Distribution X (M) (USD)	02.03.2022	USD	0,58
Distribution X (M) (USD)	02.02.2022	USD	0,58
Distribution X (M) (USD)	04.01.2022	USD	0,58
Distribution X (M) (USD)	02.12.2021	USD	0,61
Distribution X (M) (USD)	02.11.2021	USD	0,61
Distribution X (M) (USD)	04.10.2021	USD	0,61
Distribution X (M) Hedged (iii) (AUD)	02.03.2022	AUD	1,34
Distribution X (M) Hedged (iii) (AUD)	02.02.2022	AUD	1,34
Distribution X (M) Hedged (iii) (AUD)	04.01.2022	AUD	1,34
Distribution X (M) Hedged (iii) (AUD)	02.12.2021	AUD	1,34
Distribution X (M) Hedged (iii) (AUD)	02.11.2021	AUD	1,34

Distribution X (M) Hedged (iii) (AUD)	04.10.2021	AUD	1,34
Distribution X (M) Hedged (iii) (EUR)	02.03.2022	EUR	5,38
Distribution X (M) Hedged (iii) (EUR)	02.02.2022	EUR	5,38
Distribution X (M) Hedged (iii) (EUR)	04.01.2022	EUR	5,38
Distribution X (M) Hedged (iii) (EUR)	02.12.2021	EUR	5,38
Distribution X (M) Hedged (iii) (EUR)	02.11.2021	EUR	5,38
Distribution X (M) Hedged (iii) (EUR)	04.10.2021	EUR	5,38
Distribution X (M) Hedged (iii) (USD)	02.03.2022	USD	1,54
Distribution X (M) Hedged (iii) (USD)	02.02.2022	USD	1,54
Distribution X (M) Hedged (iii) (USD)	04.01.2022	USD	1,54
Distribution X (M) Hedged (iii) (USD)	02.12.2021	USD	1,58
Distribution X (M) Hedged (iii) (USD)	02.11.2021	USD	1,58
Distribution X (M) Hedged (iii) (USD)	04.10.2021	USD	1,58
Distribution X (M) Hedged (iii) (ZAR)	02.03.2022	ZAR	53,50
Distribution X (M) Hedged (iii) (ZAR)	02.02.2022	ZAR	53,50
Distribution X (M) Hedged (iii) (ZAR)	04.01.2022	ZAR	53,50
Distribution X (M) Hedged (iii) (ZAR)	02.12.2021	ZAR	53,50
Distribution X (M) Hedged (iii) (ZAR)	02.11.2021	ZAR	53,50
Distribution X (M) Hedged (iii) (ZAR)	04.10.2021	ZAR	53,50
Distribution Y (M) (USD)	02.03.2022	USD	1,27
Distribution Y (M) (USD)	02.02.2022	USD	1,27
Distribution Y (M) (USD)	04.01.2022	USD	1,27
Distribution Y (M) (USD)	02.12.2021	USD	1,33
Distribution Y (M) (USD)	02.11.2021	USD	1,33
Distribution Y (M) (USD)	04.10.2021	USD	1,33
Distribution Y (M) Hedged (iii) (AUD)	02.03.2022	AUD	1,20
Distribution Y (M) Hedged (iii) (AUD)	02.02.2022	AUD	1,20
Distribution Y (M) Hedged (iii) (AUD)	04.01.2022	AUD	1,20

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

## NN (L) Global High Yield

(ausgedrückt in EUR)

### Statistische Angaben (Fortsetzung)

### Laufende Kosten in %\*

Distribution Y (M) Hedged (iii) (AUD)	02.12.2021	AUD	1,20	Capitalisation I (USD)	31.03.2022	0,89%
Distribution Y (M) Hedged (iii) (AUD)	02.11.2021	AUD	1,20	Capitalisation I Hedged (iii) (EUR)	31.03.2022	0,91%
Distribution Y (M) Hedged (iii) (AUD)	04.10.2021	AUD	1,20	Capitalisation I Hedged (iii) (PLN)	31.03.2022	0,91%
Distribution Y (M) Hedged (iii) (USD)	02.03.2022	USD	1,42	Capitalisation N Hedged (iii) (EUR)	31.03.2022	0,83%
Distribution Y (M) Hedged (iii) (USD)	02.02.2022	USD	1,42	Capitalisation P Hedged (iii) (EUR)	31.03.2022	1,32%
Distribution Y (M) Hedged (iii) (USD)	04.01.2022	USD	1,42	Capitalisation R Hedged (iii) (EUR)	31.03.2022	0,92%
Distribution Y (M) Hedged (iii) (USD)	02.12.2021	USD	1,46	Capitalisation X (HUF)	31.03.2022	1,80%
Distribution Y (M) Hedged (iii) (USD)	02.11.2021	USD	1,46	Capitalisation X (USD)	31.03.2022	1,80%
Distribution Y (M) Hedged (iii) (USD)	04.10.2021	USD	1,46	Capitalisation X Hedged (iii) (EUR)	31.03.2022	1,82%
Distribution Y (M) Hedged (iii) (ZAR)	02.03.2022	ZAR	53,10	Capitalisation Zz (EUR)	31.03.2022	0,03%
Distribution Y (M) Hedged (iii) (ZAR)	02.02.2022	ZAR	53,10	Capitalisation Zz Hedged (iii) (EUR)	31.03.2022	0,02%
Distribution Y (M) Hedged (iii) (ZAR)	04.01.2022	ZAR	53,10	Distribution I Hedged (iii) (PLN)	31.03.2022	0,91%
Distribution Y (M) Hedged (iii) (ZAR)	02.12.2021	ZAR	53,10	Distribution I (M) Hedged (iii) (PLN)	31.03.2022	0,91%
Distribution Y (M) Hedged (iii) (ZAR)	02.11.2021	ZAR	53,10	Distribution I (Q) Hedged (iii) (EUR)	31.03.2022	0,91%
Distribution Y (M) Hedged (iii) (ZAR)	04.10.2021	ZAR	53,10	Distribution N (Q) Hedged (iii) (EUR)	31.03.2022	0,82%
Distribution Z Hedged (iii) (EUR)	14.12.2021	EUR	181,30	Distribution P Hedged (iii) (EUR)	31.03.2022	1,32%
Distribution Zz Hedged (iii) (EUR)	14.12.2021	EUR	183,15	Distribution R Hedged (iii) (EUR)	31.03.2022	0,92%
				Distribution X (M) (USD)	31.03.2022	1,80%
				Distribution X (M) Hedged (iii) (AUD)	31.03.2022	1,82%
				Distribution X (M) Hedged (iii) (EUR)	31.03.2022	1,82%
				Distribution X (M) Hedged (iii) (USD)	31.03.2022	1,83%
				Distribution X (M) Hedged (iii) (ZAR)	31.03.2022	1,83%
				Distribution Y (M) (USD)	31.03.2022	2,80%
				Distribution Y (M) Hedged (iii) (AUD)	31.03.2022	2,83%
				Distribution Y (M) Hedged (iii) (USD)	31.03.2022	2,83%
				Distribution Y (M) Hedged (iii) (ZAR)	31.03.2022	2,83%
				Distribution Z Hedged (iii) (EUR)	31.03.2022	0,10%
				Distribution Zz Hedged (iii) (EUR)	31.03.2022	0,02%

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

## NN (L) Global High Yield

(ausgedrückt in EUR)

### Statistische Angaben (Fortsetzung)

Portfolioumsatz in %*	31.03.2022	(76,60%)
-----------------------	------------	----------

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.



## NN (L) Global High Yield

(ausgedrückt in EUR)

### Finanzabschlüsse

#### Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022

	Erläuterungen	
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	2	<b>2.487.766.529,14</b>
Aktien		2.124.636,51
Organismen für gemeinsame Anlagen		213.469.162,62
Anleihen und andere Schuldtitel		2.272.172.730,01
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	2	<b>8.267.019,40</b>
Zinsswaps		159.586,35
Devisentermingeschäfte		8.107.433,05
<b>Bankguthaben</b>		<b>56.967.704,88</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte</b>	4, 12	<b>81.401.481,68</b>
<b>Vermögenswerte Gesamt</b>		<b>2.634.402.735,10</b>
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>	4, 12	<b>(36.716.737,88)</b>
<b>Verbindlichkeiten Gesamt</b>		<b>(36.716.737,88)</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Berichtszeitraums</b>		<b>2.597.685.997,22</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Global High Yield

(ausgedrückt in EUR)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW	Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
<b>Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>									
<b>Aktien</b>									
<b>Kroatien</b>									
664.157	FORTENOVA EQUITY	EUR	1.295.106,15	0,05					
			<b>1.295.106,15</b>	<b>0,05</b>					
<b>Irland</b>									
5.192	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	EUR	210.016,40	0,01					
			<b>210.016,40</b>	<b>0,01</b>					
<b>Vereinigte Staaten</b>									
2	AMPLIFY ENERGY CORP	USD	9,89	0,00					
			<b>9,89</b>	<b>0,00</b>					
			<b>1.505.132,44</b>	<b>0,06</b>					
<b>Anleihen und andere Schuldtitel</b>									
<b>Vereinigte Staaten</b>									
4.000.000	ACRISURE LLC / ACRISURE FINANCE INC 6.000% 01/08/2029	USD	3.327.548,75	0,13	9.705.000	BLUE RACER MIDSTREAM LLC / BLUE RACER FINANCE CORP 6.625% 15/07/2026	USD	8.862.869,68	0,34
8.305.000	ACRISURE LLC / ACRISURE FINANCE INC 7.000% 15/11/2025	USD	7.447.668,73	0,29	3.210.000	BLUE RACER MIDSTREAM LLC / BLUE RACER FINANCE CORP 7.625% 15/12/2025	USD	3.022.188,91	0,12
3.569.000	AHERN RENTALS INC 7.375% 15/05/2023	USD	2.982.353,81	0,11	10.530.000	BROADSTREET PARTNERS INC 5.875% 15/04/2029	USD	8.827.291,48	0,34
8.500.000	ALBERTSONS COS INC / SAFEWAY INC / NEW ALBERTSONS LP / ALBERTSONS LLC 4.875% 15/02/2030	USD	7.412.191,29	0,29	11.391.000	BUILDERS FIRSTSOURCE INC 4.250% 01/02/2032	USD	9.533.615,58	0,37
1.320.000	ALBERTSONS COS INC / SAFEWAY INC / NEW ALBERTSONS LP / ALBERTSONS LLC 5.875% 15/02/2028	USD	1.184.500,18	0,05	7.000.000	CALLON PETROLEUM CO 6.375% 01/07/2026	USD	6.251.834,22	0,24
6.415.000	ALBERTSONS COS INC / SAFEWAY INC / NEW ALBERTSONS LP / ALBERTSONS LLC 6.000% 15/01/2027	USD	5.580.176,64	0,21	7.159.000	CALLON PETROLEUM CO 8.000% 01/08/2028	USD	6.812.045,32	0,26
600.000	ALLIED UNIVERSAL HOLDCO LLC / ALLIED UNIVERSAL FINANCE CORP 6.000% 01/06/2029	USD	476.173,81	0,02	9.907.000	CARGO AIRCRAFT MANAGEMENT INC 4.750% 01/02/2028	USD	8.680.583,12	0,33
14.351.000	ALLIED UNIVERSAL HOLDCO LLC / ALLIED UNIVERSAL FINANCE CORP 6.625% 15/07/2026	USD	13.060.105,33	0,50	11.687.000	CARRIAGE SERVICES INC 4.250% 15/05/2029	USD	9.807.783,55	0,38
24.908.000	AMERICAN AIRLINES INC 11.750% 15/07/2025	USD	26.148.161,41	1,00	5.424.000	CCO HOLDINGS LLC / CCO HOLDINGS CAPITAL CORP 4.250% 15/01/2034	USD	4.227.167,40	0,16
12.225.000	AMERICAN AXLE & MANUFACTURING INC 5.000% 01/10/2029	USD	10.300.914,87	0,40	5.675.000	CCO HOLDINGS LLC / CCO HOLDINGS CAPITAL CORP 4.500% 01/05/2032	USD	4.667.500,03	0,18
4.767.000	ANTERO MIDSTREAM PARTNERS LP / ANTERO MIDSTREAM FINANCE CORP 5.750% 01/03/2027	USD	4.368.018,19	0,17	3.795.000	CCO HOLDINGS LLC / CCO HOLDINGS CAPITAL CORP 4.500% 15/08/2030	USD	3.202.627,47	0,12
7.880.000	ANTERO MIDSTREAM PARTNERS LP / ANTERO MIDSTREAM FINANCE CORP 5.750% 15/01/2028	USD	7.241.711,08	0,28	4.065.000	CCO HOLDINGS LLC / CCO HOLDINGS CAPITAL CORP 4.750% 01/03/2030	USD	3.511.681,51	0,14
3.235.000	ANTERO MIDSTREAM PARTNERS LP / ANTERO MIDSTREAM FINANCE CORP 7.875% 15/05/2026	USD	3.147.517,71	0,12	8.012.000	CENTENE CORP 2.450% 15/07/2028	USD	6.578.693,13	0,25
7.000.000	ANTERO RESOURCES CORP 5.375% 01/03/2030	USD	6.425.187,54	0,25	26.642.000	CENTENE CORP 2.500% 01/03/2031	USD	21.202.770,57	0,81
2.057.000	ANTERO RESOURCES CORP 7.625% 01/02/2029	USD	2.001.485,64	0,08	9.315.000	CENTENE CORP 3.375% 15/02/2030	USD	7.885.647,09	0,30
1.392.000	ANTERO RESOURCES CORP 8.375% 15/07/2026	USD	1.383.082,04	0,05	11.975.000	CENTENNIAL RESOURCE PRODUCTION LLC 6.875% 01/04/2027	USD	10.810.061,47	0,42
10.550.000	ARCHES BUYER INC 4.250% 01/06/2028	USD	8.827.352,50	0,34	6.625.000	CHEMOURS CO/THE 4.000% 15/05/2026	EUR	6.376.442,99	0,25
745.000	ARCHES BUYER INC 6.125% 01/12/2028	USD	617.653,15	0,02	6.290.000	CHEMOURS CO/THE 4.625% 15/11/2029	USD	5.185.835,48	0,20
2.800.000	ARCHROCK PARTNERS LP / ARCHROCK PARTNERS FINANCE CORP 6.250% 01/04/2028	USD	2.482.476,03	0,10	421.000	CHEMIERE ENERGY PARTNERS LP 3.250% 31/01/2032	USD	344.609,78	0,01
5.118.000	ARCHROCK PARTNERS LP / ARCHROCK PARTNERS FINANCE CORP 6.875% 01/04/2027	USD	4.651.041,11	0,18	15.295.000	CHEMIERE ENERGY PARTNERS LP 4.500% 01/10/2029	USD	13.813.540,86	0,53
10.430.000	ARROW BIDCO LLC 9.500% 15/03/2024	USD	9.554.237,43	0,37	13.047.000	CHS/COMMUNITY HEALTH SYSTEMS INC 5.625% 15/03/2027	USD	11.948.113,10	0,46
3.383.000	ASBURY AUTOMOTIVE GROUP INC 4.625% 15/11/2029	USD	2.831.839,75	0,11	3.768.000	CHS/COMMUNITY HEALTH SYSTEMS INC 6.000% 15/01/2029	USD	3.425.501,76	0,13
6.883.000	ASBURY AUTOMOTIVE GROUP INC 5.000% 15/02/2032	USD	5.754.863,40	0,22	3.200.000	CHS/COMMUNITY HEALTH SYSTEMS INC 6.125% 01/04/2030	USD	2.683.402,57	0,10
14.012.000	AUDACY CAPITAL CORP 6.750% 31/03/2029	USD	11.760.155,17	0,45	9.965.000	CLARIVATE SCIENCE HOLDINGS CORP 3.875% 01/07/2028	USD	8.525.375,22	0,33
5.000.000	AXALTA COATING SYSTEMS LLC 3.375% 15/02/2029	USD	3.951.039,01	0,15	1.395.000	CLARIVATE SCIENCE HOLDINGS CORP 4.875% 01/07/2029	USD	1.182.659,59	0,05
9.800.000	BAUSCH HEALTH AMERICAS INC 8.500% 31/01/2027	USD	8.782.049,92	0,34	5.913.000	CLEARWAY ENERGY OPERATING LLC 3.750% 15/01/2032	USD	4.905.738,35	0,19
8.393.000	BCPE ULYSSES INTERMEDIATE INC 7.750% 01/04/2027	USD	6.851.069,64	0,26	7.685.000	CLEARWAY ENERGY OPERATING LLC 4.750% 15/03/2028	USD	6.941.384,44	0,27
					5.000.000	CLEVELAND-CLIFFS INC 4.625% 01/03/2029	USD	4.436.925,67	0,17
					9.636.000	CLEVELAND-CLIFFS INC 4.875% 01/03/2031	USD	8.562.277,06	0,33
					6.017.000	CLYDESDALE ACQUISITION HOLDINGS INC 8.750% 15/04/2030	USD	5.090.101,33	0,20
					11.500.000	COBRA ACQUISITIONCO LLC 6.375% 01/11/2029	USD	8.846.586,86	0,34
					5.739.000	COLGATE ENERGY PARTNERS III LLC 5.875% 01/07/2029	USD	5.320.939,08	0,20
					6.379.000	COLGATE ENERGY PARTNERS III LLC 7.750% 15/02/2026	USD	6.105.504,61	0,24
					1.583.000	COMMERCIAL METALS CO 4.375% 15/03/2032	USD	1.325.559,64	0,05
					8.975.000	COMSTOCK RESOURCES INC 5.875% 15/01/2030	USD	7.945.494,62	0,31
					3.786.000	COMSTOCK RESOURCES INC 6.750% 01/03/2029	USD	3.502.830,00	0,13
					7.594.000	CONDOR MERGER SUB INC 7.375% 15/02/2030	USD	6.545.285,97	0,25
					5.992.000	CONSENSUS CLOUD SOLUTIONS INC 6.000% 15/10/2026	USD	5.361.199,62	0,21
					1.992.000	CONSENSUS CLOUD SOLUTIONS INC 6.500% 15/10/2028	USD	1.781.260,17	0,07
					8.066.000	CONSOLIDATED COMMUNICATIONS INC 5.000% 01/10/2028	USD	6.236.204,57	0,24
					4.620.000	CONSOLIDATED COMMUNICATIONS INC 6.500% 01/10/2028	USD	3.830.617,53	0,15
					5.012.000	COOPER-STANDARD AUTOMOTIVE INC 13.000% 01/06/2024	USD	4.592.552,61	0,18
					7.324.000	COTY INC 3.875% 15/04/2026	EUR	7.127.988,37	0,27
					1.500.000	COTY INC 4.750% 15/04/2026	EUR	1.438.792,01	0,06
					2.645.000	CSC HOLDINGS LLC 4.125% 01/12/2030	USD	2.093.278,03	0,08
					7.395.000	CSC HOLDINGS LLC 4.625% 01/12/2030	USD	5.552.868,71	0,21
					3.000.000	DARLING INGREDIENTS INC 5.250% 15/04/2027	USD	2.749.123,32	0,11
					4.400.000	DIAMOND SPORTS GROUP LLC / DIAMOND SPORTS FINANCE CO 5.375% 15/08/2026	USD	1.515.327,30	0,06
					2.500.000	DIAMOND SPORTS GROUP LLC / DIAMOND SPORTS FINANCE CO 6.625% 15/08/2027	USD	464.590,98	0,02

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Global High Yield

(ausgedrückt in EUR)

## Wertpapierbestand zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW	Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
12.090.000	DIEBOLD NIXDORF INC 8.500% 15/04/2024	USD	10.483.187,11	0,40	6.618.000	LPL HOLDINGS INC 4.000% 15/03/2029	USD	5.643.725,18	0,22
4.500.000	DISH DBS CORP 5.125% 01/06/2029	USD	3.443.187,35	0,13	12.025.000	MATADOR RESOURCES CO 5.875% 15/09/2026	USD	11.011.705,07	0,42
4.500.000	DISH DBS CORP 7.375% 01/07/2028	USD	3.837.565,06	0,15	8.003.000	MATTEL INC 3.750% 01/04/2029	USD	6.916.751,04	0,27
13.111.000	ENDEAVOR ENERGY RESOURCES LP / EER FINANCE INC 5.750% 30/01/2028	USD	12.158.201,78	0,47	4.000.000	MATTEL INC 6.200% 01/10/2040	USD	4.137.210,52	0,16
2.727.000	ENERGIZER HOLDINGS INC 6.500% 31/12/2027	USD	2.432.156,54	0,09	7.829.000	MCGRAW-HILL EDUCATION INC 5.750% 01/08/2028	USD	6.689.138,97	0,26
10.240.000	ENLINK MIDSTREAM PARTNERS LP 4.150% 01/06/2025	USD	9.173.273,16	0,35	4.963.000	MCGRAW-HILL EDUCATION INC 8.000% 01/08/2029	USD	4.236.956,65	0,16
4.500.000	ENLINK MIDSTREAM PARTNERS LP 5.450% 01/06/2047	USD	3.437.621,20	0,13	3.115.000	MEDNAX INC 5.375% 15/02/2030	USD	2.707.734,88	0,10
588.000	EQM MIDSTREAM PARTNERS LP 4.500% 15/01/2029	USD	496.598,21	0,02	17.600.000	MICHAELS COS INC/THE 7.875% 01/05/2029	USD	13.485.024,78	0,52
8.588.000	EQM MIDSTREAM PARTNERS LP 4.750% 15/01/2031	USD	7.237.105,86	0,28	7.409.000	MIDCAP FINANCIAL ISSUER TRUST 5.625% 15/01/2030	USD	5.892.359,56	0,23
8.616.000	EQM MIDSTREAM PARTNERS LP 5.500% 15/07/2028	USD	7.781.449,12	0,30	3.601.000	MIDCAP FINANCIAL ISSUER TRUST 6.500% 01/05/2028	USD	3.050.584,44	0,12
7.329.000	FERTITTA ENTERTAINMENT LLC / FERTITTA ENTERTAINMENT FINANCE CO INC 4.625% 15/01/2029	USD	6.237.867,85	0,24	10.630.000	MILLENNIUM ESCROW CORP 6.625% 01/08/2026	USD	9.049.292,39	0,35
6.800.000	FERTITTA ENTERTAINMENT LLC / FERTITTA ENTERTAINMENT FINANCE CO INC 6.750% 15/01/2030	USD	5.623.646,32	0,22	8.207.000	MOHEGAN GAMING & ENTERTAINMENT 8.000% 01/02/2026	USD	7.251.611,82	0,28
4.828.000	FIRSTCASH INC 5.625% 01/01/2030	USD	4.172.903,12	0,16	2.792.000	MOZART DEBT MERGER SUB INC 3.875% 01/04/2029	USD	2.321.008,36	0,09
8.515.000	FORD MOTOR CO 4.750% 15/01/2043	USD	6.924.525,65	0,27	744.000	MOZART DEBT MERGER SUB INC 5.250% 01/10/2029	USD	622.128,00	0,02
4.370.000	FORD MOTOR CO 7.450% 16/07/2031	USD	4.645.668,31	0,18	6.450.000	NATIONSTAR MORTGAGE HOLDINGS INC 5.500% 15/08/2028	USD	5.582.811,20	0,21
740.000	FORD MOTOR CO 9.625% 22/04/2030	USD	867.170,74	0,03	6.200.000	NATIONSTAR MORTGAGE HOLDINGS INC 5.750% 15/11/2031	USD	5.314.809,23	0,20
975.000	FORD MOTOR CREDIT CO LLC 1.355% 07/02/2025 EMTN	EUR	938.524,44	0,04	4.134.000	NESCO HOLDINGS II INC 5.500% 15/04/2029	USD	3.662.295,12	0,14
6.000.000	FORD MOTOR CREDIT CO LLC 2.386% 17/02/2026	EUR	5.882.978,94	0,23	17.000.000	NETFLIX INC 3.625% 15/06/2030	EUR	17.979.930,83	0,69
9.658.000	FORD MOTOR CREDIT CO LLC 2.900% 10/02/2029	USD	7.733.415,58	0,30	6.222.000	NETFLIX INC 3.875% 15/11/2029	EUR	6.750.519,14	0,26
8.450.000	FORD MOTOR CREDIT CO LLC 2.900% 16/02/2028	USD	6.845.725,37	0,26	1.850.000	NETFLIX INC 4.875% 15/04/2028	USD	1.735.996,05	0,07
5.000.000	FORD MOTOR CREDIT CO LLC 3.625% 17/06/2031	USD	4.060.708,89	0,16	9.501.000	NEXSTAR MEDIA INC 5.625% 15/07/2027	USD	8.646.410,90	0,33
2.192.000	FORD MOTOR CREDIT CO LLC 4.000% 13/11/2030	USD	1.853.897,25	0,07	12.381.000	NFP CORP 6.875% 15/08/2028	USD	10.625.299,20	0,41
2.190.000	FORD MOTOR CREDIT CO LLC 4.125% 17/08/2027	USD	1.924.655,42	0,07	6.300.000	NMI HOLDINGS INC 7.375% 01/06/2025	USD	5.955.012,87	0,23
3.935.000	FORD MOTOR CREDIT CO LLC 4.542% 01/08/2026	USD	3.535.606,82	0,14	16.673.000	NOKIA OF AMERICA CORP 6.450% 15/03/2029	USD	15.713.498,63	0,60
4.150.000	FXI HOLDINGS INC 12.250% 15/11/2026	USD	4.036.503,64	0,16	13.266.000	NORTHERN OIL AND GAS INC 8.125% 01/03/2028	USD	12.435.043,71	0,48
5.178.000	FXI HOLDINGS INC 7.875% 01/11/2024	USD	4.633.017,14	0,18	6.492.000	NUSTAR LOGISTICS LP 6.000% 01/06/2026	USD	5.904.280,84	0,23
6.870.000	GATES GLOBAL LLC / GATES CORP 6.250% 15/01/2026	USD	6.185.750,41	0,24	6.575.000	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 3.200% 15/08/2026	USD	5.800.304,68	0,22
3.790.000	HAT HOLDINGS I LLC / HAT HOLDINGS II LLC 3.375% 15/06/2026	USD	3.234.945,14	0,12	3.000.000	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 3.400% 15/04/2026	USD	2.679.944,42	0,10
3.950.000	HAT HOLDINGS I LLC / HAT HOLDINGS II LLC 3.750% 15/09/2030	USD	3.230.198,67	0,12	9.000.000	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 3.500% 15/08/2029	USD	7.968.588,11	0,31
1.360.000	HAT HOLDINGS I LLC / HAT HOLDINGS II LLC 6.000% 15/04/2025	USD	1.259.278,63	0,05	6.900.000	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 4.400% 15/04/2046	USD	5.890.678,25	0,23
24.930.000	HCA INC 3.500% 01/09/2030	USD	21.629.557,04	0,82	5.000.000	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 4.400% 15/08/2049	USD	4.241.960,10	0,16
7.385.000	HOWARD MIDSTREAM ENERGY PARTNERS LLC 6.750% 15/01/2027	USD	6.513.649,31	0,25	5.000.000	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 5.875% 01/09/2025	USD	4.775.430,28	0,18
2.069.000	HUB INTERNATIONAL LTD 5.625% 01/12/2029	USD	1.812.494,19	0,07	2.460.000	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 6.125% 01/01/2031	USD	2.487.305,08	0,10
8.320.000	HUB INTERNATIONAL LTD 7.000% 01/05/2026	USD	7.569.422,19	0,29	2.975.000	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 8.500% 15/07/2027	USD	3.164.794,04	0,12
7.836.000	HUGHES SATELLITE SYSTEMS CORP 5.250% 01/08/2026	USD	7.191.573,18	0,28	2.975.000	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 8.875% 15/07/2030	USD	3.438.105,48	0,13
3.260.000	IHEARTCOMMUNICATIONS INC 5.250% 15/08/2027	USD	2.899.442,68	0,11	9.010.000	OLYMPUS WATER US HOLDING CORP 3.875% 01/10/2028	EUR	8.211.444,15	0,32
3.300.000	IHEARTCOMMUNICATIONS INC 6.375% 01/05/2026	USD	3.053.383,87	0,12	6.356.000	OLYMPUS WATER US HOLDING CORP 4.250% 01/10/2028	USD	5.195.157,61	0,20
7.560.000	IHEARTCOMMUNICATIONS INC 8.375% 01/05/2027	USD	7.023.975,65	0,27	9.944.000	OT MERGER CORP 7.875% 15/10/2029	USD	7.860.960,12	0,30
12.305.000	IMOLA MERGER CORP 4.750% 15/05/2029	USD	10.649.487,31	0,41	3.434.000	PACTIV EVERGREEN GROUP ISSUER INC/PACTIV EVERGREEN GROUP ISSUER LLC 4.000% 15/10/2027	USD	2.868.178,58	0,11
5.647.000	INGLES MARKETS INC 4.000% 15/06/2031	USD	4.804.447,35	0,18	10.236.000	PARK RIVER HOLDINGS INC 5.625% 01/02/2029	USD	7.461.147,49	0,29
5.985.000	INNOPHOS HOLDINGS INC 9.375% 15/02/2028	USD	5.753.701,77	0,22	11.117.000	PITNEY BOWES INC 6.875% 15/03/2027	USD	9.460.905,61	0,36
8.672.000	IQVIA INC 2.250% 15/01/2028	EUR	8.233.331,22	0,32	2.697.000	PITNEY BOWES INC 7.250% 15/03/2029	USD	2.288.684,29	0,09
7.000.000	IQVIA INC 2.875% 15/06/2028	EUR	6.737.943,94	0,26	7.835.000	PRA GROUP INC 5.000% 01/10/2029	USD	6.680.743,49	0,26
11.583.000	JEFFERIES FINANCE LLC / JFIN CO-ISSUER CORP 5.000% 15/08/2028	USD	9.987.164,50	0,38	3.205.000	PRA GROUP INC 7.375% 01/09/2025	USD	3.003.149,79	0,12
9.367.000	KB HOME 4.000% 15/06/2031	USD	7.630.721,04	0,29	1.200.000	PRIME SECURITY SERVICES BORROWER LLC / PRIME FINANCE INC 3.375% 31/08/2027	USD	988.963,35	0,04
9.990.000	LADDER CAPITAL FINANCE HOLDINGS LLLP / LADDER CAPITAL FINANCE CORP 4.250% 01/02/2027	USD	8.614.643,44	0,33	6.375.000	PRIME SECURITY SERVICES BORROWER LLC / PRIME FINANCE INC 5.250% 15/04/2024	USD	5.870.227,71	0,23
2.213.000	LADDER CAPITAL FINANCE HOLDINGS LLLP / LADDER CAPITAL FINANCE CORP 4.750% 15/06/2029	USD	1.876.594,36	0,07	323.000	PRIME SECURITY SERVICES BORROWER LLC / PRIME FINANCE INC 5.750% 15/04/2026	USD	296.074,96	0,01
15.691.000	LAREDO PETROLEUM INC 7.750% 31/07/2029	USD	14.187.764,97	0,55	6.000.000	PRIMO WATER HOLDINGS INC 3.875% 31/10/2028	EUR	5.586.878,16	0,22
11.160.000	LOGMEIN INC 5.500% 01/09/2027	USD	9.386.318,08	0,36	3.277.000	PRIMO WATER HOLDINGS INC 4.375% 30/04/2029	USD	2.668.652,26	0,10

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Global High Yield

(ausgedrückt in EUR)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW	Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
9.000.000	RAIN CII CARBON LLC / CII CARBON CORP 7.250% 01/04/2025	USD	7.949.239,87	0,31	7.126.000	TENET HEALTHCARE CORP 4.375% 15/01/2030	USD	6.153.249,60	0,24
2.337.000	RANGE RESOURCES CORP 4.750% 15/02/2030	USD	2.086.931,34	0,08	1.650.000	TENET HEALTHCARE CORP 6.250% 01/02/2027	USD	1.523.080,13	0,06
7.427.000	RANGE RESOURCES CORP 8.250% 15/01/2029	USD	7.314.513,38	0,28	3.862.000	T-MOBILE USA INC 2.625% 15/02/2029	USD	3.169.548,87	0,12
9.822.000	ROBLOX CORP 3.875% 01/05/2030	USD	8.253.852,14	0,32	4.655.000	T-MOBILE USA INC 2.875% 15/02/2031	USD	3.773.072,82	0,15
8.356.000	ROCKET SOFTWARE INC 6.500% 15/02/2029	USD	6.807.093,12	0,26	2.700.000	T-MOBILE USA INC 3.500% 15/04/2031	USD	2.284.862,54	0,09
5.350.000	SCIENTIFIC GAMES INTERNATIONAL INC 7.000% 15/05/2028	USD	4.986.251,45	0,19	4.855.000	T-MOBILE USA INC 4.750% 01/02/2028	USD	4.434.344,06	0,17
9.800.000	SCIENTIFIC GAMES INTERNATIONAL INC 7.250% 15/11/2029	USD	9.229.242,41	0,36	5.385.000	T-MOBILE USA INC 5.375% 15/04/2027	USD	4.973.442,21	0,19
2.650.000	SCIENTIFIC GAMES INTERNATIONAL INC 8.625% 01/07/2025	USD	2.506.742,38	0,10	12.765.000	TTM TECHNOLOGIES INC 4.000% 01/03/2029	USD	10.693.713,68	0,41
4.938.000	SCIL IV LLC / SCIL USA HOLDINGS LLC 4.375% 01/11/2026	EUR	4.736.023,60	0,18	11.430.000	UNITED NATURAL FOODS INC 6.750% 15/10/2028	USD	10.527.284,66	0,41
1.000.000	SCIL IV LLC / SCIL USA HOLDINGS LLC 5.375% 01/11/2026	USD	826.557,70	0,03	19.253.000	UNITI GROUP LP / UNITI GROUP FINANCE INC / CSI CAPITAL LLC 6.500% 15/02/2029	USD	16.170.319,48	0,61
1.180.000	SCRIPPS ESCROW II INC 3.875% 15/01/2029	USD	986.117,95	0,04	16.226.000	UNIVISION COMMUNICATIONS INC 4.500% 01/05/2029	USD	13.881.487,45	0,53
960.000	SCRIPPS ESCROW II INC 5.375% 15/01/2031	USD	828.955,89	0,03	6.755.000	VICI PROPERTIES LP / VICI NOTE CO INC 4.125% 15/08/2030	USD	5.869.056,17	0,23
8.002.000	SCRIPPS ESCROW INC 5.875% 15/07/2027	USD	7.202.277,61	0,28	4.845.000	VICI PROPERTIES LP / VICI NOTE CO INC 4.625% 01/12/2029	USD	4.327.585,00	0,17
3.395.000	SENSATA TECHNOLOGIES INC 3.750% 15/02/2031	USD	2.826.639,78	0,11	12.336.000	VICTORIA'S SECRET & CO 4.625% 15/07/2029	USD	9.988.947,97	0,38
4.040.000	SENSATA TECHNOLOGIES INC 4.375% 15/02/2030	USD	3.476.558,06	0,13	7.979.000	WHITE CAP PARENT LLC 8.250% 15/03/2026	USD	7.067.013,25	0,27
7.075.000	SERVICE CORP INTERNATIONAL/US 4.000% 15/05/2031	USD	5.932.681,36	0,23	10.535.000	WORLD ACCEPTANCE CORP 7.000% 01/11/2026	USD	8.346.990,47	0,32
8.966.000	SIGNAL PARENT INC 6.125% 01/04/2029	USD	6.587.548,69	0,25	13.003.000	W&T OFFSHORE INC 9.750% 01/11/2023	USD	11.597.030,31	0,45
7.900.000	SINCLAIR TELEVISION GROUP INC 5.125% 15/02/2027	USD	6.453.986,60	0,25				<b>1.423.396.955,77</b>	<b>54,79</b>
1.056.000	SIRIUS XM RADIO INC 3.125% 01/09/2026	USD	897.666,33	0,03		<b>Frankreich</b>			
5.817.000	SIRIUS XM RADIO INC 3.875% 01/09/2031	USD	4.757.908,35	0,18	5.000.000	ALTICE FRANCE SA 2.125% 15/02/2025	EUR	4.755.627,25	0,18
5.628.000	SIRIUS XM RADIO INC 4.000% 15/07/2028	USD	4.810.748,03	0,19	4.228.000	ALTICE FRANCE SA 3.375% 15/01/2028	EUR	3.840.069,25	0,15
8.535.000	SIRIUS XM RADIO INC 4.125% 01/07/2030	USD	7.187.833,34	0,28	4.040.000	ALTICE FRANCE SA 4.125% 15/01/2029	EUR	3.658.634,38	0,14
10.016.000	SIZZLING PLATTER LLC / SIZZLING PLATTER FINANCE CORP 8.500% 28/11/2025	USD	8.287.871,95	0,32	3.045.000	ALTICE FRANCE SA/FRANCE 4.000% 15/07/2029	EUR	2.742.104,38	0,11
2.625.000	SONIC AUTOMOTIVE INC 4.625% 15/11/2029	USD	2.124.128,11	0,08	4.000.000	ALTICE FRANCE SA/FRANCE 4.250% 15/10/2029	EUR	3.631.718,32	0,14
3.625.000	SONIC AUTOMOTIVE INC 4.875% 15/11/2031	USD	2.905.537,73	0,11	2.200.000	BANIJAY ENTERTAINMENT SASU 3.500% 01/03/2025	EUR	2.196.792,91	0,08
10.910.000	SPRINT CAPITAL CORP 6.875% 15/11/2028	USD	11.354.028,03	0,44	250.000	BANIJAY ENTERTAINMENT SASU 5.375% 01/03/2025	USD	219.974,22	0,01
2.345.000	SPRINT CAPITAL CORP 8.750% 15/03/2032	USD	2.838.131,68	0,11	4.000.000	BANIJAY GROUP SAS 6.500% 01/03/2026	EUR	4.002.937,48	0,15
9.234.000	SRM ESCROW ISSUER LLC 6.000% 01/11/2028	USD	8.169.713,39	0,31	5.000.000	CASINO GUICHARD PERRACHO 5.250% 15/04/2027	EUR	4.260.429,45	0,16
9.865.000	STANDARD INDUSTRIES INC/NJ 3.375% 15/01/2031	USD	7.785.869,57	0,30	3.900.000	CASINO GUICHARD PERRACHON SA FRN PERP EMTN	EUR	1.797.021,21	0,07
1.322.000	STANDARD INDUSTRIES INC/NJ 4.375% 15/07/2030	USD	1.088.539,68	0,04	15.000.000	CASINO GUICHARD PERRACHON SA 1.865% 13/06/2022 EMTN	EUR	14.982.399,75	0,58
4.392.000	STANDARD INDUSTRIES INC/NJ 4.750% 15/01/2028	USD	3.798.986,61	0,15	1.300.000	CASINO GUICHARD PERRACHON SA 2.798% 05/08/2026 EMTN	EUR	1.102.217,03	0,04
10.987.000	STAPLES INC 10.750% 15/04/2027	USD	8.789.874,12	0,34	2.000.000	CASINO GUICHARD PERRACHON SA 4.498% 07/03/2024 EMTN	EUR	1.868.467,88	0,07
11.486.000	STAPLES INC 7.500% 15/04/2026	USD	10.019.752,98	0,39	3.101.000	CONSTELLUM SE 3.125% 15/07/2029	EUR	2.842.047,80	0,11
4.327.000	STARWOOD PROPERTY TRUST INC 3.625% 15/07/2026	USD	3.712.491,21	0,14	6.000.000	CONSTELLUM SE 4.250% 15/02/2026	EUR	6.008.132,94	0,23
300.000	STARWOOD PROPERTY TRUST INC 3.750% 31/12/2024	USD	262.196,96	0,01	2.690.000	FAURECIA SE 2.375% 15/06/2027	EUR	2.399.858,70	0,09
6.380.000	STARWOOD PROPERTY TRUST INC 5.500% 01/11/2023	USD	5.822.484,39	0,22	771.000	FAURECIA SE 2.375% 15/06/2029	EUR	666.159,13	0,03
11.088.000	STONEX GROUP INC 8.625% 15/06/2025	USD	10.409.653,57	0,40	7.859.000	FAURECIA SE 2.750% 15/02/2027	EUR	7.188.734,81	0,28
589.000	SUMMER BC BIDCO B LLC 5.500% 31/10/2026	USD	507.479,50	0,02	2.315.000	FAURECIA SE 3.125% 15/06/2026	EUR	2.210.082,39	0,09
12.871.000	SUNCOKE ENERGY INC 4.875% 30/06/2029	USD	10.914.568,67	0,42	4.785.000	FAURECIA SE 3.750% 15/06/2028	EUR	4.493.498,71	0,17
8.720.000	SWF ESCROW ISSUER CORP 6.500% 01/10/2029	USD	6.714.465,36	0,26	5.200.000	KAPLA HOLDING SAS 3.375% 15/12/2026	EUR	4.970.736,37	0,19
4.175.000	TALLGRASS ENERGY PARTNERS LP / TALLGRASS ENERGY FINANCE CORP 6.000% 01/03/2027	USD	3.742.014,51	0,14	5.000.000	LA FINANCIERE ATALIAN SASU 4.000% 15/05/2024	EUR	4.547.844,30	0,18
5.000.000	TALLGRASS ENERGY PARTNERS LP / TALLGRASS ENERGY FINANCE CORP 6.000% 01/09/2031	USD	4.330.484,07	0,17	6.525.000	LOXAM SAS 4.500% 15/02/2027	EUR	6.463.037,82	0,25
3.814.000	TALLGRASS ENERGY PARTNERS LP / TALLGRASS ENERGY FINANCE CORP 6.000% 31/12/2030	USD	3.326.157,91	0,13	7.100.000	PAPREC HOLDING SA 3.500% 01/07/2028	EUR	6.764.968,82	0,26
2.635.000	TALLGRASS ENERGY PARTNERS LP / TALLGRASS ENERGY FINANCE CORP 7.500% 01/10/2025	USD	2.496.408,16	0,10	10.650.000	PICARD GROUPE SAS 3.875% 01/07/2026	EUR	10.333.271,56	0,40
8.463.000	TAP ROCK RESOURCES LLC 7.000% 01/10/2026	USD	7.872.002,24	0,30	6.393.000	QUATRIM SASU 5.875% 15/01/2024	EUR	6.387.439,88	0,25
1.663.000	TARGA RESOURCES PARTNERS LP / TARGA RESOURCES PARTNERS FINANCE CORP 4.000% 15/01/2032	USD	1.434.563,36	0,06	4.355.000	TEREOS FINANCE GROUPE I SA 4.750% 30/04/2027	EUR	4.203.914,16	0,16
3.275.000	TARGA RESOURCES PARTNERS LP / TARGA RESOURCES PARTNERS FINANCE CORP 4.875% 01/02/2031	USD	2.966.220,18	0,11	4.871.000	TEREOS FINANCE GROUPE I SA 7.500% 30/10/2025	EUR	5.056.537,61	0,19
4.000.000	TARGA RESOURCES PARTNERS LP / TARGA RESOURCES PARTNERS FINANCE CORP 5.500% 01/03/2030	USD	3.735.367,49	0,14	9.500.000	VALLOUREC SA 8.500% 30/06/2026	EUR	9.722.430,06	0,37
18.853.000	TENET HEALTHCARE CORP 4.250% 01/06/2029	USD	16.296.352,23	0,63				<b>133.317.088,57</b>	<b>5,13</b>
						<b>Niederlande</b>			
					4.000.000	ABERTIS INFRASTRUCTURAS FINANCE BV FRN PERP	EUR	3.670.753,32	0,14
					4.200.000	ABERTIS INFRASTRUCTURAS FINANCE BV FRN PERP	EUR	4.110.068,80	0,16

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Global High Yield

(ausgedrückt in EUR)

## Wertpapierbestand zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW	Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
3.100.000	DARLING GLOBAL FINANCE BV 3.625% 15/05/2026	EUR	3.118.561,06	0,12	1.250.000	JAGUAR LAND ROVER AUTOMOTIVE PLC 5.875% 15/11/2024	EUR	1.270.470,13	0,05
6.175.000	DIEBOLD NIXDORF DUTCH HOLDING BV 9.000% 15/07/2025	EUR	6.378.276,06	0,25	13.500.000	VMED O2 UK FINANCING I PLC 3.250% 31/01/2031	EUR	12.422.421,50	0,48
6.662.000	NOBEL BIDCO BV 3.125% 15/06/2028	EUR	5.934.273,90	0,23	6.205.000	ZENITH FINCO PLC 6.500% 30/06/2027	GBP	6.718.617,87	0,26
10.000.000	NOBIAN FINANCE BV 3.625% 15/07/2026	EUR	9.106.311,00	0,35				<b>99.922.776,50</b>	<b>3,85</b>
14.000.000	REPSOL INTERNATIONAL FINANCE BV FRN PERP	EUR	13.279.930,58	0,50		<b>Deutschland</b>			
3.852.000	SAIPEM FINANCE INTERNATIONAL BV 3.750% 08/09/2023 EMTN	EUR	3.759.701,46	0,14	6.500.000	ADLER PELZER HOLDING GMBH 4.125% 01/04/2024	EUR	5.923.158,35	0,23
20.286.000	SIGMA HOLDCO BV 5.750% 15/05/2026	EUR	16.550.890,97	0,63	1.200.000	ADLER REAL ESTATE AG 1.500% 17/04/2022	EUR	1.186.641,55	0,05
400.000	SIGMA HOLDCO BV 7.875% 15/05/2026	USD	298.406,11	0,01	5.300.000	ADLER REAL ESTATE AG 1.875% 27/04/2023	EUR	5.026.883,79	0,19
4.900.000	STICHTING AK RABOBANK CERTIFICATEN 19.436% PERP STEP-UP	EUR	5.722.552,12	0,22	2.450.000	APCOA PARKING HOLDINGS GMBH 4.625% 15/01/2027	EUR	2.300.098,71	0,09
5.200.000	TRIVIUM PACKAGING FINANCE BV 3.750% 15/08/2026	EUR	5.097.615,95	0,20	4.000.000	COMMERZBANK AG FRN PERP	EUR	3.645.000,00	0,14
11.500.000	VZ VENDOR FINANCING II BV 2.875% 15/01/2029	EUR	10.386.902,47	0,40	4.200.000	CONSUS REAL ESTATE AG 4.000% 29/11/2022	EUR	3.962.980,31	0,15
4.874.000	WP/AP TELECOM HOLDINGS IV BV 3.750% 15/01/2029	EUR	4.637.501,38	0,18	4.500.000	CTEC II GMBH 5.250% 15/02/2030	EUR	4.148.363,97	0,16
3.000.000	ZF EUROPE FINANCE BV 2.000% 23/02/2026	EUR	2.815.996,44	0,11	4.000.000	DEUTSCHE LUFTHANSA AG 12/08/2075 FRN	EUR	3.720.000,00	0,14
4.500.000	ZF EUROPE FINANCE BV 2.500% 23/10/2027	EUR	4.089.778,83	0,16	8.300.000	DEUTSCHE LUFTHANSA AG 3.000% 29/05/2026 EMTN	EUR	7.982.493,38	0,30
2.500.000	ZF EUROPE FINANCE BV 3.000% 23/10/2029	EUR	2.235.518,13	0,09	5.700.000	DEUTSCHE LUFTHANSA AG 3.750% 11/02/2028 EMTN	EUR	5.472.000,00	0,21
7.000.000	ZIGGO BV 2.875% 15/01/2030	EUR	6.392.223,74	0,25	7.012.000	HT TROPLAST GMBH 9.250% 15/07/2025	EUR	6.996.199,93	0,27
			<b>107.585.262,32</b>	<b>4,14</b>	8.100.000	IHO VERWALTUNGS GMBH 3.625% 15/05/2025	EUR	7.994.962,20	0,31
	<b>Luxemburg</b>				2.400.000	SCHAEFFLER AG 3.375% 12/10/2028 EMTN	EUR	2.351.888,83	0,09
3.400.000	ADLER GROUP SA 1.875% 14/01/2026	EUR	2.819.484,34	0,11	3.850.000	SGL CARBON SE 4.625% 30/09/2024	EUR	3.798.415,31	0,15
3.400.000	ADLER GROUP SA 2.250% 14/01/2029	EUR	2.764.808,97	0,11	8.283.000	TUI CRUISES GMBH 6.500% 15/05/2026	EUR	7.844.631,92	0,30
6.400.000	ADLER GROUP SA 2.250% 27/04/2027	EUR	5.257.298,75	0,20	5.000.000	ZF FINANCE GMBH 2.750% 25/05/2027 EMTN	EUR	4.651.414,35	0,18
3.800.000	ALTICE FRANCE HOLDING SA 10.500% 15/05/2027	USD	3.577.627,82	0,14				<b>77.005.132,60</b>	<b>2,96</b>
300.000	ALTICE FRANCE HOLDING SA 6.000% 15/02/2028	USD	232.554,58	0,01		<b>Italien</b>			
10.000.000	ALTICE FRANCE HOLDING SA 8.000% 15/05/2027	EUR	10.331.880,40	0,40	2.365.000	ATLANTIA SPA 1.625% 03/02/2025 EMTN	EUR	2.328.111,27	0,09
9.375.734	ARD FINANCE SA 5.000% 30/06/2027	EUR	8.526.296,44	0,33	3.190.000	ATLANTIA SPA 1.875% 12/02/2028	EUR	3.022.443,81	0,12
17.944.000	GALAPAGOS HOLDING SA 7.000% 15/06/2022 - DEFAULTED	EUR	179,44	0,00	2.150.000	ATLANTIA SPA 1.875% 13/07/2027 EMTN	EUR	2.047.364,96	0,08
6.390.000	GAMMA BONDCO SARL 8.125% 15/11/2026	EUR	6.231.805,26	0,24	5.037.000	AUTOSTRADE PER L'ITALIA SPA 1.625% 25/01/2028 EMTN	EUR	4.837.374,12	0,19
7.000.000	KLEOPATRA FINCO SARL 4.250% 01/03/2026	EUR	6.245.657,39	0,24	3.125.000	AUTOSTRADE PER L'ITALIA SPA 1.750% 26/06/2026 EMTN	EUR	3.067.776,50	0,12
4.000.000	KLEOPATRA HOLDINGS 2 SCA 6.500% 01/09/2026	EUR	3.005.860,60	0,12	2.750.000	AUTOSTRADE PER L'ITALIA SPA 1.875% 26/09/2029 EMTN	EUR	2.597.672,83	0,10
8.940.000	LINCOLN FINANCING SARL 3.625% 01/04/2024	EUR	8.929.704,79	0,34	8.000.000	AUTOSTRADE PER L'ITALIA SPA 2.000% 15/01/2030	EUR	7.542.555,04	0,29
10.000.000	LUNE HOLDINGS SARL 5.625% 15/11/2028	EUR	8.951.496,60	0,34	4.335.000	BANCA MONTE DEI PASCHI DI SIENA SPA 1.875% 09/01/2026	EUR	3.931.090,58	0,15
6.900.000	MITSUBISHI UFJ INVESTOR SERVICES & BANKING LUXEMBOURG SA 15/12/2050 FRN EMTN	EUR	2.720.651,16	0,10	4.700.000	BANCA MONTE DEI PASCHI DI SIENA SPA 2.625% 28/04/2025 EMTN	EUR	4.431.275,53	0,17
3.424.000	SUMMER BC HOLDCO A SARL 9.250% 31/10/2027	EUR	3.525.035,08	0,14	3.500.000	BANCO BPM SPA FRN PERP	EUR	3.540.213,95	0,14
14.900.000	SUMMER BC HOLDCO B SARL 5.750% 31/10/2026	EUR	15.115.208,45	0,58	4.000.000	BANCO BPM SPA FRN PERP	EUR	3.973.056,80	0,15
8.200.000	VIVION INVESTMENTS SARL 3.000% 08/08/2024	EUR	7.886.181,49	0,30	5.699.000	CASTOR SPA 6.000% 15/02/2029	EUR	5.607.696,78	0,22
4.200.000	VIVION INVESTMENTS SARL 3.500% 01/11/2025	EUR	4.018.747,19	0,15	9.350.000	PRO-GEST SPA 3.250% 15/12/2024	EUR	7.103.832,20	0,26
			<b>100.140.478,75</b>	<b>3,85</b>	3.711.000	TELECOM ITALIA SPA/MILANO 1.625% 18/01/2029 EMTN	EUR	3.137.150,59	0,12
	<b>Vereinigtes Königreich</b>				1.700.000	TELECOM ITALIA SPA/MILANO 5.250% 17/03/2055 EMTN	EUR	1.655.022,96	0,06
10.000.000	BCP V MODULAR SERVICES FINANCE II PLC 4.750% 30/11/2028	EUR	9.581.681,30	0,37				<b>58.822.637,92</b>	<b>2,26</b>
10.000.000	BELLIS ACQUISITION CO PLC 3.250% 16/02/2026	GBP	10.928.690,74	0,42		<b>Spanien</b>			
3.280.000	BELLIS ACQUISITION CO PLC 4.500% 16/02/2026	GBP	3.718.537,41	0,14	5.700.000	CELLNEX FINANCE CO SA 2.250% 12/04/2026	EUR	5.657.940,84	0,22
1.231.000	BELLIS FINCO PLC 4.000% 16/02/2027	GBP	1.294.250,62	0,05	6.500.000	EDREAMS ODIGEO SA 5.500% 15/07/2027	EUR	6.338.958,99	0,24
11.556.000	EC FINANCE PLC 3.000% 15/10/2026	EUR	11.352.097,27	0,44	6.630.000	GRIFOLS ESCROW ISSUER SA 3.875% 15/10/2028	EUR	6.304.855,78	0,24
3.500.000	EG GLOBAL FINANCE PLC 4.375% 07/02/2025	EUR	3.400.687,29	0,13	3.000.000	INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP SA 2.750% 25/03/2025	EUR	2.855.898,39	0,11
2.650.000	EG GLOBAL FINANCE PLC 6.250% 30/10/2025	EUR	2.642.998,54	0,10	5.700.000	INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP SA 3.750% 25/03/2029	EUR	5.135.007,28	0,20
1.600.000	EG GLOBAL FINANCE PLC 6.750% 07/02/2025	USD	1.430.121,76	0,06	13.771.000	LORCA TELECOM BONDCO SA 4.000% 18/09/2027	EUR	13.262.509,13	0,51
817.000	EG GLOBAL FINANCE PLC 8.500% 30/10/2025	USD	751.558,27	0,03	1.784.000	NH HOTEL GROUP SA 4.000% 02/07/2026	EUR	1.740.444,28	0,07
5.127.000	INEOS QUATTRO FINANCE 1 PLC 3.750% 15/07/2026	EUR	4.819.380,00	0,19				<b>41.295.614,69</b>	<b>1,59</b>
15.000.000	INEOS QUATTRO FINANCE 2 PLC 2.500% 15/01/2026	EUR	14.175.000,00	0,54		<b>Kanada</b>			
1.461.000	INEOS QUATTRO FINANCE 2 PLC 3.375% 15/01/2026	USD	1.215.396,95	0,05	793.000	BAUSCH HEALTH COS INC 4.875% 01/06/2028	USD	682.553,76	0,03
11.100.000	INTERNATIONAL GAME TECHNOLOGY PLC 5.250% 15/01/2029	USD	9.953.779,57	0,38					
4.400.000	JAGUAR LAND ROVER AUTOMOTIVE PLC 2.200% 15/01/2024	EUR	4.247.087,28	0,16					

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.





## NN (L) Global High Yield

(ausgedrückt in EUR)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
<b>Südafrika</b>				
15.076.589	K2016470219 SOUTH AFRICA LTD 3.000% 31/12/2022	USD	10.857,75	0,00
24.982.123	K2016470219 SOUTH AFRICA LTD 8.000% 31/12/2022	EUR	57.959,03	0,00
			<b>68.816,78</b>	<b>0,00</b>
<b>Kroatien</b>				
2.656.000	AGROKOR BOND CONVERTIBLE ZCP 15/07/2031	EUR	0,03	0,00
			<b>0,03</b>	<b>0,00</b>
			<b>2.272.149.943,34</b>	<b>87,47</b>

### Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente

#### Aktien

##### Vereinigte Staaten

68.161	QUISILVER INC	USD	619.504,07	0,02
			<b>619.504,07</b>	<b>0,02</b>

##### Südafrika

176.579.086	HOLDCO 2 ORDINARY A SHARES	USD	0,00	0,00
28.878.638	HOLDCO 2 ORDINARY B SHARES	USD	0,00	0,00
			<b>0,00</b>	<b>0,00</b>
			<b>619.504,07</b>	<b>0,02</b>

#### Anleihen und andere Schuldtitel

##### Luxemburg

867.526	HELIIX HOLDCO SA 10.000% 19/04/2026	EUR	20.876,25	0,00
			<b>20.876,25</b>	<b>0,00</b>

##### Südafrika

9.847.356	K2016470260 SOUTH AFRICA LTD 25.000% 31/12/2022	USD	1.685,73	0,00
			<b>1.685,73</b>	<b>0,00</b>

##### Bermuda

2.500.000	3D-GOLD JEWELLERY HOLDINGS LTD 9.250% 17/10/2014 - DEFAULTED	USD	224,69	0,00
			<b>224,69</b>	<b>0,00</b>
			<b>22.786,67</b>	<b>0,00</b>

#### Organismen für gemeinsame Anlagen

#### Offene Fonds

##### Luxemburg

9.475	NN (L) ASIAN HIGH YIELD - I CAP USD	USD	45.167.722,55	1,74
4.970	NN (L) EUROPEAN HIGH YIELD - Z CAP EUR	EUR	45.380.026,30	1,75
17.640	NN (L) LIQUID EUR - Z CAP EUR	EUR	17.422.981,18	0,67
18.669	NN (L) US HIGH YIELD - Z CAP USD	USD	105.498.432,59	4,06
			<b>213.469.162,62</b>	<b>8,22</b>
			<b>213.469.162,62</b>	<b>8,22</b>

**Wertpapierbestand Gesamt** **2.487.766.529,14** **95,77**

### Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022

Zu erhalten (%)	Zu zahlen (%)	Fälligkeitsdatum	Währung	Nennwert	Swap-Wert in EUR
<b>Zinsswap</b>					
Floating	2.295	04/05/2027	USD	25.000.000,00	159.586,35
					<b>159.586,35</b>
Zu erhalten	Zu zahlen	Fälligkeitsdatum	Engagement in EUR	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR	

#### Devisentermingeschäfte

230.731.757,05	AUD	167.913.632,12	USD	20/04/2022	149.067.827,02	4.838.927,50
1.579.969.548,20	ZAR	105.300.662,82	USD	20/04/2022	94.459.100,61	2.339.612,34
523.242.477,14	PLN	122.963.257,87	USD	19/04/2022	111.274.536,97	2.177.828,50
87.789.404,53	AUD	57.149.389,85	EUR	20/04/2022	57.149.389,85	2.084.927,38
226.494.393,54	PLN	47.566.763,42	EUR	20/04/2022	47.566.763,42	1.186.634,83
11.493.612,26	AUD	6.241.735,16	GBP	20/04/2022	7.425.515,69	373.226,04
27.389.624,11	EUR	22.853.074,36	GBP	20/04/2022	27.389.624,11	362.093,60
26.029.685,39	PLN	4.564.269,28	GBP	20/04/2022	5.539.518,67	204.943,56
4.644.291,36	USD	3.465.620,10	GBP	20/04/2022	4.134.874,79	73.475,02
5.632.139,60	EUR	90.944.872,81	ZAR	20/04/2022	5.632.139,60	52.438,71
1.934.000,00	CHF	1.869.567,23	EUR	30/06/2022	1.869.567,23	20.003,30
247.762,15	AUD	165.452,23	CHF	20/04/2022	160.123,80	5.574,60
555.656,18	PLN	119.799,03	CHF	20/04/2022	118.252,20	2.597,56
240.842,15	SEK	22.517,85	EUR	20/04/2022	22.517,85	704,49
89.197,44	AUD	620.294,11	SEK	20/04/2022	57.626,53	374,71
99.589,30	USD	91.373,78	CHF	20/04/2022	88.665,69	219,37
76.112,67	GBP	99.994,27	USD	20/04/2022	91.812,40	187,16
12.141,13	SEK	1.257,18	USD	20/04/2022	1.133,70	41,30
36.754,54	SEK	5.199,48	AUD	20/04/2022	3.468,77	35,67
1.205,40	CHF	1.303,97	USD	20/04/2022	1.177,56	5,91
98.855,35	SEK	44.464,20	PLN	20/04/2022	9.246,44	(39,23)
576.813,76	ZAR	367.794,92	SEK	20/04/2022	35.749,87	(74,30)
3.509,15	CHF	5.206,94	AUD	20/04/2022	3.485,45	(85,88)
53.989,82	CHF	52.892,68	EUR	20/04/2022	52.892,68	(160,42)
198.528,40	PLN	445.789,55	SEK	20/04/2022	42.249,91	(250,00)
6.185.000,00	SEK	596.564,61	EUR	30/06/2022	596.564,61	(804,42)
36.212,51	USD	346.039,09	SEK	20/04/2022	32.240,48	(834,52)
903.861,96	ZAR	57.730,14	CHF	20/04/2022	56.019,72	(931,21)
25.062,79	CHF	118.237,65	PLN	20/04/2022	24.523,29	(971,89)
586.770,34	EUR	601.904,93	CHF	20/04/2022	586.770,34	(1.114,71)
130.567,87	GBP	234.992,92	AUD	20/04/2022	157.700,72	(4.139,18)
208.748,21	EUR	2.229.269,72	SEK	20/04/2022	208.748,21	(6.201,16)
2.234.638,66	GBP	2.668.189,27	EUR	20/04/2022	2.668.189,27	(25.360,41)

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Global High Yield

(ausgedrückt in EUR)

### Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Zu erhalten	Zu zahlen	Fälligkeits- datum	Engagement in EUR	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR
76.118.654,54 ZAR	3.977.719,96 GBP	20/04/2022	4.717.693,94	(34.235,62)
965.772,67 GBP	5.566.743,01 PLN	20/04/2022	1.157.775,95	(56.067,72)
2.593.613,53 EUR	3.957.227,00 AUD	20/04/2022	2.593.613,53	(76.454,01)
45.077.733,38 GBP	53.254.265,49 EUR	30/06/2022	53.254.265,49	(115.109,61)
8.378.806,34 USD	11.558.936,20 AUD	20/04/2022	7.667.349,79	(272.185,21)
671.925.554,11 ZAR	41.503.685,17 EUR	20/04/2022	41.503.685,17	(279.331,36)
104.562.395,83 USD	94.278.178,54 EUR	20/04/2022	94.278.178,54	(345.825,34)
15.202.031,69 EUR	72.632.411,39 PLN	20/04/2022	15.202.031,69	(432.248,79)
143.424.333,30 USD	129.055.214,05 EUR	30/06/2022	129.055.214,05	(608.879,40)
26.771.369,47 USD	116.962.696,47 PLN	19/04/2022	24.244.830,87	(1.129.284,94)
551.539.727,69 EUR	616.433.543,63 USD	20/04/2022	551.539.727,69	(2.225.829,17)
			<b>1.441.742.384,16</b>	<b>8.107.433,05</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>				<b>8.267.019,40</b>

### Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick

		% NIW
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	<b>2.487.766.529,14</b>	<b>95,77</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	<b>8.267.019,40</b>	<b>0,32</b>
<b>Bankguthaben</b>	<b>56.967.704,88</b>	<b>2,19</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>	<b>44.684.743,80</b>	<b>1,72</b>
<b>Nettovermögen Gesamt</b>	<b>2.597.685.997,22</b>	<b>100,00</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.



## NN (L) Global Inflation Linked Bond

(ausgedrückt in EUR)

### Statistische Angaben

<b>Nettovermögen</b>	31.03.2022	EUR	189.852.278,50	<b>Anzahl der Anteile</b>		
	30.09.2021	EUR	199.868.917,96			
	30.09.2020	EUR	164.269.474,91		Capitalisation R Hedged (iii) (SEK)	31.03.2022
<b>Nettoinventarwert pro Anteil**</b>					30.09.2021	4.061
					30.09.2020	-
				Capitalisation X Hedged (iii) (EUR)	31.03.2022	12.985
Capitalisation I Hedged (iii) (EUR)	31.03.2022	EUR	7.170,05		30.09.2021	17.488
	30.09.2021	EUR	7.307,81		30.09.2020	20.481
	30.09.2020	EUR	7.146,96	Distribution P Hedged (iii) (EUR)	31.03.2022	6.946
Capitalisation N Hedged (iii) (EUR)	31.03.2022	EUR	342,27		30.09.2021	7.002
	30.09.2021	EUR	348,84		30.09.2020	2.850
	30.09.2020	EUR	341,28	Distribution R Hedged (iii) (EUR)	31.03.2022	812
Capitalisation P Hedged (iii) (EUR)	31.03.2022	EUR	333,01		30.09.2021	862
	30.09.2021	EUR	339,89		30.09.2020	882
	30.09.2020	EUR	333,62	<b>Laufende Kosten in %*</b>		
Capitalisation R Hedged (iii) (EUR)	31.03.2022	EUR	337,27	Capitalisation I Hedged (iii) (EUR)	31.03.2022	0,51%
	30.09.2021	EUR	343,82	Capitalisation N Hedged (iii) (EUR)	31.03.2022	0,57%
	30.09.2020	EUR	336,44	Capitalisation P Hedged (iii) (EUR)	31.03.2022	0,87%
Capitalisation R Hedged (iii) (SEK)	31.03.2022	SEK	2.520,41	Capitalisation R Hedged (iii) (EUR)	31.03.2022	0,58%
	30.09.2021	SEK	2.561,89	Capitalisation R Hedged (iii) (SEK)	31.03.2022	0,58%
	30.09.2020	SEK	-	Capitalisation X Hedged (iii) (EUR)	31.03.2022	0,97%
Capitalisation X Hedged (iii) (EUR)	31.03.2022	EUR	329,90	Distribution P Hedged (iii) (EUR)	31.03.2022	0,87%
	30.09.2021	EUR	336,63	Distribution R Hedged (iii) (EUR)	31.03.2022	0,58%
	30.09.2020	EUR	330,67	<b>Portfolioumsatz in %*</b>	31.03.2022	(10,92%)
Distribution P Hedged (iii) (EUR)	31.03.2022	EUR	1.169,55			
	30.09.2021	EUR	1.193,75			
	30.09.2020	EUR	1.171,61			
Distribution R Hedged (iii) (EUR)	31.03.2022	EUR	1.173,88			
	30.09.2021	EUR	1.196,50			
	30.09.2020	EUR	1.170,74			
<b>Anzahl der Anteile</b>						
Capitalisation I Hedged (iii) (EUR)	31.03.2022		7.240			
	30.09.2021		7.979			
	30.09.2020		5.666			
Capitalisation N Hedged (iii) (EUR)	31.03.2022		341.324			
	30.09.2021		344.757			
	30.09.2020		313.782			
Capitalisation P Hedged (iii) (EUR)	31.03.2022		16.659			
	30.09.2021		12.556			
	30.09.2020		14.484			
Capitalisation R Hedged (iii) (EUR)	31.03.2022		1.535			
	30.09.2021		2.113			
	30.09.2020		2.113			

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

## NN (L) Global Inflation Linked Bond

(ausgedrückt in EUR)

### Finanzabschlüsse

#### Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022

	Erläuterungen	
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	2	<b>177.347.267,78</b>
Anleihen und andere Schuldtitel		177.347.267,78
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	2	<b>1.128.154,23</b>
Devisentermingeschäfte		380.251,91
Futures		747.902,32
<b>Bankguthaben</b>		<b>10.816.545,90</b>
<b>Hinterlegte Sicherheiten</b>		<b>662.991,50</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte</b>	4, 12	<b>1.343.367,85</b>
<b>Vermögenswerte Gesamt</b>		<b>191.298.327,26</b>
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>	4, 12	<b>(185.451,47)</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	2	<b>(1.260.597,29)</b>
Inflationsswap		(120.675,89)
Zinsswaps		(1.139.921,40)
<b>Verbindlichkeiten Gesamt</b>		<b>(1.446.048,76)</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Berichtszeitraums</b>		<b>189.852.278,50</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Global Inflation Linked Bond

(ausgedrückt in EUR)

## Wertpapierbestand zum 31.03.2022

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW	Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
<b>Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>									
<b>Anleihen und andere Schuldtitel</b>									
<b>Vereinigte Staaten</b>									
60.902	UNITED STATES TREASURY INFLATION INDEXED BONDS 0.125% 15/01/2023	USD	56.634,08	0,03					
4.701.011	UNITED STATES TREASURY INFLATION INDEXED BONDS 0.125% 15/01/2030	USD	4.448.884,95	2,33					
1.296.036	UNITED STATES TREASURY INFLATION INDEXED BONDS 0.125% 15/01/2031	USD	1.233.054,31	0,65					
971.892	UNITED STATES TREASURY INFLATION INDEXED BONDS 0.125% 15/02/2051	USD	896.833,66	0,47					
403.984	UNITED STATES TREASURY INFLATION INDEXED BONDS 0.125% 15/02/2052	USD	377.228,51	0,20					
1.069.946	UNITED STATES TREASURY INFLATION INDEXED BONDS 0.125% 15/04/2025	USD	1.002.989,62	0,53					
997.016	UNITED STATES TREASURY INFLATION INDEXED BONDS 0.125% 15/04/2026	USD	934.612,88	0,49					
1.589.469	UNITED STATES TREASURY INFLATION INDEXED BONDS 0.125% 15/07/2024	USD	1.496.630,38	0,79					
2.636.702	UNITED STATES TREASURY INFLATION INDEXED BONDS 0.125% 15/07/2026	USD	2.484.377,36	1,31					
504.418	UNITED STATES TREASURY INFLATION INDEXED BONDS 0.125% 15/07/2030	USD	480.459,11	0,25					
639.878	UNITED STATES TREASURY INFLATION INDEXED BONDS 0.125% 15/07/2031	USD	611.435,82	0,32					
2.093.016	UNITED STATES TREASURY INFLATION INDEXED BONDS 0.125% 15/10/2024	USD	1.964.757,71	1,03					
1.816.125	UNITED STATES TREASURY INFLATION INDEXED BONDS 0.250% 15/01/2025	USD	1.709.351,95	0,90					
896.719	UNITED STATES TREASURY INFLATION INDEXED BONDS 0.250% 15/02/2050	USD	847.585,16	0,45					
1.725.618	UNITED STATES TREASURY INFLATION INDEXED BONDS 0.250% 15/07/2029	USD	1.651.559,24	0,87					
2.443.005	UNITED STATES TREASURY INFLATION INDEXED BONDS 0.375% 15/01/2027	USD	2.320.591,17	1,22					
3.212.868	UNITED STATES TREASURY INFLATION INDEXED BONDS 0.375% 15/07/2025	USD	3.050.062,83	1,61					
2.735.405	UNITED STATES TREASURY INFLATION INDEXED BONDS 0.375% 15/07/2027	USD	2.610.152,03	1,37					
1.207.038	UNITED STATES TREASURY INFLATION INDEXED BONDS 0.500% 15/01/2028	USD	1.156.748,99	0,61					
1.248.509	UNITED STATES TREASURY INFLATION INDEXED BONDS 0.500% 15/04/2024	USD	1.177.365,61	0,62					
808.508	UNITED STATES TREASURY INFLATION INDEXED BONDS 0.625% 15/01/2024	USD	763.294,33	0,40					
5.890.119	UNITED STATES TREASURY INFLATION INDEXED BONDS 0.625% 15/01/2026	USD	5.632.253,85	2,96					
1.467.432	UNITED STATES TREASURY INFLATION INDEXED BONDS 0.625% 15/02/2043	USD	1.472.093,04	0,78					
1.493.076	UNITED STATES TREASURY INFLATION INDEXED BONDS 0.750% 15/02/2042	USD	1.533.050,26	0,81					
1.552.109	UNITED STATES TREASURY INFLATION INDEXED BONDS 0.750% 15/02/2045	USD	1.599.943,83	0,84					
952.034	UNITED STATES TREASURY INFLATION INDEXED BONDS 0.750% 15/07/2028	USD	933.930,71	0,49					
2.364.968	UNITED STATES TREASURY INFLATION INDEXED BONDS 0.875% 15/01/2029	USD	2.340.184,43	1,23					
1.281.159	UNITED STATES TREASURY INFLATION INDEXED BONDS 0.875% 15/02/2047	USD	1.377.950,54	0,73					
871.478	UNITED STATES TREASURY INFLATION INDEXED BONDS 1.000% PERP	USD	979.862,52	0,52					
1.376.410	UNITED STATES TREASURY INFLATION INDEXED BONDS 1.000% 15/02/2046	USD	1.506.642,83	0,79					
1.185.714	UNITED STATES TREASURY INFLATION INDEXED BONDS 1.000% 15/02/2048	USD	1.322.273,25	0,70					
1.507.925	UNITED STATES TREASURY INFLATION INDEXED BONDS 1.375% 15/02/2044	USD	1.738.066,28	0,92					
2.013.030	UNITED STATES TREASURY INFLATION INDEXED BONDS 1.750% 15/01/2028	USD	2.064.567,49	1,09					
3.017.613	UNITED STATES TREASURY INFLATION INDEXED BONDS 2.000% 15/01/2026	USD	3.032.287,59	1,60					
1.170.693	UNITED STATES TREASURY INFLATION INDEXED BONDS 2.125% 15/02/2040	USD	1.483.243,72	0,78					
1.733.171	UNITED STATES TREASURY INFLATION INDEXED BONDS 2.125% 15/02/2041	USD	2.204.254,50	1,16					
4.206.115	UNITED STATES TREASURY INFLATION INDEXED BONDS 2.375% 15/01/2025	USD	4.190.079,16	2,20					
2.439.745	UNITED STATES TREASURY INFLATION INDEXED BONDS 2.375% 15/01/2027	USD	2.536.696,08	1,34					
1.872.571	UNITED STATES TREASURY INFLATION INDEXED BONDS 2.500% 15/01/2029	USD	2.044.540,03	1,08					
570.215	UNITED STATES TREASURY INFLATION INDEXED BONDS 3.375% 15/04/2032	USD	721.823,62	0,38					
1.738.270	UNITED STATES TREASURY INFLATION INDEXED BONDS 3.625% 15/04/2028	USD	1.975.421,94	1,04					
3.334.929	UNITED STATES TREASURY INFLATION INDEXED BONDS 3.875% 15/04/2029	USD	3.958.893,36	2,09					
			<b>75.922.668,73</b>	<b>39,98</b>					
<b>Vereinigtes Königreich</b>									
1.160.515	UNITED KINGDOM INFLATION-LINKED GILT 0.125% 10/08/2028	GBP	1.685.084,13	0,89					
782.750	UNITED KINGDOM INFLATION-LINKED GILT 0.125% 10/08/2041	GBP	1.448.073,25	0,76					
739.930	UNITED KINGDOM INFLATION-LINKED GILT 0.125% 10/08/2048	GBP	1.516.358,81	0,80					
961.936	UNITED KINGDOM INFLATION-LINKED GILT 0.125% 22/03/2024	GBP	1.254.284,88	0,66					
934.982	UNITED KINGDOM INFLATION-LINKED GILT 0.125% 22/03/2026	GBP	1.277.969,81	0,67					
1.327.555	UNITED KINGDOM INFLATION-LINKED GILT 0.125% 22/03/2029	GBP	1.948.864,20	1,03					
128.483	UNITED KINGDOM INFLATION-LINKED GILT 0.125% 22/03/2039	GBP	227.128,08	0,12					
1.140.152	UNITED KINGDOM INFLATION-LINKED GILT 0.125% 22/03/2044	GBP	2.171.308,97	1,14					
924.300	UNITED KINGDOM INFLATION-LINKED GILT 0.125% 22/03/2046	GBP	1.817.116,23	0,96					
280.855	UNITED KINGDOM INFLATION-LINKED GILT 0.125% 22/03/2051	GBP	598.431,32	0,32					
769.767	UNITED KINGDOM INFLATION-LINKED GILT 0.125% 22/03/2058	GBP	1.831.652,19	0,96					
890.631	UNITED KINGDOM INFLATION-LINKED GILT 0.125% 22/03/2068	GBP	2.590.388,85	1,36					
61.825	UNITED KINGDOM INFLATION-LINKED GILT 0.125% 22/03/2073	GBP	204.327,84	0,11					
1.002.945	UNITED KINGDOM INFLATION-LINKED GILT 0.125% 22/11/2036	GBP	1.716.829,78	0,90					
461.769	UNITED KINGDOM INFLATION-LINKED GILT 0.125% 22/11/2056	GBP	1.074.233,50	0,57					
524.548	UNITED KINGDOM INFLATION-LINKED GILT 0.125% 22/11/2065	GBP	1.432.883,06	0,75					
905.653	UNITED KINGDOM INFLATION-LINKED GILT 0.250% 22/03/2052	GBP	2.019.721,64	1,06					
943.012	UNITED KINGDOM INFLATION-LINKED GILT 0.375% 22/03/2062	GBP	2.548.925,92	1,34					
1.042.125	UNITED KINGDOM INFLATION-LINKED GILT 0.500% 22/03/2050	GBP	2.368.932,15	1,25					
953.732	UNITED KINGDOM INFLATION-LINKED GILT 0.625% 22/03/2040	GBP	1.841.803,46	0,97					
1.001.858	UNITED KINGDOM INFLATION-LINKED GILT 0.625% 22/11/2042	GBP	2.042.904,62	1,08					
1.217.565	UNITED KINGDOM INFLATION-LINKED GILT 0.750% 22/03/2034	GBP	2.099.477,09	1,11					
1.009.219	UNITED KINGDOM INFLATION-LINKED GILT 0.750% 22/11/2047	GBP	2.298.363,00	1,21					
1.162.451	UNITED KINGDOM INFLATION-LINKED GILT 1.125% 22/11/2037	GBP	2.290.176,17	1,21					
1.342.397	UNITED KINGDOM INFLATION-LINKED GILT 1.250% 22/11/2027	GBP	2.035.441,87	1,07					
1.272.949	UNITED KINGDOM INFLATION-LINKED GILT 1.250% 22/11/2032	GBP	2.235.940,68	1,18					
925.663	UNITED KINGDOM INFLATION-LINKED GILT 1.250% 22/11/2055	GBP	2.716.254,37	1,43					
560.000	UNITED KINGDOM INFLATION-LINKED GILT 2.000% 26/01/2035	GBP	2.001.254,86	1,05					
380.000	UNITED KINGDOM INFLATION-LINKED GILT 2.500% 17/07/2024	GBP	1.677.818,71	0,88					
270.000	UNITED KINGDOM INFLATION-LINKED GILT 4.125% 22/07/2030	GBP	1.228.068,90	0,65					
			<b>52.200.018,34</b>	<b>27,49</b>					
<b>Frankreich</b>									
258.334	FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 0.100% 01/03/2025	EUR	282.370,33	0,15					
847.330	FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 0.100% 01/03/2028	EUR	959.441,22	0,51					
920.363	FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 0.100% 25/07/2036	EUR	1.125.676,78	0,59					

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.



## NN (L) Global Inflation Linked Bond

(ausgedrückt in EUR)

### Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022

Zu erhalten (%)	Zu zahlen (%)	Fälligkeitsdatum	Währung	Nennwert	Swap-Wert in EUR	Zu erhalten	Zu zahlen	Fälligkeitsdatum	Engagement in EUR	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR	
<b>Zinsswaps</b>											
Floating	1.016	24/12/2050	USD	4.100.000,00	987.181,17	8.458.632,80	SEK	891.921,35	USD 20/04/2022	805.929,77	14.346,76
Floating	1.676	19/07/2051	USD	2.180.000,00	246.139,60	5.326.426,95	SEK	422.894,15	GBP 20/04/2022	507.426,04	13.439,58
Floating	0,601	21/03/2072	EUR	1.000.000,00	65.198,19	2.680.000,00	AUD	1.793.816,67	EUR 10/06/2022	1.793.816,67	12.399,28
Floating	0,633	18/03/2072	EUR	1.133.397,00	59.885,90	3.420.000,00	ILS	1.061.586,15	USD 10/06/2022	944.867,13	10.996,72
Floating	0,144	05/11/2071	EUR	219.643,00	53.925,17	4.461.881,40	SEK	423.454,48	EUR 20/04/2022	423.454,48	6.766,47
Floating	0,166	05/11/2071	EUR	219.644,00	52.028,82	500.000,00	NZD	306.764,65	EUR 10/06/2022	306.764,65	4.629,51
Floating	0,173	05/11/2071	EUR	219.644,00	51.425,37	500.000,00	CHF	485.623,46	EUR 10/06/2022	485.623,46	2.867,21
Floating	0,174	05/11/2071	EUR	219.644,00	51.339,16	482.971,32	SEK	5.983.191,00	JPY 20/04/2022	46.023,97	2.272,05
Floating	0,651	21/03/2072	EUR	876.603,00	39.838,84	1.440.000,00	SGD	1.061.701,05	USD 10/06/2022	945.881,76	2.042,83
1,154	Floating	21/03/2042	EUR	2.185.209,00	(28.475,79)	326.833,90	CAD	233.701,87	EUR 20/04/2022	233.701,87	1.347,24
1,151	Floating	18/03/2042	EUR	2.644.791,00	(36.098,33)	855.990.000,00	CLP	1.073.723,22	USD 10/06/2022	961.185,95	1.240,93
1,120	Floating	21/03/2042	EUR	2.500.000,00	(47.769,85)	166.620,19	AUD	111.961,72	EUR 20/04/2022	111.961,72	462,25
0,375	Floating	14/01/2032	EUR	2.334.482,00	(174.404,46)	299.208,76	SEK	39.784,56	CAD 20/04/2022	28.499,93	238,27
0,369	Floating	14/01/2032	EUR	2.345.518,00	(176.544,37)	2.960.000,00	DKK	397.878,24	EUR 10/06/2022	397.878,24	63,70
1.324	Floating	19/07/2031	USD	4.660.000,00	(367.282,80)	37.466,09	SEK	26.480,66	DKK 20/04/2022	3.570,14	52,59
0,256	Floating	29/10/2031	EUR	7.200.000,00	(602.708,62)	60.946,95	NZD	38.026,20	EUR 20/04/2022	38.026,20	47,34
0,738	Floating	24/12/2030	USD	11.250.000,00	(1.313.599,40)	86.109,13	SEK	13.271,59	NZD 20/04/2022	8.206,76	12,01
<b>(1.139.921,40)</b>						1.450,70	AUD	10.146,77	SEK 20/04/2022	966,91	0,46
<b>Inflationsswaps</b>						42.223,90	DKK	5.677,04	EUR 20/04/2022	5.677,04	(0,65)
2.541	Floating	15/03/2032	EUR	1.621.316,00	(34.895,81)	574,48	NZD	3.733,04	SEK 20/04/2022	353,24	(1,07)
2.503	Floating	15/03/2032	EUR	1.652.198,00	(42.732,28)	106.663,00	JPY	800,73	EUR 20/04/2022	800,73	(11,05)
2.500	Floating	15/03/2032	EUR	1.646.486,00	(43.047,80)	2.448,14	CAD	18.429,35	SEK 20/04/2022	1.746,06	(16,35)
<b>(120.675,89)</b>						413.287,47	EUR	3.074.450,01	DKK 20/04/2022	413.287,47	(27,32)
<b>Devisentermingeschäfte</b>						171.157,17	SEK	24.537,16	AUD 20/04/2022	16.305,86	(52,79)
<b>Zinsswaps</b>						121.723,00	JPY	10.229,68	SEK 20/04/2022	951,63	(85,18)
<b>Inflationsswaps</b>						22.961,36	USD	220.188,56	SEK 20/04/2022	20.709,37	(603,83)
<b>Devisentermingeschäfte</b>						35.388,02	GBP	447.147,56	SEK 20/04/2022	42.362,57	(1.262,43)
<b>Zinsswaps</b>						1.052.336,35	USD	80.670.000,00	INR 10/06/2022	938.496,70	(2.738,95)
<b>Inflationsswaps</b>						1.014.583,56	EUR	4.770.000,00	PLN 10/06/2022	1.014.583,56	(4.470,83)
<b>Devisentermingeschäfte</b>						556.712,80	EUR	5.490.000,00	NOK 10/06/2022	556.712,80	(5.853,19)
<b>Zinsswaps</b>						960.667,60	EUR	990.000,00	CHF 10/06/2022	960.667,60	(6.543,93)
<b>Inflationsswaps</b>						1.063.496,33	USD	3.420.000,00	ILS 10/06/2022	937.744,76	(9.284,36)
<b>Devisentermingeschäfte</b>						1.272.220.000,00	KRW	1.058.208,01	USD 10/06/2022	942.388,83	(9.346,65)
<b>Zinsswaps</b>						34.430.000,00	THB	1.054.320,63	USD 10/06/2022	942.717,75	(16.057,18)
<b>Inflationsswaps</b>						3.628.407,17	USD	3.282.632,76	EUR 20/04/2022	3.282.632,76	(23.097,43)
<b>Devisentermingeschäfte</b>						914.333,25	EUR	1.508.513,85	NZD 20/04/2022	914.333,25	(28.034,98)
<b>Zinsswaps</b>						2.340.000,00	GBP	2.790.010,49	EUR 10/06/2022	2.790.010,49	(28.909,45)
<b>Inflationsswaps</b>						2.111.493,66	USD	1.708.350.000,00	CLP 10/06/2022	1.883.076,48	(30.624,26)
<b>Devisentermingeschäfte</b>						1.052.311,62	USD	21.980.000,00	MXN 10/06/2022	938.474,65	(32.608,27)
<b>Zinsswaps</b>						1.179.294,48	EUR	1.690.000,00	CAD 10/06/2022	1.179.294,48	(33.409,49)
<b>Inflationsswaps</b>						1.748.103,47	EUR	18.490.000,00	SEK 10/06/2022	1.748.103,47	(33.477,24)
<b>Devisentermingeschäfte</b>						1.264.654,76	EUR	13.508.225,02	SEK 20/04/2022	1.264.654,76	(37.827,56)
<b>Zinsswaps</b>						4.770.000,00	PLN	1.180.583,25	USD 10/06/2022	1.049.906,53	(39.265,41)
<b>Inflationsswaps</b>						58.920.000,00	TWD	2.109.725,79	USD 10/06/2022	1.872.101,66	(39.929,65)
<b>Devisentermingeschäfte</b>						113.182.874,00	JPY	877.536,67	EUR 10/06/2022	877.536,67	(40.133,98)

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Global Inflation Linked Bond

(ausgedrückt in EUR)

### Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Zu erhalten	Zu zahlen	Fälligkeits- datum	Engagement in EUR	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR
1.840.422,87 EUR	3.020.000,00 NZD	10/06/2022	1.840.422,87	(40.397,86)
4.174.319,29 GBP	4.989.240,23 EUR	20/04/2022	4.989.240,23	(52.419,03)
3.214.057,92 EUR	4.550.900,66 CAD	20/04/2022	3.214.057,92	(58.812,87)
1.817.445,01 EUR	2.789.686,70 AUD	20/04/2022	1.817.445,01	(64.845,78)
2.642.992,01 EUR	4.040.000,00 AUD	10/06/2022	2.642.992,01	(79.811,13)
2.126.352,73 USD	8.421.420.000,00 COP	10/06/2022	1.904.992,59	(85.503,89)
90.062.920,96 EUR	100.640.712,24 USD	20/04/2022	90.062.920,96	(346.435,63)
			<b>234.263.769,88</b>	<b>380.251,91</b>

Stückzahl	Bezeich- nung	Währung	Engagement in EUR	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR
<b>Zins-Futures</b>				
69	AUSTRALIA 10Y BOND FUTURE 15/06/2022	AUD	5.902.358,53	(236.257,51)
(21)	CANADA 10YR BOND FUTURE 21/06/2022	CAD	1.972.836,22	6.560,64
6	EURO-BTP FUTURE 08/06/2022	EUR	829.860,00	(42.930,63)
35	EURO-BUND FUTURE 08/06/2022	EUR	5.553.100,00	(294.786,18)
(32)	EURO-BUXL 30Y BOND 08/06/2022	EUR	5.958.400,00	512.003,14
(98)	EURO-OAT FUTURE 08/06/2022	EUR	14.847.980,00	717.600,41
1	KOREA 10YR BOND FUTURE 21/06/2022	KRW	86.757,44	(1.663,06)
(63)	LONG GILT FUTURE 28/06/2022	GBP	9.037.793,19	76.986,35
(3)	US LONG BOND (CBT) 21/06/2022	USD	404.608,37	(7.667,51)
41	US ULTRA BOND (CBT) 21/06/2022	USD	6.526.872,78	(246.427,45)
(7)	US 10YR NOTE (CBT) 21/06/2022	USD	773.041,84	(9.650,27)
(68)	US 10YR ULTRA FUTURE 21/06/2022	USD	8.279.220,78	274.134,39
			<b>60.172.829,15</b>	<b>747.902,32</b>

**Derivative Finanzinstrumente Gesamt** (132.443,06)

### Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick

		% NIW
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	<b>177.347.267,78</b>	<b>93,41</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	<b>(132.443,06)</b>	<b>(0,07)</b>
<b>Bankguthaben</b>	<b>10.816.545,90</b>	<b>5,70</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>	<b>1.820.907,88</b>	<b>0,96</b>
<b>Nettovermögen Gesamt</b>	<b>189.852.278,50</b>	<b>100,00</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Global Investment Grade Credit

(ausgedrückt in USD)

### Statistische Angaben

<b>Nettovermögen</b>	31.03.2022	USD	85.170.257,83
	30.09.2021	USD	101.191.213,59
	30.09.2020	USD	112.499.245,33
<b>Nettoinventarwert pro Anteil**</b>			
Capitalisation I (EUR)	31.03.2022	EUR	7.408,87
	30.09.2021	EUR	7.706,69
	30.09.2020	EUR	7.429,14
Capitalisation I (USD)	31.03.2022	USD	6.495,93
	30.09.2021	USD	7.038,23
	30.09.2020	USD	6.863,84
Capitalisation Zz (EUR)	31.03.2022	EUR	2.429.834,45
	30.09.2021	EUR	2.521.460,91
	30.09.2020	EUR	2.419.025,50
<b>Anzahl der Anteile</b>			
Capitalisation I (EUR)	31.03.2022		295
	30.09.2021		335
	30.09.2020		393
Capitalisation I (USD)	31.03.2022		70
	30.09.2021		70
	30.09.2020		6
Capitalisation Zz (EUR)	31.03.2022		30
	30.09.2021		33
	30.09.2020		38
<b>Laufende Kosten in %*</b>			
Capitalisation I (EUR)	31.03.2022		0,49%
Capitalisation I (USD)	31.03.2022		0,49%
Capitalisation Zz (EUR)	31.03.2022		0,01%
<b>Portfolioumsatz in %*</b>	31.03.2022		113,41%

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

## NN (L) Global Investment Grade Credit

(ausgedrückt in USD)

### Finanzabschlüsse

#### Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022

	Erläuterungen	
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	2	<b>77.795.251,46</b>
Anleihen und andere Schuldtitel		77.795.251,46
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	2	<b>32.296,86</b>
Devisentermingeschäfte		32.296,86
<b>Bankguthaben</b>		<b>5.291.988,86</b>
<b>Hinterlegte Sicherheiten</b>		<b>529.129,42</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte</b>	4	<b>2.601.344,63</b>
<b>Vermögenswerte Gesamt</b>		<b>86.250.011,23</b>
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>	4, 12	<b>(1.026.602,70)</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	2	<b>(53.150,70)</b>
Futures		(53.150,70)
<b>Verbindlichkeiten Gesamt</b>		<b>(1.079.753,40)</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Berichtszeitraums</b>		<b>85.170.257,83</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.



# NN (L) Global Investment Grade Credit

(ausgedrückt in USD)

## Wertpapierbestand zum 31.03.2022

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW	Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW
<b>Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>									
<b>Anleihen und andere Schuldtitel</b>									
<b>Vereinigte Staaten</b>					<b>Niederlande</b>				
1.000.000	ABBVIE INC 4.050% 21/11/2039	USD	1.031.568,92	1,21	135.000	ALLIANDER NV FRN PERP	EUR	148.679,76	0,17
500.000	AMERICAN TOWER CORP 3.950% 15/03/2029	USD	502.330,29	0,59	1.185.000	ARGENTUM NETHERLANDS BV FOR SWISS RE LTD 15/08/2050 FRN	USD	1.220.184,40	1,44
500.000	AT&T INC 4.850% 01/03/2039	USD	544.420,20	0,64	419.000	EDP FINANCE BV 1.875% 13/10/2025 EMTN	EUR	478.185,93	0,56
2.000.000	BANK OF AMERICA CORP 29/04/2031 FRN	USD	1.847.524,20	2,17	385.000	ELM BV FOR SWISS REINSURANCE CO LTD FRN PERP	EUR	428.607,20	0,50
500.000	BAXTER INTERNATIONAL INC 2.539% 01/02/2032	USD	457.210,52	0,54	450.000	E.ON INTERNATIONAL FINANCE BV 1.250% 19/10/2027 EMTN	EUR	498.092,66	0,58
1.750.000	BOARDWALK PIPELINES LP 4.450% 15/07/2027	USD	1.789.464,62	2,10	300.000	ING GROEP NV 26/05/2031 FRN EMTN	EUR	333.152,96	0,39
1.500.000	BRIXMOR OPERATING PARTNERSHIP LP 4.050% 01/07/2030	USD	1.504.626,50	1,77	300.000	LYB INTERNATIONAL FINANCE II BV 1.625% 17/09/2031	EUR	314.735,47	0,37
500.000	BROADCOM INC 3.187% 15/11/2036	USD	439.363,80	0,52	1.500.000	PROSUS NV 4.193% 19/01/2032	USD	1.315.163,78	1,55
500.000	BROADCOM INC 3.419% 15/04/2033	USD	466.607,40	0,55	200.000	VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV FRN PERP	EUR	223.791,56	0,26
1.500.000	BROWN & BROWN INC 2.375% 15/03/2031	USD	1.320.671,73	1,55	200.000	VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV FRN PERP	EUR	223.905,81	0,26
1.000.000	CDW LLC / CDW FINANCE CORP 3.569% 01/12/2031	USD	929.136,69	1,09	500.000	VONOVIA FINANCE BV 1.000% 09/07/2030 EMTN	EUR	506.925,37	0,60
750.000	CHARTER COMMUNICATIONS OPERATING LLC / CHARTER COMMUNICATIONS OPERATING CAPITAL 4.800% 01/03/2050	USD	714.673,16	0,84				<b>5.913.503,08</b>	<b>6,94</b>
1.500.000	CITIGROUP INC 31/03/2031 FRN	USD	1.561.917,09	1,83	<b>Australien</b>				
1.500.000	CITIZENS FINANCIAL GROUP INC 3.250% 30/04/2030	USD	1.464.698,33	1,72	700.000	AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP LTD/UNITED KINGDOM FRN PERP	USD	751.334,65	0,88
1.200.000	DAE FUNDING LLC 3.375% 20/03/2028	USD	1.126.203,19	1,32	200.000	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA 12/09/2034 FRN EMTN	USD	191.613,66	0,22
1.500.000	DELL INTERNATIONAL LLC / EMC CORP 5.300% 01/10/2029	USD	1.633.890,78	1,92	800.000	QBE INSURANCE GROUP LTD 17/06/2046 FRN EMTN	USD	826.460,82	0,98
1.000.000	DIAMONDBACK ENERGY INC 3.125% 24/03/2031	USD	955.292,16	1,12	200.000	SANTOS FINANCE LTD 3.649% 29/04/2031	USD	187.709,99	0,22
650.000	DOMINION ENERGY INC 6.300% 15/03/2033	USD	779.362,40	0,92	500.000	SANTOS FINANCE LTD 5.250% 13/03/2029 EMTN	USD	521.369,25	0,61
1.000.000	EQUINIX INC 3.200% 18/11/2029	USD	960.747,71	1,13	600.000	SCENTRE GROUP TRUST 2 24/09/2080 FRN	USD	589.671,62	0,69
1.750.000	FREEMPORT-MCMORAN INC 4.625% 01/08/2030	USD	1.789.113,74	2,10	600.000	WESTPAC BANKING CORP 24/07/2034 FRN	USD	592.148,73	0,70
1.500.000	FULTON FINANCIAL CORP 15/03/2030 FRN	USD	1.458.669,57	1,71				<b>3.660.308,72</b>	<b>4,30</b>
2.000.000	GOLDMAN SACHS GROUP INC 27/01/2032 FRN	USD	1.732.127,68	2,03	<b>Deutschland</b>				
250.000	HCA INC 4.625% 15/03/2052	USD	253.686,09	0,30	800.000	MERCK KGAA 09/09/2080 FRN	EUR	868.059,13	1,03
2.000.000	JPMORGAN CHASE & CO 13/05/2031 FRN	USD	1.875.092,38	2,19	400.000	MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS-GESELLSCHAFT AG IN MUENCHEN 26/05/2049 FRN	EUR	460.618,33	0,54
1.250.000	LENNAR CORP 4.750% 29/11/2027	USD	1.303.387,68	1,53	325.000	SYMRISE AG 1.250% 29/11/2025	EUR	357.332,66	0,42
1.000.000	MARSH & MCLENNAN COS INC 2.375% 15/12/2031	USD	916.763,86	1,08	300.000	VOLKSWAGEN BANK GMBH 1.250% 10/06/2024 EMTN	EUR	335.165,61	0,39
375.000	MERCK & CO INC 1.700% 10/06/2027	USD	355.275,11	0,42	148.000	VOLKSWAGEN FINANCIAL SERVICES AG 2.250% 16/10/2026 EMTN	EUR	167.523,23	0,20
875.000	MERCK & CO INC 2.150% 10/12/2031	USD	810.777,46	0,95	622.000	VOLKSWAGEN LEASING GMBH 1.125% 04/04/2024 EMTN	EUR	693.689,99	0,81
1.000.000	MORGAN STANLEY 22/07/2028 FRN	USD	1.003.996,24	1,18	453.000	VOLKSWAGEN LEASING GMBH 1.625% 15/08/2025 EMTN	EUR	503.404,54	0,59
750.000	MPLX LP 4.700% 15/04/2048	USD	756.081,10	0,89				<b>3.385.793,49</b>	<b>3,98</b>
500.000	PLAINS ALL AMERICAN PIPELINE LP / PAA FINANCE CORP 4.900% 15/02/2045	USD	478.586,66	0,56	<b>Vereinigtes Königreich</b>				
1.000.000	PRUDENTIAL FINANCIAL INC 01/10/2050 FRN	USD	915.340,23	1,07	750.000	ANGLO AMERICAN CAPITAL PLC 4.750% 16/03/2052	USD	783.283,94	0,93
1.500.000	SAMMONS FINANCIAL GROUP INC 4.450% 12/05/2027	USD	1.542.207,20	1,81	250.000	CADENT FINANCE PLC 2.750% 22/09/2046 EMTN	GBP	288.867,13	0,34
1.313.000	S&P GLOBAL INC 2.900% 01/03/2032	USD	1.274.177,60	1,50	700.000	LLOYDS BANKING GROUP PLC 07/09/2028 FRN EMTN	EUR	785.642,91	0,93
380.000	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC 2.875% 24/07/2037	EUR	457.225,81	0,54	185.000	SANTANDER UK GROUP HOLDINGS PLC 1.125% 08/09/2023	EUR	207.869,07	0,24
1.500.000	T-MOBILE USA INC 3.000% 15/02/2041	USD	1.267.309,76	1,49	400.000	STANDARD CHARTERED PLC 21/05/2025 FRN	USD	400.808,08	0,47
1.313.000	VALLEY NATIONAL BANCORP 15/06/2031 FRN	USD	1.254.770,01	1,47	141.000	TESCO CORPORATE TREASURY SERVICES PLC 2.750% 27/04/2030 EMTN	GBP	179.615,53	0,21
1.000.000	VMWARE INC 4.700% 15/05/2030	USD	1.056.929,80	1,24				<b>2.646.086,66</b>	<b>3,12</b>
606.000	WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC 4.100% 15/04/2050	USD	586.489,41	0,69	<b>Japan</b>				
1.350.000	WEBSTER FINANCIAL CORP 4.375% 15/02/2024	USD	1.375.174,45	1,61	400.000	ASAHI MUTUAL LIFE INSURANCE CO FRN PERP	USD	372.671,00	0,44
750.000	WORKDAY INC 3.500% 01/04/2027	USD	752.232,89	0,88					
			<b>43.245.124,42</b>	<b>50,77</b>					
<b>Frankreich</b>									
500.000	BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL SA 1.250% 03/06/2030	EUR	531.420,02	0,62					
1.200.000	BNP PARIBAS SA 23/01/2027 FRN EMTN	EUR	1.362.797,53	1,60					
1.000.000	BNP PARIBAS SA 2.375% 17/02/2025 EMTN	EUR	1.145.514,66	1,34					
500.000	ELO SACA 3.250% 23/07/2027 EMTN	EUR	558.152,53	0,66					

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Global Investment Grade Credit

(ausgedrückt in USD)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW
300.000	FUKOKU MUTUAL LIFE INSURANCE CO FRN PERP	USD	307.490,16	0,36
305.000	MIZUHO FINANCIAL GROUP INC 2.564% 13/09/2031	USD	266.948,03	0,31
600.000	NIPPON LIFE INSURANCE CO 16/09/2051 FRN	USD	543.966,37	0,64
250.000	NIPPON LIFE INSURANCE 21/01/2051 FRN	USD	225.431,45	0,26
450.000	SUMITOMO LIFE INSURANCE CO 15/04/2081 FRN	USD	433.187,40	0,51
			<b>2.149.694,41</b>	<b>2,52</b>
<b>Kanada</b>				
1.000.000	CANADIAN PACIFIC RAILWAY CO 3.000% 02/12/2041	USD	902.650,52	1,06
1.000.000	TECK RESOURCES LTD 3.900% 15/07/2030	USD	998.373,62	1,17
			<b>1.901.024,14</b>	<b>2,23</b>
<b>Schweiz</b>				
1.500.000	CREDIT SUISSE GROUP AG 14/01/2028 FRN EMTN	EUR	1.533.774,57	1,80
			<b>1.533.774,57</b>	<b>1,80</b>
<b>Italien</b>				
900.000	ENI SPA 4.250% 09/05/2029	USD	928.633,91	1,09
450.000	INTESA SANPAOLO SPA 4.000% 23/09/2029	USD	436.337,07	0,51
			<b>1.364.970,98</b>	<b>1,60</b>
<b>Luxemburg</b>				
680.000	CNH INDUSTRIAL FINANCE EUROPE SA 1.875% 19/01/2026 EMTN	EUR	767.413,55	0,90
200.000	HEIDELBERGCEMENT FINANCE LUXEMBOURG SA 1.750% 24/04/2028 EMTN	EUR	221.182,62	0,26
			<b>988.596,17</b>	<b>1,16</b>
<b>Spanien</b>				
400.000	ABERTIS INFRASTRUCTURAS SA 1.875% 26/03/2032	EUR	428.576,33	0,50
500.000	CAIXABANK SA 17/04/2030 FRN EMTN	EUR	553.526,96	0,65
			<b>982.103,29</b>	<b>1,15</b>
<b>Südkorea</b>				
300.000	HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD 04/02/2032 FRN	USD	286.736,32	0,34
500.000	HEUNGKUK LIFE INSURANCE CO LTD FRN PERP	USD	497.500,00	0,58
			<b>784.236,32</b>	<b>0,92</b>
<b>Belgien</b>				
600.000	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV 2.750% 17/03/2036 EMTN	EUR	719.022,92	0,84
			<b>719.022,92</b>	<b>0,84</b>
<b>Portugal</b>				
600.000	BRISA-CONCESSAO RODOVIARIA SA 2.375% 10/05/2027 EMTN	EUR	694.291,81	0,82
			<b>694.291,81</b>	<b>0,82</b>
<b>Dänemark</b>				
500.000	CARLSBERG BREWERIES AS 0.875% 01/07/2029 EMTN	EUR	517.956,64	0,61
			<b>517.956,64</b>	<b>0,61</b>
<b>Jungfernseln</b>				
200.000	CLP POWER HK FINANCE LTD FRN PERP	USD	199.239,73	0,23
205.000	DIANJIANG INTERNATIONAL FINANCE LTD FRN PERP	USD	207.175,57	0,25
			<b>406.415,30</b>	<b>0,48</b>
<b>Indien</b>				
450.000	RELIANCE INDUSTRIES LTD 3.625% 12/01/2052	USD	399.682,91	0,47
			<b>399.682,91</b>	<b>0,47</b>

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW
<b>Irland</b>				
250.000	ZURICH FINANCE IRELAND DESIGNATED ACTIVITY CO 17/09/2050 FRN EMTN	EUR	262.087,40	0,31
			<b>262.087,40</b>	<b>0,31</b>
<b>Bermuda</b>				
200.000	STAR ENERGY GEOTHERMAL DARAJAT II / STAR ENERGY GEOTHERMAL SALAK 4.850% 14/10/2038	USD	198.541,27	0,23
			<b>198.541,27</b>	<b>0,23</b>
<b>Thailand</b>				
200.000	MUANG THAI LIFE ASSURANCE PCL 27/01/2037 FRN	USD	188.511,53	0,22
			<b>188.511,53</b>	<b>0,22</b>
<b>Schweden</b>				
145.000	FASTIGHETS AB BALDER 1.875% 14/03/2025	EUR	162.100,53	0,19
			<b>162.100,53</b>	<b>0,19</b>
			<b>77.795.251,46</b>	<b>91,34</b>

### Wertpapierbestand Gesamt

**77.795.251,46 91,34**

### Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022

Zu erhalten	Zu zahlen	Fälligkeits- datum	Engagement in USD	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in USD	
<b>Devisentermingeschäfte</b>					
2.566.967,24	GBP	3.361.844,05	USD 30/06/2022	3.361.844,05	17.047,08
93.360.002,00	JPY	757.875,09	USD 30/06/2022	757.875,09	13.246,78
342.000,00	CHF	366.967,08	USD 30/06/2022	366.967,08	6.140,38
480.000,00	AUD	360.510,58	USD 30/06/2022	360.510,58	524,14
193.986,18	EUR	216.619,61	USD 30/06/2022	216.619,61	(12,98)
3.841.823,81	CAD	3.077.015,59	USD 30/06/2022	3.077.015,59	(1.930,44)
369.696,76	USD	333.523,20	EUR 30/06/2022	369.696,76	(2.718,10)
			<b>8.510.528,76</b>	<b>32.296,86</b>	
Stückzahl	Bezeichnung	Währung	Engagement in USD	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in USD	
<b>Zins-Futures</b>					
20	CANADA 10YR BOND FUTURE 21/06/2022	CAD	2.090.548,82	(83.103,16)	
(17)	EURO-BOBL FUTURE 08/06/2022	EUR	2.437.393,30	77.173,40	
12	EURO-BUND FUTURE 08/06/2022	EUR	2.118.396,55	(83.988,71)	
(1)	EURO-BUXL 30Y BOND 08/06/2022	EUR	207.175,43	13.040,26	
7	EURO-SCHATZ FUTURE 08/06/2022	EUR	862.465,07	(9.813,57)	
1	JPN 10Y BOND (OSE) 13/06/2022	JPY	1.233.367,66	(7.744,59)	

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Global Investment Grade Credit

(ausgedrückt in USD)

### Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl	Bezeichnung	Währung	Engagement in USD	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in USD
19	LONG GILT FUTURE 28/06/2022	GBP	3.032.732,00	(25.266,51)
8	US LONG BOND (CBT) 21/06/2022	USD	1.200.500,00	(35.250,00)
33	US ULTRA BOND (CBT) 21/06/2022	USD	5.845.125,00	(217.468,75)
(144)	US 10YR NOTE (CBT) 21/06/2022	USD	17.694.000,00	462.645,92
(3)	US 10YR ULTRA FUTURE 21/06/2022	USD	406.406,25	12.796,88
10	US 2YR NOTE (CBT) 30/06/2022	USD	2.119.218,76	(26.796,87)
46	US 5YR NOTE (CBT) 30/06/2022	USD	5.275.625,00	(129.375,00)
			<b>44.522.953,84</b>	<b>(53.150,70)</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>				<b>(20.853,84)</b>

### Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick

		% NIW
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	<b>77.795.251,46</b>	<b>91,34</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	<b>(20.853,84)</b>	<b>(0,02)</b>
<b>Bankguthaben</b>	<b>5.291.988,86</b>	<b>6,21</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>	<b>2.103.871,35</b>	<b>2,47</b>
<b>Nettovermögen Gesamt</b>	<b>85.170.257,83</b>	<b>100,00</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Global Real Estate

(ausgedrückt in EUR)

### Statistische Angaben

<b>Nettovermögen</b>	31.03.2022	EUR	233.868.154,22	Distribution R (EUR)	31.03.2022	EUR	28,53
	30.09.2021	EUR	170.480.372,51		30.09.2021	EUR	27,05
	30.09.2020	EUR	321.435.331,84		30.09.2020	EUR	22,29
<b>Nettoinventarwert pro Anteil**</b>	<b>Anzahl der Anteile</b>						
	Capitalisation I (EUR)						
	31.03.2022	EUR	10.279,44	31.03.2022			2.212
30.09.2021	EUR	9.365,57	30.09.2021			2.124	
30.09.2020	EUR	7.398,97	30.09.2020			2.128	
Capitalisation I (GBP)							
31.03.2022	GBP	192,55	31.03.2022			264	
30.09.2021	GBP	178,44	30.09.2021			264	
30.09.2020	GBP	148,77	30.09.2020			264	
Capitalisation I (USD)							
31.03.2022	USD	7.422,03	31.03.2022			1.758	
30.09.2021	USD	7.043,58	30.09.2021			1.444	
30.09.2020	USD	5.630,32	30.09.2020			393	
Capitalisation M (EUR)							
31.03.2022	EUR	444,38	31.03.2022			61.854	
30.09.2021	EUR	406,11	30.09.2021			68.807	
30.09.2020	EUR	322,78	30.09.2020			838.352	
Capitalisation P (EUR)							
31.03.2022	EUR	438,21	31.03.2022			8.456	
30.09.2021	EUR	401,06	30.09.2021			11.537	
30.09.2020	EUR	319,74	30.09.2020			15.179	
Capitalisation P (GBP)							
31.03.2022	GBP	169,17	31.03.2022			29	
30.09.2021	GBP	157,49	30.09.2021			29	
30.09.2020	GBP	133,06	30.09.2020			275	
Capitalisation P (SGD)							
31.03.2022	SGD	18,17	31.03.2022			70.158	
30.09.2021	SGD	17,38	30.09.2021			72.983	
30.09.2020	SGD	14,09	30.09.2020			71.529	
Capitalisation P (USD)							
31.03.2022	USD	490,88	31.03.2022			3.484	
30.09.2021	USD	467,97	30.09.2021			3.491	
30.09.2020	USD	377,49	30.09.2020			3.749	
Capitalisation R (EUR)							
31.03.2022	EUR	335,75	31.03.2022			4.119	
30.09.2021	EUR	306,30	30.09.2021			4.383	
30.09.2020	EUR	242,61	30.09.2020			6.263	
Capitalisation R (USD)							
31.03.2022	USD	307,68	31.03.2022			766	
30.09.2021	USD	292,37	30.09.2021			766	
30.09.2020	USD	234,32	30.09.2020			807	
Capitalisation X (EUR)							
31.03.2022	EUR	1.627,60	31.03.2022			1.032	
30.09.2021	EUR	1.493,37	30.09.2021			948	
30.09.2020	EUR	1.196,51	30.09.2020			1.213	
Capitalisation Zz (EUR)							
31.03.2022	EUR	6.344,94	31.03.2022			25.092	
30.09.2021	EUR	5.761,31	30.09.2021			17.490	
30.09.2020	EUR	4.520,78	30.09.2020			4.516	
Distribution P (EUR)							
31.03.2022	EUR	278,85	31.03.2022			1.089	
30.09.2021	EUR	265,07	30.09.2021			1.707	
30.09.2020	EUR	219,60	30.09.2020			1.877	

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

## NN (L) Global Real Estate

(ausgedrückt in EUR)

### Statistische Angaben (Fortsetzung)

#### Anzahl der Anteile

Distribution R (EUR)	31.03.2022	104.097
	30.09.2021	103.398
	30.09.2020	110.653

#### Dividende

Distribution P (EUR)	14.12.2021	EUR	10,60
Distribution R (EUR)	14.12.2021	EUR	1,10

#### Laufende Kosten in %\*

Capitalisation I (EUR)	31.03.2022	0,69%
Capitalisation I (GBP)	31.03.2022	0,69%
Capitalisation I (USD)	31.03.2022	0,69%
Capitalisation M (EUR)	31.03.2022	1,30%
Capitalisation P (EUR)	31.03.2022	1,60%
Capitalisation P (GBP)	31.03.2022	1,60%
Capitalisation P (SGD)	31.03.2022	1,60%
Capitalisation P (USD)	31.03.2022	1,60%
Capitalisation R (EUR)	31.03.2022	0,95%
Capitalisation R (USD)	31.03.2022	0,95%
Capitalisation X (EUR)	31.03.2022	2,10%
Capitalisation Zz (EUR)	31.03.2022	0,01%
Distribution P (EUR)	31.03.2022	1,60%
Distribution R (EUR)	31.03.2022	0,95%
<b>Portfolioumsatz in %*</b>	31.03.2022	199,22%

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

## NN (L) Global Real Estate

(ausgedrückt in EUR)

### Finanzabschlüsse

#### Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022

	Erläuterungen	
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	2	<b>230.773.002,92</b>
Aktien		230.773.002,92
<b>Bankguthaben</b>		<b>2.339.720,60</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte</b>	4	<b>927.149,27</b>
<b>Vermögenswerte Gesamt</b>		<b>234.039.872,79</b>
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>	4	<b>(171.718,57)</b>
<b>Verbindlichkeiten Gesamt</b>		<b>(171.718,57)</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Berichtszeitraums</b>		<b>233.868.154,22</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Global Real Estate

(ausgedrückt in EUR)

## Wertpapierbestand zum 31.03.2022

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW	Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
<b>Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>									
<b>Aktien</b>									
<b>Vereinigte Staaten</b>									
26.900	AMERICAN ASSETS TRUST INC	USD	916.048,17	0,39					
76.700	AMERICAN HOMES 4 RENT - A	USD	2.759.449,06	1,18					
592	AMERICAN TOWER CORP	USD	133.664,89	0,06					
18.700	APARTMENT INCOME REIT CORP	USD	898.487,39	0,38					
36.700	AVALONBAY COMMUNITIES INC	USD	8.192.314,74	3,50					
4.877	BOSTON PROPERTIES INC	USD	564.559,92	0,24					
236.687	BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	USD	5.490.398,12	2,35					
1.209	CBRE GROUP INC - A	USD	99.445,18	0,04					
600	CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	USD	99.546,13	0,04					
31.047	CUBESMART	USD	1.451.827,09	0,62					
41.551	DIGITAL REALTY TRUST INC	USD	5.295.404,48	2,26					
21.400	DUKE REALTY CORP	USD	1.116.688,99	0,48					
5.800	EASTGROUP PROPERTIES INC	USD	1.059.653,98	0,45					
145	EQUINIX INC	USD	96.647,55	0,04					
3.024	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES INC	USD	207.860,08	0,09					
120.900	EQUITY RESIDENTIAL	USD	9.770.662,83	4,18					
21.282	ESSEX PROPERTY TRUST INC	USD	6.608.102,60	2,83					
29.775	EXTRA SPACE STORAGE INC	USD	5.501.945,81	2,35					
62.400	FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST	USD	6.845.969,53	2,93					
66.713	GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	USD	2.813.859,79	1,20					
41.200	HEALTHCARE REALTY TRUST INC	USD	1.017.549,09	0,44					
212.295	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	USD	6.550.206,58	2,80					
118.964	HIGHWOODS PROPERTIES INC	USD	4.890.498,68	2,09					
1.600	HOWARD HUGHES CORP/THE	USD	148.992,05	0,06					
87.100	INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES TRUST	USD	1.774.643,42	0,76					
191.034	INVITATION HOMES INC	USD	6.898.616,92	2,95					
2.600	IRON MOUNTAIN INC	USD	129.480,07	0,06					
27.100	KILROY REALTY CORP	USD	1.861.305,89	0,80					
18.500	KIMCO REALTY CORP	USD	410.686,20	0,18					
273.400	KITE REALTY GROUP TRUST	USD	5.595.037,07	2,40					
995	LAMAR ADVERTISING CO - A	USD	103.895,30	0,04					
92.400	NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUST	USD	5.211.903,11	2,23					
2.269	ORION OFFICE REIT INC	USD	28.549,86	0,01					
2.700	POTLATCHDELTIC CORP	USD	127.956,68	0,05					
149.986	PROLOGIS INC	USD	21.767.617,20	9,31					
12.500	PUBLIC STORAGE	USD	4.384.577,36	1,87					
28.400	REGENCY CENTERS CORP	USD	1.820.928,41	0,78					
19.000	SIMON PROPERTY GROUP INC	USD	2.246.564,51	0,96					
50.100	SPIRIT REALTY CAPITAL INC	USD	2.072.171,84	0,89					
167.378	VENTAS INC	USD	9.290.671,17	3,97					
2.000	VORNADO REALTY TRUST	USD	81.463,17	0,03					
22.000	WELLTOWER INC	USD	1.900.939,20	0,81					
3.400	WEYERHAEUSER CO	USD	115.813,60	0,05					
61.681	WP CAREY INC	USD	4.481.456,02	1,92					
			<b>142.834.059,73</b>	<b>61,07</b>					
<b>Japan</b>									
152	ACTIVIA PROPERTIES INC	JPY	477.223,28	0,20					
133.300	DAIWA HOUSE INDUSTRY CO LTD	JPY	3.159.570,14	1,35					
663	GLP J-REIT	JPY	910.197,08	0,39					
318.500	HULIC CO LTD	JPY	2.596.623,20	1,12					
400	INVINCIBLE INVESTMENT CORP	JPY	124.992,69	0,05					
2.392	JAPAN HOTEL REIT INVESTMENT CORP - A	JPY	1.103.472,21	0,47					
					98	JAPAN METROPOLITAN FUND INVEST	JPY	74.743,85	0,03
					111	JAPAN REAL ESTATE INVESTMENT CORP	JPY	525.213,66	0,22
					319	KENEDIX OFFICE INVESTMENT CORP - A	JPY	1.726.713,31	0,74
					226.800	MITSUBISHI ESTATE CO LTD	JPY	3.054.836,19	1,31
					1.335	NIPPON BUILDING FUND INC	JPY	6.840.684,14	2,93
					4.900	NOMURA REAL ESTATE HOLDINGS INC	JPY	106.419,28	0,05
					1.370	NOMURA REAL ESTATE MASTER FUND INC	JPY	1.635.301,30	0,70
					392	NTT UD REIT INVESTMENT CORP	JPY	467.620,76	0,20
					827	SEKISUI HOUSE REIT INC	JPY	494.186,89	0,21
					238.500	TOKYO TATEMONO CO LTD	JPY	3.238.917,55	1,38
					19.900	TOKYU FUDOSAN HOLDINGS CORP	JPY	99.317,36	0,04
								<b>26.636.032,89</b>	<b>11,39</b>
<b>Vereinigtes Königreich</b>									
					631.621	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	GBP	2.061.401,40	0,88
					247.800	SEGRO PLC	GBP	3.945.451,86	1,69
					1.179.553	TRITAX BIG BOX REIT PLC	GBP	3.375.091,10	1,44
								<b>9.381.944,36</b>	<b>4,01</b>
<b>Deutschland</b>									
					59.323	LEG IMMOBILIEN SE	EUR	6.125.099,75	2,62
					53.954	VONOVIA SE	EUR	2.282.793,74	0,98
								<b>8.407.893,49</b>	<b>3,60</b>
<b>Australien</b>									
					263.900	CHARTER HALL LONG WALE REIT	AUD	947.552,85	0,41
					746.177	DEXUS	AUD	5.514.528,66	2,35
					189.500	MIRVAC GROUP	AUD	318.464,47	0,14
					449.100	STOCKLAND	AUD	1.294.265,43	0,55
								<b>8.074.811,41</b>	<b>3,45</b>
<b>Singapur</b>									
					213.100	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	SGD	318.417,74	0,14
					463.100	CITY DEVELOPMENTS LTD	SGD	2.420.364,64	1,03
					1.947.600	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	SGD	2.444.515,84	1,04
					1.868.500	SUNTEC REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	SGD	2.171.513,01	0,93
								<b>7.354.811,23</b>	<b>3,14</b>
<b>Hongkong</b>									
					196.000	HANG LUNG PROPERTIES LTD	HKD	355.398,16	0,15
					661.700	LINK REIT	HKD	5.087.892,85	2,18
					554.762	SINO LAND CO LTD	HKD	646.848,29	0,28
					549.200	SWIRE PROPERTIES LTD	HKD	1.226.522,12	0,52
								<b>7.316.661,42</b>	<b>3,13</b>
<b>Kanada</b>									
					69.400	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	CAD	805.980,62	0,34
					194.600	FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	CAD	2.513.442,10	1,07
					81.300	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	CAD	1.253.059,26	0,54
					17.400	PRIMARIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	CAD	193.937,71	0,08
					80.800	RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	CAD	1.466.865,21	0,63
					18.900	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	CAD	299.461,31	0,13
								<b>6.532.746,21</b>	<b>2,79</b>
<b>Schweden</b>									
					91.684	CASTELLUM AB	SEK	2.062.821,99	0,89
					43.100	FABEGE AB	SEK	579.835,68	0,25
					9.500	FASTIGHETS AB BALDER - B	SEK	569.309,35	0,24

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Global Real Estate

(ausgedrückt in EUR)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
88.700	NYFOSA AB	SEK	1.153.100,00	0,49
			<b>4.365.067,02</b>	<b>1,87</b>
<b>Frankreich</b>				
22.500	COVIVIO	EUR	1.623.150,00	0,70
6.500	GECINA SA	EUR	742.950,00	0,32
21.400	ICADE	EUR	1.248.690,00	0,53
			<b>3.614.790,00</b>	<b>1,55</b>
<b>Belgien</b>				
18.644	COFINIMMO SA	EUR	2.461.008,00	1,05
			<b>2.461.008,00</b>	<b>1,05</b>
<b>Schweiz</b>				
3.843	PSP SWISS PROPERTY AG - REG	CHF	456.393,61	0,20
14.973	SWISS PRIME SITE AG - REG	CHF	1.334.373,14	0,57
			<b>1.790.766,75</b>	<b>0,77</b>
<b>Mexiko</b>				
551.000	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA DE CV	MXN	578.602,40	0,25
			<b>578.602,40</b>	<b>0,25</b>
<b>Brasilien</b>				
122.300	MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS IMOBILIARIOS SA	BRL	566.248,98	0,24
			<b>566.248,98</b>	<b>0,24</b>
<b>Südafrika</b>				
514.600	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	ZAR	465.901,90	0,20
			<b>465.901,90</b>	<b>0,20</b>
<b>Insel Man</b>				
39.900	NEPI ROCKCASTLE PLC	ZAR	238.218,13	0,10
			<b>238.218,13</b>	<b>0,10</b>
<b>Spanien</b>				
8.200	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	EUR	86.797,00	0,04
			<b>86.797,00</b>	<b>0,04</b>
<b>Österreich</b>				
2.900	IMMOFINANZ AG	EUR	66.642,00	0,03
			<b>66.642,00</b>	<b>0,03</b>
			<b>230.773.002,92</b>	<b>98,68</b>
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>			<b>230.773.002,92</b>	<b>98,68</b>

### Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick

		% NIW
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	<b>230.773.002,92</b>	<b>98,68</b>
<b>Bankguthaben</b>	<b>2.339.720,60</b>	<b>1,00</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>	<b>755.430,70</b>	<b>0,32</b>
<b>Nettovermögen Gesamt</b>	<b>233.868.154,22</b>	<b>100,00</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.



## NN (L) Global Sustainable Equity

(ausgedrückt in EUR)

### Statistische Angaben

<b>Nettovermögen</b>	31.03.2022	EUR	2.355.408.832,00	Capitalisation X Hedged (i) (CZK)	31.03.2022	CZK	27.584,49
	30.09.2021	EUR	2.359.878.861,35		30.09.2021	CZK	27.256,86
	30.09.2020	EUR	2.331.142.699,74		30.09.2020	CZK	20.982,80
<b>Nettoinventarwert pro Anteil**</b>				Capitalisation Z (EUR)	31.03.2022	EUR	19.750,20
					30.09.2021	EUR	19.575,40
					30.09.2020	EUR	14.817,97
Capitalisation I (EUR)	31.03.2022	EUR	679,73	Capitalisation Zz (EUR)	31.03.2022	EUR	11.780,44
	30.09.2021	EUR	675,73		30.09.2021	EUR	11.664,54
	30.09.2020	EUR	514,58		30.09.2020	EUR	8.811,50
Capitalisation I (USD)	31.03.2022	USD	8.291,16	Distribution P (EUR)	31.03.2022	EUR	2.030,73
	30.09.2021	USD	8.585,45		30.09.2021	EUR	2.028,79
	30.09.2020	USD	6.615,43		30.09.2020	EUR	1.560,37
Capitalisation I Hedged (ii) (EUR)	31.03.2022	EUR	8.595,41	Distribution R (EUR)	31.03.2022	EUR	40,18
	30.09.2021	EUR	8.866,95		30.09.2021	EUR	39,99
	30.09.2020	EUR	6.893,35		30.09.2020	EUR	30,53
Capitalisation M (EUR)	31.03.2022	EUR	599,10	Distribution T (EUR)	31.03.2022	EUR	40,59
	30.09.2021	EUR	597,01		30.09.2021	EUR	40,33
	30.09.2020	EUR	456,80		30.09.2020	EUR	30,68
Capitalisation N (EUR)	31.03.2022	EUR	71,98	<b>Anzahl der Anteile</b>	Capitalisation I (EUR)	31.03.2022	1.065.303
	30.09.2021	EUR	71,53			30.09.2021	1.038.727
	30.09.2020	EUR	54,43			30.09.2020	1.674.206
Capitalisation O (EUR)	31.03.2022	EUR	72,00	Capitalisation I (USD)	31.03.2022	6.066	
	30.09.2021	EUR	71,53		30.09.2021	2.644	
	30.09.2020	EUR	54,43		30.09.2020	1.677	
Capitalisation P (EUR)	31.03.2022	EUR	586,19	Capitalisation I Hedged (ii) (EUR)	31.03.2022	4.444	
	30.09.2021	EUR	585,63		30.09.2021	4.633	
	30.09.2020	EUR	450,42		30.09.2020	6.105	
Capitalisation P (USD)	31.03.2022	USD	107,02	Capitalisation M (EUR)	31.03.2022	95.879	
	30.09.2021	USD	111,37		30.09.2021	101.584	
	30.09.2020	USD	-		30.09.2020	385.490	
Capitalisation R (EUR)	31.03.2022	EUR	469,36	Capitalisation N (EUR)	31.03.2022	9.946.088	
	30.09.2021	EUR	467,16		30.09.2021	10.800.224	
	30.09.2020	EUR	356,61		30.09.2020	13.479.989	
Capitalisation R (USD)	31.03.2022	USD	410,10	Capitalisation O (EUR)	31.03.2022	52.026	
	30.09.2021	USD	425,20		30.09.2021	248.141	
	30.09.2020	USD	328,47		30.09.2020	283.547	
Capitalisation V (EUR)	31.03.2022	EUR	501,55	Capitalisation P (EUR)	31.03.2022	562.773	
	30.09.2021	EUR	500,85		30.09.2021	567.277	
	30.09.2020	EUR	384,85		30.09.2020	361.893	
Capitalisation X (EUR)	31.03.2022	EUR	528,10	Capitalisation P (USD)	31.03.2022	35.880	
	30.09.2021	EUR	528,93		30.09.2021	14.507	
	30.09.2020	EUR	408,85		30.09.2020	-	
Capitalisation X (USD)	31.03.2022	USD	383,93				
	30.09.2021	USD	400,53				
	30.09.2020	USD	313,28				

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

## NN (L) Global Sustainable Equity

(ausgedrückt in EUR)

### Statistische Angaben (Fortsetzung)

Anzahl der Anteile			Laufende Kosten in %*		
Capitalisation R (EUR)	31.03.2022	84.991	Capitalisation I (EUR)	31.03.2022	0,81%
	30.09.2021	83.703	Capitalisation I (USD)	31.03.2022	0,81%
	30.09.2020	74.212	Capitalisation I Hedged (ii) (EUR)	31.03.2022	0,83%
Capitalisation R (USD)	31.03.2022	38.366	Capitalisation M (EUR)	31.03.2022	1,29%
	30.09.2021	11.067	Capitalisation N (EUR)	31.03.2022	0,73%
	30.09.2020	399	Capitalisation O (EUR)	31.03.2022	0,72%
Capitalisation V (EUR)	31.03.2022	2.254	Capitalisation P (EUR)	31.03.2022	1,80%
	30.09.2021	2.940	Capitalisation P (USD)	31.03.2022	1,80%
	30.09.2020	6.397	Capitalisation R (EUR)	31.03.2022	1,05%
Capitalisation X (EUR)	31.03.2022	89.502	Capitalisation R (USD)	31.03.2022	1,05%
	30.09.2021	74.890	Capitalisation V (EUR)	31.03.2022	1,71%
	30.09.2020	44.107	Capitalisation X (EUR)	31.03.2022	2,30%
Capitalisation X (USD)	31.03.2022	88.647	Capitalisation X (USD)	31.03.2022	2,30%
	30.09.2021	63.328	Capitalisation X Hedged (i) (CZK)	31.03.2022	2,32%
	30.09.2020	14.168	Capitalisation Z (EUR)	31.03.2022	0,21%
Capitalisation X Hedged (i) (CZK)	31.03.2022	33.758	Capitalisation Zz (EUR)	31.03.2022	0,01%
	30.09.2021	29.961	Distribution P (EUR)	31.03.2022	1,80%
	30.09.2020	28.784	Distribution R (EUR)	31.03.2022	1,05%
Capitalisation Z (EUR)	31.03.2022	7.791	Distribution T (EUR)	31.03.2022	0,70%
	30.09.2021	8.190			
	30.09.2020	10.305			
Capitalisation Zz (EUR)	31.03.2022	770	<b>Portfolioumsatz in %*</b>	31.03.2022	(6,05%)
	30.09.2021	733			
	30.09.2020	3.299			
Distribution P (EUR)	31.03.2022	29.576			
	30.09.2021	30.927			
	30.09.2020	24.938			
Distribution R (EUR)	31.03.2022	1.000.276			
	30.09.2021	964.026			
	30.09.2020	1.049.256			
Distribution T (EUR)	31.03.2022	76.281			
	30.09.2021	105.230			
	30.09.2020	130.303			

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

## NN (L) Global Sustainable Equity

(ausgedrückt in EUR)

### Finanzabschlüsse

#### Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022

	Erläuterungen	
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	2	<b>2.350.037.385,91</b>
Aktien		2.350.037.385,91
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	2	<b>1.212.699,73</b>
Devisentermingeschäfte		1.212.699,73
<b>Bankguthaben</b>		<b>4.624.101,45</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte</b>	4	<b>17.115.610,43</b>
<b>Vermögenswerte Gesamt</b>		<b>2.372.989.797,52</b>
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>	4, 12	<b>(17.580.965,52)</b>
<b>Verbindlichkeiten Gesamt</b>		<b>(17.580.965,52)</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Berichtszeitraums</b>		<b>2.355.408.832,00</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Global Sustainable Equity

(ausgedrückt in EUR)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW	Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
<b>Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>									
<b>Aktien</b>									
<b>Vereinigte Staaten</b>									
122.747	ADOBE INC	USD	50.263.774,00	2,13					
45.907	ALIGN TECHNOLOGY INC	USD	17.988.992,05	0,76					
38.284	ALPHABET INC - A	USD	95.700.537,82	4,06					
7.941	ALPHABET INC - C	USD	19.933.612,18	0,85					
143.974	ANTHEM INC	USD	63.562.583,27	2,70					
412.260	APPLE INC	USD	64.696.641,89	2,75					
986.711	BROWN & BROWN INC	USD	64.089.879,09	2,73					
937.397	COMCAST CORP - A	USD	39.445.402,90	1,68					
133.396	ENPHASE ENERGY INC	USD	24.191.475,20	1,03					
165.697	ESTEE LAUDER COS INC/THE - A	USD	40.554.178,80	1,72					
148.198	ETSY INC	USD	16.553.316,35	0,70					
295.666	EVERSOURCE ENERGY	USD	23.434.848,82	0,99					
148.054	INTUIT INC	USD	63.982.640,87	2,72					
82.163	INTUITIVE SURGICAL INC	USD	22.277.386,28	0,95					
272.447	MATCH GROUP INC	USD	26.626.420,51	1,13					
581.394	MICROSOFT CORP	USD	161.101.500,15	6,84					
81.940	MOODY'S CORP	USD	24.848.223,07	1,05					
277.725	NASDAQ INC	USD	44.479.930,80	1,89					
73.072	NETFLIX INC	USD	24.600.764,37	1,04					
395.795	NIKE INC - B	USD	47.866.063,18	2,03					
165.759	NORDSON CORP	USD	33.829.644,29	1,44					
349.293	NORTHERN TRUST CORP	USD	36.557.021,39	1,55					
224.855	NVIDIA CORP	USD	55.142.169,86	2,34					
41.723	PALO ALTO NETWORKS INC	USD	23.343.355,71	0,99					
117.978	SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	USD	34.181.969,05	1,45					
156.765	S&P GLOBAL INC	USD	57.791.639,51	2,45					
94.974	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	USD	50.416.926,35	2,14					
169.025	ULTA BEAUTY INC	USD	60.494.437,15	2,57					
193.270	UNITEDHEALTH GROUP INC	USD	88.583.024,22	3,76					
81.631	VEEVA SYSTEMS INC - A	USD	15.587.401,48	0,66					
279.959	VISA INC - A	USD	55.800.572,89	2,37					
216.232	ZOETIS INC - A	USD	36.650.512,63	1,56					
			<b>1.484.576.846,13</b>	<b>63,03</b>					
<b>Schweiz</b>									
591.649	NESTLE SA - REG	CHF	69.455.108,57	2,95					
51.101	PARTNERS GROUP HOLDING AG	CHF	57.568.191,97	2,44					
			<b>127.023.300,54</b>	<b>5,39</b>					
<b>Vereinigtes Königreich</b>									
1.290.173	COMPASS GROUP PLC	GBP	25.190.897,32	1,07					
1.165.790	RELX PLC	EUR	32.921.909,60	1,40					
459.769	UNILEVER PLC	EUR	18.825.241,71	0,80					
2.848.539	3I GROUP PLC	GBP	46.803.658,13	1,99					
			<b>123.741.706,76</b>	<b>5,26</b>					
<b>Niederlande</b>									
21.566	ADYEN NV	EUR	39.012.894,00	1,66					
96.772	ASML HOLDING NV	EUR	59.030.920,00	2,50					
			<b>98.043.814,00</b>	<b>4,16</b>					
<b>Irland</b>									
169.044	ICON PLC - ADR	USD	36.952.214,69	1,56					
					136.707	LINDE PLC	EUR	39.713.383,50	1,69
								<b>76.665.598,19</b>	<b>3,25</b>
					<b>Japan</b>				
					136.700	DAIKIN INDUSTRIES LTD	JPY	22.684.152,00	0,96
					856.300	RECRUIT HOLDINGS CO LTD	JPY	34.328.622,19	1,46
								<b>57.012.774,19</b>	<b>2,42</b>
					<b>Deutschland</b>				
					263.189	ALLIANZ SE - REG	EUR	56.993.577,95	2,42
								<b>56.993.577,95</b>	<b>2,42</b>
					<b>Schweden</b>				
					1.089.863	ATLAS COPCO AB - A	SEK	51.680.365,74	2,19
								<b>51.680.365,74</b>	<b>2,19</b>
					<b>Hongkong</b>				
					4.918.000	AIA GROUP LTD	HKD	46.535.159,19	1,98
								<b>46.535.159,19</b>	<b>1,98</b>
					<b>Dänemark</b>				
					458.500	NOVO NORDISK AS - B	DKK	46.161.556,08	1,96
								<b>46.161.556,08</b>	<b>1,96</b>
					<b>Färöer-Inseln</b>				
					680.362	BAKKAFROST P/F	NOK	41.469.233,16	1,77
								<b>41.469.233,16</b>	<b>1,77</b>
					<b>Jersey</b>				
					376.416	APTIV PLC	USD	40.498.592,87	1,72
								<b>40.498.592,87</b>	<b>1,72</b>
					<b>Frankreich</b>				
					183.238	SCHNEIDER ELECTRIC SE	EUR	27.881.494,08	1,18
								<b>27.881.494,08</b>	<b>1,18</b>
					<b>Finnland</b>				
					563.317	NESTE OYJ	EUR	23.366.389,16	0,99
								<b>23.366.389,16</b>	<b>0,99</b>
					<b>Italien</b>				
					8.857.175	INTESA SANPAOLO SPA	EUR	18.453.924,11	0,78
								<b>18.453.924,11</b>	<b>0,78</b>
					<b>Norwegen</b>				
					397.217	TOMRA SYSTEMS ASA	NOK	18.425.718,11	0,78
								<b>18.425.718,11</b>	<b>0,78</b>
					<b>Spanien</b>				
					720.334	SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY SA	EUR	11.507.335,65	0,49
								<b>11.507.335,65</b>	<b>0,49</b>
								<b>2.350.037.385,91</b>	<b>99,77</b>
					<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>				
								<b>2.350.037.385,91</b>	<b>99,77</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Global Sustainable Equity

(ausgedrückt in EUR)

### Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022

Zu erhalten	Zu zahlen	Fälligkeits- datum	Engagement in EUR	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR
<b>Devisentermingeschäfte</b>				
976.587.919,33	CZK 38.527.488,41	19/04/2022	38.527.488,41	1.367.433,75
1.052.531,75	EUR 135.572.204,00	20/04/2022	1.052.531,75	48.818,89
1.337.802,50	EUR 1.117.161,66	20/04/2022	1.337.802,50	16.574,54
1.199.828,06	SEK 112.832,59	20/04/2022	112.832,59	2.856,54
1.788.788,04	NOK 181.666,65	20/04/2022	181.666,65	2.071,57
41.581,91	EUR 1.015.430,15	04/04/2022	41.581,91	9,28
42,91	EUR 1.095,00	20/04/2022	42,91	(1,82)
134,25	EUR 206,23	AUD 20/04/2022	134,25	(4,90)
13.749,01	EUR 336.781,96	CZK 01/04/2022	13.749,01	(39,15)
756.857,22	EUR 5.630.579,44	DKK 20/04/2022	756.857,22	(91,77)
863.941,09	EUR 7.538.928,98	HKD 20/04/2022	863.941,09	(969,68)
1.163.305,91	HKD 135.017,48	EUR 20/04/2022	135.017,48	(1.556,11)
6.910.451,00	JPY 53.741,03	EUR 20/04/2022	53.741,03	(2.579,30)
246.841,54	CHF 244.236,10	EUR 20/04/2022	244.236,10	(3.144,12)
152.173,41	GBP 183.427,29	EUR 20/04/2022	183.427,29	(3.457,13)
2.278.666,57	EUR 2.339.280,15	CHF 20/04/2022	2.278.666,57	(6.125,85)
1.171.073,20	EUR 11.537.479,27	NOK 20/04/2022	1.171.073,20	(14.017,29)
921.646,83	EUR 9.824.626,80	SEK 20/04/2022	921.646,83	(25.657,68)
1.876.746,73	USD 1.719.955,58	EUR 20/04/2022	1.719.955,58	(34.003,04)
1.013.091,03	EUR 25.769.010,48	CZK 19/04/2022	1.013.091,03	(39.607,50)
27.273.212,45	EUR 30.464.065,72	USD 20/04/2022	27.273.212,45	(93.809,50)
			<b>77.882.695,85</b>	<b>1.212.699,73</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>				<b>1.212.699,73</b>

### Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick

		% NIW
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	<b>2.350.037.385,91</b>	<b>99,77</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	<b>1.212.699,73</b>	<b>0,05</b>
<b>Bankguthaben</b>	<b>4.624.101,45</b>	<b>0,20</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>	<b>(465.355,09)</b>	<b>(0,02)</b>
<b>Nettovermögen Gesamt</b>	<b>2.355.408.832,00</b>	<b>100,00</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Greater China Equity

(ausgedrückt in USD)

### Statistische Angaben

<b>Nettovermögen</b>	31.03.2022	USD	235.515.036,15	Distribution P (USD)	31.03.2022	USD	5.858,65
	30.09.2021	USD	312.444.342,54		30.09.2021	USD	7.795,04
	30.09.2020	USD	190.355.528,88		30.09.2020	USD	7.007,75
<b>Nettoinventarwert pro Anteil**</b>				Distribution R (USD)	31.03.2022	USD	271,59
					30.09.2021	USD	359,99
					30.09.2020	USD	322,69
Capitalisation I (EUR)	31.03.2022	EUR	9.118,79	<b>Anzahl der Anteile</b>	Capitalisation I (EUR)		
	30.09.2021	EUR	11.588,09		31.03.2022		2.205
	30.09.2020	EUR	10.189,61		30.09.2021		2.426
Capitalisation I (USD)	31.03.2022	USD	16.316,20	30.09.2020		1.587	
	30.09.2021	USD	21.597,41	Capitalisation I (USD)	31.03.2022	2.295	
	30.09.2020	USD	19.215,35	30.09.2021	1.947		
Capitalisation N (EUR)	31.03.2022	EUR	808,84	30.09.2020	1.947		
	30.09.2021	EUR	1.028,83	Capitalisation N (EUR)	31.03.2022	9.216	
	30.09.2020	EUR	906,38	30.09.2021	10.783		
Capitalisation O (USD)	31.03.2022	USD	1.441,51	30.09.2020	7.865		
	30.09.2021	USD	1.907,96	Capitalisation O (USD)	31.03.2022	1.135	
	30.09.2020	USD	1.697,29	30.09.2021	1.084		
Capitalisation P (EUR)	31.03.2022	EUR	753,62	30.09.2020	1.264		
	30.09.2021	EUR	962,66	Capitalisation P (EUR)	31.03.2022	6.950	
	30.09.2020	EUR	855,29	30.09.2021	4.160		
Capitalisation P (USD)	31.03.2022	USD	1.379,86	30.09.2020	3.592		
	30.09.2021	USD	1.836,02	Capitalisation P (USD)	31.03.2022	58.325	
	30.09.2020	USD	1.650,58	30.09.2021	51.189		
Capitalisation R (USD)	31.03.2022	USD	268,28	30.09.2020	40.879		
	30.09.2021	USD	355,62	Capitalisation R (USD)	31.03.2022	832	
	30.09.2020	USD	317,32	30.09.2021	1.123		
Capitalisation X (HUF)	31.03.2022	HUF	134.088,67	30.09.2020	997		
	30.09.2021	HUF	167.961,19	Capitalisation X (HUF)	31.03.2022	11.119	
	30.09.2020	HUF	151.643,58	30.09.2021	12.263		
Capitalisation X (USD)	31.03.2022	USD	1.250,96	30.09.2020	5.451		
	30.09.2021	USD	1.668,56	Capitalisation X (USD)	31.03.2022	31.685	
	30.09.2020	USD	1.507,41	30.09.2021	33.787		
Capitalisation X Hedged (i) (CZK)	31.03.2022	CZK	4.618,25	30.09.2020	18.778		
	30.09.2021	CZK	-	Capitalisation X Hedged (i) (CZK)	31.03.2022	529	
	30.09.2020	CZK	-	30.09.2021	-		
Capitalisation Y (USD)	31.03.2022	USD	400,76	30.09.2020	-		
	30.09.2021	USD	537,23	Capitalisation Y (USD)	31.03.2022	58.242	
	30.09.2020	USD	490,26	30.09.2021	69.538		
Capitalisation Z (USD)	31.03.2022	USD	-	30.09.2020	25.485		
	30.09.2021	USD	4.117,61	Capitalisation Z (USD)	31.03.2022	-	
	30.09.2020	USD	-	30.09.2021	2.436		
Distribution N (USD)	31.03.2022	USD	5.883,29	30.09.2020	-		
	30.09.2021	USD	7.794,89				
	30.09.2020	USD	6.986,76				

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

## NN (L) Greater China Equity

(ausgedrückt in USD)

### Statistische Angaben (Fortsetzung)

#### Anzahl der Anteile

Distribution N (USD)	31.03.2022	34
	30.09.2021	33
	30.09.2020	27
Distribution P (USD)	31.03.2022	1.930
	30.09.2021	1.660
	30.09.2020	1.161
Distribution R (USD)	31.03.2022	457
	30.09.2021	718
	30.09.2020	885

#### Laufende Kosten in %\*

Capitalisation I (EUR)	31.03.2022	0,86%
Capitalisation I (USD)	31.03.2022	0,86%
Capitalisation N (EUR)	31.03.2022	1,05%
Capitalisation O (USD)	31.03.2022	0,85%
Capitalisation P (EUR)	31.03.2022	1,90%
Capitalisation P (USD)	31.03.2022	1,90%
Capitalisation R (USD)	31.03.2022	1,15%
Capitalisation X (HUF)	31.03.2022	2,40%
Capitalisation X (USD)	31.03.2022	2,40%
Capitalisation X Hedged (i) (CZK)	31.03.2022	2,42%
Capitalisation Y (USD)	31.03.2022	3,40%
Distribution N (USD)	31.03.2022	1,05%
Distribution P (USD)	31.03.2022	1,90%
Distribution R (USD)	31.03.2022	1,14%
<b>Portfolioumsatz in %*</b>	31.03.2022	51,21%

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

## NN (L) Greater China Equity

(ausgedrückt in USD)

### Finanzabschlüsse

#### Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022

	Erläuterungen	
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	2	<b>235.279.724,82</b>
Aktien		235.279.724,82
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	2	<b>3.388,70</b>
Devisentermingeschäfte		3.388,70
<b>Bankguthaben</b>		<b>7.716.577,48</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte</b>	4	<b>13.535.794,61</b>
<b>Vermögenswerte Gesamt</b>		<b>256.535.485,61</b>
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>	4	<b>(21.020.449,46)</b>
<b>Verbindlichkeiten Gesamt</b>		<b>(21.020.449,46)</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Berichtszeitraums</b>		<b>235.515.036,15</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.



## NN (L) Greater China Equity

(ausgedrückt in USD)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW
<b>Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>				
<b>Aktien</b>				
<b>Kaimaninseln</b>				
530.000	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	HKD	7.321.613,38	3,11
45.000	ALIBABA GROUP HOLDING LTD ADR	USD	4.896.000,00	2,08
9.740.000	BOSIDENG INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	HKD	4.544.765,79	1,92
1.175.000	CHINA RESOURCES LAND LTD	HKD	5.452.194,30	2,32
3.405.000	CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	HKD	1.995.513,74	0,84
90.061	JD.COM INC - A	HKD	2.589.743,49	1,10
73.900	JD.COM INC - ADR	USD	4.276.593,00	1,82
805.000	KUAISHOU TECHNOLOGY - B	HKD	7.448.951,15	3,16
270.000	LI AUTO INC - A	HKD	3.498.127,05	1,49
705.000	LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	HKD	3.615.758,33	1,54
290.000	MEITUAN - B	HKD	5.654.644,43	2,40
45.000	NETEASE INC ADR	USD	4.036.050,00	1,71
60.000	SILERGY CORP	TWD	7.174.508,54	3,05
316.300	TENCENT HOLDINGS LTD	HKD	14.840.987,12	6,30
2.644.800	TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LTD	HKD	4.696.325,77	1,99
95.000	TRIP.COM GROUP LTD	HKD	2.274.290,64	0,97
2.830.000	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	HKD	4.967.362,97	2,11
160.000	XPENG INC - ADR	USD	4.414.400,00	1,87
			<b>93.697.829,70</b>	<b>39,78</b>
<b>China</b>				
4.685.000	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD - H	HKD	2.735.184,77	1,16
1.050.000	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD - H	HKD	5.379.057,19	2,28
921.077	BEIJING ORIENTAL YUHONG WATERPROOF TECHNOLOGY CO LTD - A	CNH	6.501.829,02	2,76
175.000	BYD CO LTD - H	HKD	4.907.283,86	2,08
4.705.000	CHINA LONGYUAN POWER GROUP CORP LTD - H	HKD	10.642.405,52	4,53
1.981.250	CITIC SECURITIES CO LTD - H	HKD	4.557.127,73	1,93
263.000	EVE ENERGY CO LTD - A	CNH	3.327.026,73	1,41
495.000	FLAT GLASS GROUP CO LTD-H	HKD	1.901.953,40	0,81
185.000	GANFENG LITHIUM CO LTD - H	HKD	2.628.142,09	1,12
3.035.000	GF SECURITIES CO LTD - H	HKD	4.290.896,83	1,82
346.800	LONGI GREEN ENERGY TECHNOLOGY CO LTD - A	CNH	3.928.399,08	1,67
971.826	LONGSHINE TECHNOLOGY GROUP CO LTD - A	CNH	4.249.998,81	1,80
328.200	SHENZHEN SENIOR TECHNOLOGY MATERIAL CO LTD	CNH	1.953.245,22	0,83
224.824	SUNGROW POWER SUPPLY CO LTD - A	CNH	3.784.449,03	1,61
625.000	TSINGTAO BREWERY CO LTD	HKD	4.947.623,83	2,10
508.915	WUXI LEAD INTELLIGENT EQUIPMENT CO LTD - A	CNH	4.682.421,65	1,99
690.774	YANTAI JEREH OILFIELD SERVICES GROUP CO LTD - A	CNH	4.607.179,22	1,96
			<b>75.024.223,98</b>	<b>31,86</b>
<b>Taiwan</b>				
470.000	EVERGREEN MARINE CORP TAIWAN LTD	TWD	2.221.638,30	0,94
940.000	FORMOSA PLASTICS CORP	TWD	3.485.884,53	1,48
1.670.000	FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD	TWD	4.451.813,86	1,90
145.000	GLOBALWAFERS CO LTD	TWD	3.399.632,29	1,44
263.000	NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD CORP	TWD	4.813.938,88	2,04
250.000	PRESIDENT CHAIN STORE CORP	TWD	2.292.667,71	0,97
1.012.000	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING CO LTD	TWD	20.996.668,50	8,92
			<b>41.662.244,07</b>	<b>17,69</b>

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW
<b>Hongkong</b>				
913.000	AIA GROUP LTD	HKD	9.551.972,62	4,06
1.215.000	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	HKD	4.598.563,23	1,95
805.000	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	HKD	4.787.741,36	2,03
126.500	HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LTD	HKD	5.957.149,86	2,53
			<b>24.895.427,07</b>	<b>10,57</b>
			<b>235.279.724,82</b>	<b>99,90</b>

**Wertpapierbestand Gesamt 235.279.724,82 99,90**

### Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022

Zu erhalten	Zu zahlen	Fälligkeits- datum	Engagement in USD	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in USD	
<b>Devisentermingeschäfte</b>					
2.949.599,13	CZK	129.670,36 USD	19/04/2022	129.670,36	4.456,73
18,21	USD	398,20 CZK	04/04/2022	18,21	0,07
240,02	USD	5.295,41 CZK	01/04/2022	240,02	(1,20)
21.652,51	USD	499.624,28 CZK	19/04/2022	21.652,51	(1.066,90)
				<b>151.581,10</b>	<b>3.388,70</b>

**Derivative Finanzinstrumente Gesamt 3.388,70**

### Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick

		% NIW
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	<b>235.279.724,82</b>	<b>99,90</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	<b>3.388,70</b>	<b>0,00</b>
<b>Bankguthaben</b>	<b>7.716.577,48</b>	<b>3,28</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>	<b>(7.484.654,85)</b>	<b>(3,18)</b>
<b>Nettovermögen Gesamt</b>	<b>235.515.036,15</b>	<b>100,00</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Green Bond

(ausgedrückt in EUR)

### Statistische Angaben

<b>Nettovermögen</b>	31.03.2022	EUR	1.210.775.777,93	Distribution R Hedged (i) (GBP)	31.03.2022	GBP	93,16
	30.09.2021	EUR	1.419.120.341,76		30.09.2021	GBP	100,61
	30.09.2020	EUR	1.093.881.445,95		30.09.2020	GBP	-
<b>Nettoinventarwert pro Anteil**</b>				Distribution R Hedged (i) (USD)	31.03.2022	USD	232,64
					30.09.2021	USD	251,28
					30.09.2020	USD	-
Capitalisation I (EUR)	31.03.2022	EUR	5.249,89	Distribution Z (EUR)	31.03.2022	EUR	5.228,38
	30.09.2021	EUR	5.688,70		30.09.2021	EUR	5.659,76
	30.09.2020	EUR	5.766,02		30.09.2020	EUR	5.742,33
Capitalisation I Hedged (i) (GBP)	31.03.2022	GBP	90,50	<b>Anzahl der Anteile</b>	Capitalisation I (EUR)	31.03.2022	109.602
	30.09.2021	GBP	97,69			30.09.2021	118.995
	30.09.2020	GBP	-			30.09.2020	98.617
Capitalisation I Hedged (i) (USD)	31.03.2022	USD	5.392,88	Capitalisation I Hedged (i) (GBP)	31.03.2022	1.482	
	30.09.2021	USD	5.818,07		30.09.2021	1.487	
	30.09.2020	USD	5.846,26		30.09.2020	-	
Capitalisation N (EUR)	31.03.2022	EUR	25,85	Capitalisation I Hedged (i) (USD)	31.03.2022	1.108	
	30.09.2021	EUR	28,02		30.09.2021	858	
	30.09.2020	EUR	28,42		30.09.2020	78	
Capitalisation P (EUR)	31.03.2022	EUR	250,26	Capitalisation N (EUR)	31.03.2022	3.812.540	
	30.09.2021	EUR	271,54		30.09.2021	4.601.215	
	30.09.2020	EUR	275,98		30.09.2020	3.175.670	
Capitalisation P Hedged (i) (SEK)	31.03.2022	SEK	95,91	Capitalisation P (EUR)	31.03.2022	120.164	
	30.09.2021	SEK	103,80		30.09.2021	239.897	
	30.09.2020	SEK	105,05		30.09.2020	138.806	
Capitalisation R (EUR)	31.03.2022	EUR	242,46	Capitalisation P Hedged (i) (SEK)	31.03.2022	6.023	
	30.09.2021	EUR	262,82		30.09.2021	3.573	
	30.09.2020	EUR	266,58		30.09.2020	593	
Capitalisation T (EUR)	31.03.2022	EUR	5.261,67	Capitalisation R (EUR)	31.03.2022	106.002	
	30.09.2021	EUR	5.699,77		30.09.2021	119.498	
	30.09.2020	EUR	5.773,81		30.09.2020	101.431	
Capitalisation X (EUR)	31.03.2022	EUR	228,82	Capitalisation T (EUR)	31.03.2022	18.423	
	30.09.2021	EUR	248,72		30.09.2021	17.565	
	30.09.2020	EUR	253,69		30.09.2020	9.830	
Capitalisation Z (EUR)	31.03.2022	EUR	4.601,51	Capitalisation X (EUR)	31.03.2022	10.925	
	30.09.2021	EUR	4.981,16		30.09.2021	7.110	
	30.09.2020	EUR	-		30.09.2020	1.139	
Distribution I (EUR)	31.03.2022	EUR	4.761,49	Capitalisation Z (EUR)	31.03.2022	3.349	
	30.09.2021	EUR	5.159,50		30.09.2021	3.288	
	30.09.2020	EUR	5.235,07		30.09.2020	-	
Distribution P (EUR)	31.03.2022	EUR	240,88	Distribution I (EUR)	31.03.2022	40.238	
	30.09.2021	EUR	261,37		30.09.2021	42.468	
	30.09.2020	EUR	265,64		30.09.2020	36.693	
Distribution R (EUR)	31.03.2022	EUR	223,90				
	30.09.2021	EUR	242,69				
	30.09.2020	EUR	-				

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

## NN (L) Green Bond

(ausgedrückt in EUR)

### Statistische Angaben (Fortsetzung)

Anzahl der Anteile			Laufende Kosten in %*		
Distribution P (EUR)	31.03.2022	29.017	Capitalisation I (EUR)	31.03.2022	0,33%
	30.09.2021	33.680	Capitalisation I Hedged (i) (GBP)	31.03.2022	0,35%
	30.09.2020	25.462	Capitalisation I Hedged (i) (USD)	31.03.2022	0,35%
Distribution R (EUR)	31.03.2022	31.144	Capitalisation N (EUR)	31.03.2022	0,40%
	30.09.2021	33.355	Capitalisation P (EUR)	31.03.2022	0,60%
	30.09.2020	-	Capitalisation P Hedged (i) (SEK)	31.03.2022	0,62%
Distribution R Hedged (i) (GBP)	31.03.2022	13.889	Capitalisation R (EUR)	31.03.2022	0,40%
	30.09.2021	20	Capitalisation T (EUR)	31.03.2022	0,27%
	30.09.2020	-	Capitalisation X (EUR)	31.03.2022	0,95%
Distribution R Hedged (i) (USD)	31.03.2022	8	Capitalisation Z (EUR)	31.03.2022	0,13%
	30.09.2021	8	Distribution I (EUR)	31.03.2022	0,33%
	30.09.2020	-	Distribution P (EUR)	31.03.2022	0,60%
Distribution Z (EUR)	31.03.2022	29.366	Distribution R (EUR)	31.03.2022	0,40%
	30.09.2021	27.905	Distribution R Hedged (i) (GBP)	31.03.2022	0,42%
	30.09.2020	19.743	Distribution R Hedged (i) (USD)	31.03.2022	0,38%
			Distribution Z (EUR)	31.03.2022	0,13%
			<b>Portfolioumsatz in %*</b>	31.03.2022	1,05%

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

## NN (L) Green Bond

(ausgedrückt in EUR)

### Finanzabschlüsse

#### Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022

	Erläuterungen	
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	2	<b>1.189.170.061,93</b>
Anleihen und andere Schuldtitel		1.189.170.061,93
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	2	<b>181.800,91</b>
Devisentermingeschäfte		181.800,91
<b>Bankguthaben</b>		<b>19.646.873,63</b>
<b>Hinterlegte Sicherheiten</b>		<b>4.222.811,65</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte</b>	4, 12	<b>10.491.722,29</b>
<b>Vermögenswerte Gesamt</b>		<b>1.223.713.270,41</b>
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>	4	<b>(10.832.220,96)</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	2	<b>(2.105.271,52)</b>
Futures		(2.105.271,52)
<b>Verbindlichkeiten Gesamt</b>		<b>(12.937.492,48)</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Berichtszeitraums</b>		<b>1.210.775.777,93</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Green Bond

(ausgedrückt in EUR)

## Wertpapierbestand zum 31.03.2022

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW	Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
<b>Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>									
<b>Anleihen und andere Schuldtitel</b>									
<b>Frankreich</b>									
8.700.000	BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL SA 0.100% 08/10/2027 EMTN	EUR	8.069.624,80	0,67	2.942.000	DIGITAL DUTCH FINCO BV 1.500% 15/03/2030	EUR	2.707.329,84	0,22
9.100.000	BNP PARIBAS SA 04/06/2026 FRN	EUR	8.849.195,81	0,73	1.178.000	DIGITAL INTREPID HOLDING BV 0.625% 15/07/2031	EUR	978.007,95	0,08
5.100.000	BNP PARIBAS SA 1.125% 28/08/2024 EMTN	EUR	5.125.424,57	0,42	7.151.000	EDP FINANCE BV 0.375% 16/09/2026 EMTN	EUR	6.854.734,57	0,57
7.400.000	BNP PARIBAS SA 14/10/2027 FRN EMTN	EUR	6.981.849,68	0,58	4.253.000	EDP FINANCE BV 1.875% 13/10/2025 EMTN	EUR	4.362.340,80	0,36
6.500.000	BNP PARIBAS SA 30/05/2028 FRN EMTN	EUR	6.106.589,00	0,50	2.000.000	EDP FINANCE BV 1.875% 21/09/2029 EMTN	EUR	2.009.262,04	0,17
2.000.000	CAISSE FRANCAISE DE FINANCEMENT LOCAL 0.100% 13/11/2029 EMTN	EUR	1.848.495,86	0,15	5.467.000	ENBW INTERNATIONAL FINANCE BV 1.875% 31/10/2033 EMTN	EUR	5.253.444,27	0,43
4.000.000	CNP ASSURANCES 27/07/2050 FRN	EUR	3.759.675,04	0,31	6.138.000	ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV 1.000% 16/09/2024 EMTN	EUR	6.161.900,14	0,51
11.000.000	CREDIT AGRICOLE HOME LOAN SFH SA 0.050% 06/12/2029 EMTN	EUR	10.110.620,30	0,84	11.605.000	ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV 1.125% 16/09/2026 EMTN	EUR	11.531.651,29	0,95
8.500.000	CREDIT AGRICOLE SA 0.375% 21/10/2025 EMTN	EUR	8.263.433,02	0,68	5.623.000	ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV 1.500% 21/07/2025 EMTN	EUR	5.702.993,02	0,47
300.000	ENGIE SA FRN PERP	EUR	307.364,84	0,03	500.000	ENEXIS HOLDING NV 0.625% 17/06/2032 EMTN	EUR	454.648,58	0,04
3.800.000	ENGIE SA FRN PERP	EUR	3.391.500,00	0,28	8.307.000	E.ON INTERNATIONAL FINANCE BV 1.250% 19/10/2027 EMTN	EUR	8.263.866,15	0,68
5.200.000	ENGIE SA FRN PERP	EUR	5.175.282,11	0,43	2.700.000	IBERDROLA INTERNATIONAL BV FRN PERP	EUR	2.552.323,82	0,21
4.600.000	ENGIE SA 0.375% 21/06/2027 EMTN	EUR	4.339.002,49	0,36	3.100.000	IBERDROLA INTERNATIONAL BV FRN PERP	EUR	2.817.060,06	0,23
1.500.000	ENGIE SA 0.375% 26/10/2029 EMTN	EUR	1.356.936,18	0,11	5.600.000	IBERDROLA INTERNATIONAL BV FRN PERP	EUR	5.780.830,89	0,48
2.600.000	ENGIE SA 1.375% 21/06/2039 EMTN	EUR	2.234.860,47	0,18	7.700.000	IBERDROLA INTERNATIONAL BV FRN PERP	EUR	7.760.978,84	0,64
3.800.000	ENGIE SA 1.375% 28/02/2029 EMTN	EUR	3.727.327,05	0,31	6.200.000	IBERDROLA INTERNATIONAL BV FRN PERP EMTN	EUR	6.308.366,27	0,52
3.400.000	ENGIE SA 1.750% 27/03/2028 EMTN	EUR	3.419.767,70	0,28	2.500.000	IBERDROLA INTERNATIONAL BV 0.375% 15/09/2025 EMTN	EUR	2.453.013,03	0,20
26.000.000	FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 0.500% 25/06/2044	EUR	21.978.445,84	1,82	6.400.000	IBERDROLA INTERNATIONAL BV 1.125% 21/04/2026 EMTN	EUR	6.437.435,52	0,53
82.409.000	FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 1.750% 25/06/2039	EUR	90.029.249,80	7,43	7.000.000	ING GROEP NV 01/07/2026 FRN	USD	5.835.937,65	0,48
3.000.000	GECINA SA 0.875% 30/06/2036 EMTN	EUR	2.535.888,39	0,21	1.600.000	ING GROEP NV 09/06/2032 FRN EMTN	EUR	1.489.487,07	0,12
9.700.000	LA BANQUE POSTALE SA 1.375% 24/04/2029 EMTN	EUR	9.372.877,01	0,77	1.200.000	ING GROEP NV 2.500% 15/11/2030 EMTN	EUR	1.264.505,82	0,10
4.500.000	LA POSTE SA 1.450% 30/11/2028 EMTN	EUR	4.550.158,49	0,38	6.000.000	LEASEPLAN CORP NV 3.500% 09/04/2025 EMTN	EUR	6.360.601,68	0,53
1.600.000	REGIE AUTONOME DES TRANSPORTS PARISIENS 0.875% 25/05/2027 EMTN	EUR	1.596.709,22	0,13	33.211.207	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 0.500% 15/01/2040	EUR	31.354.222,29	2,60
8.500.000	RTE RESEAU DE TRANSPORT D'ELECTRICITE SADIR 0.750% 12/01/2034 EMTN	EUR	7.717.528,34	0,64	8.607.000	SWISSCOM FINANCE BV 0.375% 14/11/2028	EUR	8.146.464,73	0,67
7.800.000	SNCF RESEAU 0.750% 25/05/2036 EMTN	EUR	7.150.893,75	0,59	600.000	TELEFONICA EUROPE BV FRN PERP	EUR	563.305,54	0,05
8.000.000	SNCF RESEAU 1.000% 09/11/2031 EMTN	EUR	7.863.715,60	0,65	2.490.000	TENNET HOLDING BV FRN PERP	EUR	2.495.303,95	0,21
6.000.000	SNCF RESEAU 1.875% 30/03/2034 EMTN	EUR	6.345.727,20	0,52	5.091.000	TENNET HOLDING BV FRN PERP	EUR	5.204.759,46	0,43
4.000.000	SNCF RESEAU 2.250% 20/12/2047 EMTN	EUR	4.455.405,92	0,37	3.855.000	TENNET HOLDING BV 0.500% 30/11/2040 EMTN	EUR	2.967.894,84	0,25
14.300.000	SOCIETE DU GRAND PARIS EPIC 0.700% 15/10/2060 EMTN	EUR	10.095.241,59	0,83	7.898.000	TENNET HOLDING BV 0.875% 03/06/2030 EMTN	EUR	7.510.079,70	0,62
10.100.000	SOCIETE DU GRAND PARIS EPIC 1.000% 18/02/2070 EMTN	EUR	7.450.587,29	0,62	1.170.000	TENNET HOLDING BV 0.875% 16/06/2035 EMTN	EUR	1.033.306,98	0,09
14.500.000	SOCIETE DU GRAND PARIS EPIC 1.125% 22/10/2028 EMTN	EUR	14.671.973,77	1,21	5.216.000	TENNET HOLDING BV 1.000% 13/06/2026 EMTN	EUR	5.190.039,03	0,43
8.900.000	SOCIETE DU GRAND PARIS EPIC 1.700% 25/05/2050 EMTN	EUR	9.050.856,34	0,75	5.097.000	TENNET HOLDING BV 1.375% 05/06/2028 EMTN	EUR	5.099.721,39	0,42
12.500.000	SOCIETE NATIONALE SNCF SA 0.625% 17/04/2030 EMTN	EUR	12.004.288,38	0,99	2.000.000	TENNET HOLDING BV 1.375% 26/06/2029 EMTN	EUR	1.986.967,52	0,16
1.721.000	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD SE 1.000% 14/03/2025 EMTN	EUR	1.707.117,78	0,14	3.868.000	TENNET HOLDING BV 1.500% 03/06/2039 EMTN	EUR	3.593.024,73	0,30
4.008.000	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD SE 2.500% 26/02/2024 EMTN	EUR	4.122.432,29	0,34	1.675.000	TENNET HOLDING BV 1.750% 04/06/2027 EMTN	EUR	1.721.710,67	0,14
			<b>305.766.045,92</b>	<b>25,25</b>	3.040.000	TENNET HOLDING BV 1.875% 13/06/2036 EMTN	EUR	3.017.813,02	0,25
<b>Niederlande</b>									
4.701.000	ABN AMRO BANK NV 0.875% 22/04/2025 EMTN	EUR	4.721.963,40	0,39	3.503.000	TENNET HOLDING BV 2.000% 05/06/2034 EMTN	EUR	3.556.891,55	0,29
8.719.000	ALLIANDER NV 0.375% 10/06/2030 EMTN	EUR	8.039.276,79	0,66	4.345.000	VESTEDA FINANCE BV 0.750% 18/10/2031 EMTN	EUR	3.872.371,76	0,32
3.400.000	ALLIANDER NV 0.875% 22/04/2026 EMTN	EUR	3.374.265,77	0,28	8.127.000	VESTEDA FINANCE BV 1.500% 24/05/2027 EMTN	EUR	8.111.804,95	0,67
4.107.000	ALLIANDER NV 0.875% 24/06/2032 EMTN	EUR	3.824.859,78	0,32	3.500.000	VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV 0.875% 22/09/2028 EMTN	EUR	3.281.273,91	0,27
11.088.000	CTP NV 0.750% 18/02/2027 EMTN	EUR	9.982.667,44	0,82	6.400.000	VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV 1.250% 23/09/2032 EMTN	EUR	6.025.719,68	0,50
7.937.000	CTP NV 0.875% 20/01/2026 EMTN	EUR	7.479.145,27	0,62				<b>260.414.928,02</b>	<b>21,51</b>
3.036.000	CTP NV 1.500% 27/09/2031 EMTN	EUR	2.559.820,28	0,21	<b>Deutschland</b>				
8.500.000	DE VOLKSBANK NV 22/10/2030 FRN EMTN	EUR	8.376.389,60	0,69	2.300.000	BERLIN HYP AG 0.500% 26/09/2023 EMTN	EUR	2.299.983,56	0,19
4.705.000	DIGITAL DUTCH FINCO BV 1.000% 15/01/2032	EUR	3.983.144,69	0,33	2.600.000	BERLIN HYP AG 1.125% 25/10/2027 EMTN	EUR	2.539.334,04	0,21
					8.000.000	BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE ZCP 15/08/2031	EUR	7.641.542,16	0,63
					12.000.000	BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE ZCP 15/08/2050	EUR	10.139.762,16	0,83
					10.386.000	DEUTSCHE KREDITBANK AG 0.010% 23/02/2026	EUR	9.994.302,71	0,83
					13.488.000	DZ HYP AG 0.750% 21/11/2029 EMTN	EUR	13.146.546,83	1,08
					5.500.000	ENBW ENERGIE BADEN-WUERTEMBERG AG 05/08/2079 FRN	EUR	4.915.410,61	0,41
					6.000.000	ENBW ENERGIE BADEN-WUERTEMBERG AG 05/11/2079 FRN	EUR	5.725.241,88	0,47
					2.900.000	ENBW ENERGIE BADEN-WUERTEMBERG AG 31/08/2081 FRN	EUR	2.500.748,47	0,21
					2.623.000	E.ON SE ZCP 28/08/2024 EMTN	EUR	2.576.019,45	0,21

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Green Bond

(ausgedrückt in EUR)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW	Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
5.300.000	E.ON SE 0.350% 28/02/2030 EMTN	EUR	4.849.675,64	0,40	10.700.000	KBC GROUP NV 01/03/2027 FRN EMTN	EUR	10.206.279,00	0,84
9.058.000	E.ON SE 0.375% 29/09/2027 EMTN	EUR	8.580.072,56	0,71	13.200.000	KBC GROUP NV 16/06/2027 FRN EMTN	EUR	12.627.814,98	1,04
7.103.000	E.ON SE 1.625% 29/03/2031 EMTN	EUR	7.117.674,44	0,59	1.900.000	PROXIMUS SADP 0.750% 17/11/2036 EMTN	EUR	1.676.432,04	0,14
7.300.000	EUROGRID GMBH 1.113% 15/05/2032 EMTN	EUR	6.829.825,10	0,56				<b>54.570.243,44</b>	<b>4,51</b>
1.500.000	LANDESBANK BADEN-WUERTTEMBERG 0.250% 21/07/2028 EMTN	EUR	1.362.144,17	0,11					
2.900.000	LANDESBANK BADEN-WUERTTEMBERG 0.375% 24/05/2024 EMTN	EUR	2.868.071,23	0,24					
7.700.000	LANDESBANK BADEN-WUERTTEMBERG 0.375% 29/07/2026 EMTN	EUR	7.377.318,03	0,61	4.851.000	EUROFIMA EUROPAEISCHE GESELLSCHAFT FUER DIE FINANZIERUNG VON EISENBAHNMATERIA 0.100% 20/05/2030 EMTN	EUR	4.454.491,00	0,37
4.110.000	MERCEDES-BENZ GROUP AG 0.750% 10/09/2030 EMTN	EUR	3.857.982,86	0,32	9.298.000	EUROFIMA EUROPAEISCHE GESELLSCHAFT FUER DIE FINANZIERUNG VON EISENBAHNMATERIA 0.150% 10/10/2034 EMTN	EUR	7.998.295,53	0,65
2.661.000	MERCEDES-BENZ GROUP AG 0.750% 11/03/2033 EMTN	EUR	2.398.772,71	0,20	482.000	EUROPEAN INVESTMENT BANK 0.500% 13/11/2037 EMTN	EUR	432.529,24	0,04
600.000	NRW BANK 0.625% 02/02/2029 EMTN	EUR	583.450,56	0,05	7.041.000	EUROPEAN INVESTMENT BANK 1.500% 15/11/2047	EUR	7.468.365,39	0,62
3.000.000	VONOVIA SE 0.625% 24/03/2031 EMTN	EUR	2.642.620,68	0,22	18.000.000	EUROPEAN UNION 0.400% 04/02/2037	EUR	16.002.673,02	1,31
1.200.000	ZF FINANCE GMBH 2.000% 06/05/2027 EMTN	EUR	1.081.184,52	0,09				<b>36.356.354,18</b>	<b>2,99</b>
			<b>111.027.684,37</b>	<b>9,17</b>					
	<b>Spanien</b>					<b>Luxemburg</b>			
3.000.000	ACCIONA ENERGIA FINANCIACION FILIALES SA 0.375% 07/10/2027 EMTN	EUR	2.787.212,43	0,23	500.000	AXA LOGISTICS EUROPE MASTER SCA 0.875% 15/11/2029	EUR	452.210,15	0,04
1.500.000	ACCIONA ENERGIA FINANCIACION FILIALES SA 1.375% 26/01/2032 EMTN	EUR	1.400.769,53	0,12	1.618.000	LOGICOR FINANCING SARL 2.000% 17/01/2034 EMTN	EUR	1.429.689,33	0,12
2.600.000	ACS SERVICIOS COMUNICACIONES Y ENERGIA SA 1.875% 20/04/2026	EUR	2.593.219,10	0,21	5.172.000	PROLOGIS INTERNATIONAL FUNDING II SA 0.875% 09/07/2029 EMTN	EUR	4.809.191,54	0,40
5.800.000	ADIF ALTA VELOCIDAD 1.250% 04/05/2026 EMTN	EUR	5.886.619,00	0,49	1.688.000	PROLOGIS INTERNATIONAL FUNDING II SA 1.625% 17/06/2032 EMTN	EUR	1.591.855,94	0,13
7.196.000	AUTONOMOUS COMMUNITY OF MADRID SPAIN 0.827% 30/07/2027	EUR	7.127.890,00	0,59	4.577.000	PROLOGIS INTERNATIONAL FUNDING II SA 1.750% 15/03/2028 EMTN	EUR	4.590.545,95	0,38
4.100.000	BANCO DE SABADELL SA 11/03/2027 FRN	EUR	3.987.569,35	0,33	5.984.000	P3 GROUP SARL 1.625% 26/01/2029 EMTN	EUR	5.477.513,22	0,45
2.800.000	BANCO DE SABADELL SA 16/06/2028 FRN EMTN	EUR	2.521.476,86	0,21	4.719.000	SEGRO CAPITAL SARL 1.250% 23/03/2026 EMTN	EUR	4.687.949,78	0,39
7.800.000	BANCO SANTANDER SA 0.300% 04/10/2026 EMTN	EUR	7.455.254,74	0,62	7.107.000	SEGRO CAPITAL SARL 1.875% 23/03/2030 EMTN	EUR	7.094.046,64	0,58
11.300.000	BANCO SANTANDER SA 1.125% 23/06/2027 EMTN	EUR	11.006.489,62	0,90	3.000.000	SELP FINANCE SARL 0.875% 27/05/2029	EUR	2.675.899,65	0,22
6.700.000	CAIXABANK SA 09/02/2029 FRN EMTN	EUR	6.120.491,07	0,51				<b>32.808.902,20</b>	<b>2,71</b>
6.000.000	CAIXABANK SA 18/11/2026 FRN EMTN	EUR	5.753.746,74	0,48					
6.200.000	IBERDROLA FINANZAS SA 0.875% 16/06/2025 EMTN	EUR	6.203.406,53	0,51					
2.000.000	IBERDROLA FINANZAS SA 1.000% 07/03/2025 EMTN	EUR	2.010.411,78	0,17	15.500.000	SBAB BANK AB 0.500% 13/05/2025 EMTN	EUR	15.256.171,36	1,26
7.600.000	IBERDROLA FINANZAS SA 1.250% 28/10/2026 EMTN	EUR	7.668.828,18	0,63	1.797.000	SKF AB 0.875% 15/11/2029 EMTN	EUR	1.687.098,37	0,14
2.900.000	IBERDROLA FINANZAS SA 1.375% 11/03/2032 EMTN	EUR	2.888.310,39	0,24	1.687.000	TELIA CO AB 11/05/2081 FRN	EUR	1.626.374,03	0,13
15.438.000	SPAIN GOVERNMENT BOND 1.000% 30/07/2042	EUR	13.365.604,12	1,09	10.558.000	VATTENFALL AB 0.125% 12/02/2029 EMTN	EUR	9.537.484,73	0,79
8.000.000	TELEFONICA EMISIONES SA 1.069% 05/02/2024 EMTN	EUR	8.094.673,68	0,67	4.773.000	VATTENFALL AB 0.500% 24/06/2026 EMTN	EUR	4.619.194,42	0,38
			<b>96.871.973,12</b>	<b>8,00</b>				<b>32.726.322,91</b>	<b>2,70</b>
	<b>Italien</b>					<b>Irland</b>			
4.629.000	ACEA SPA 0.250% 28/07/2030 EMTN	EUR	4.036.052,41	0,33	2.972.000	ESB FINANCE DAC 1.000% 19/07/2034 EMTN	EUR	2.739.282,12	0,23
2.614.000	ASSICURAZIONI GENERALI SPA 2.124% 01/10/2030 EMTN	EUR	2.504.458,45	0,21	25.875.000	IRELAND GOVERNMENT BOND 1.350% 18/03/2031	EUR	27.037.089,46	2,23
2.100.000	ASSICURAZIONI GENERALI SPA 2.429% 14/07/2031 EMTN	EUR	2.014.330,04	0,17	1.774.000	SMURFIT KAPPA TREASURY ULC 1.000% 22/09/2033	EUR	1.542.107,56	0,13
5.000.000	CREDIT AGRICOLE ITALIA SPA 0.125% 15/03/2033	EUR	4.358.324,05	0,36				<b>31.318.479,14</b>	<b>2,59</b>
4.691.000	ERG SPA 0.875% 15/09/2031 EMTN	EUR	4.097.889,62	0,34	12.320.000	APPLE INC ZCP 15/11/2025	EUR	12.012.917,84	0,99
2.178.000	FERROVIE DELLO STATO ITALIANE SPA 1.125% 09/07/2026 EMTN	EUR	2.150.493,32	0,18	2.715.000	APPLE INC 3.000% 20/06/2027	USD	2.467.100,53	0,20
2.125.000	HERA SPA 0.875% 05/07/2027 EMTN	EUR	2.058.209,70	0,17	3.021.000	DIGITAL EURO FINCO LLC 2.500% 16/01/2026	EUR	3.093.397,99	0,26
8.200.000	INTESA SANPAOLO SPA 0.750% 04/12/2024 EMTN	EUR	8.153.633,51	0,67	3.200.000	EQUINIX INC 1.000% 15/03/2033	EUR	2.693.360,64	0,22
5.500.000	INTESA SANPAOLO SPA 0.750% 16/03/2028 EMTN	EUR	5.135.010,10	0,42	1.995.000	PEPSICO INC 2.875% 15/10/2049	USD	1.651.027,95	0,14
500.000	IREN SPA 1.500% 24/10/2027 EMTN	EUR	493.872,40	0,04	4.379.000	VERIZON COMMUNICATIONS INC 3.875% 08/02/2029	USD	4.095.320,89	0,34
36.700.000	ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 1.500% 30/04/2045	EUR	31.239.385,71	2,58				<b>26.013.125,84</b>	<b>2,15</b>
			<b>66.241.659,31</b>	<b>5,47</b>					
	<b>Belgien</b>					<b>Norwegen</b>			
2.000.000	BELFIUS BANK SA 0.375% 08/06/2027 EMTN	EUR	1.876.752,74	0,16	15.213.000	DNB BANK ASA 18/01/2028 FRN EMTN	EUR	14.477.657,59	1,20
27.306.000	BELGIUM GOVERNMENT BOND 1.250% 22/04/2033	EUR	28.182.964,68	2,33	7.000.000	DNB BOLIGKREDITT AS 0.010% 21/01/2031	EUR	6.298.405,26	0,52
					300.000	SPAREBANK 1 SR-BANK ASA 0.250% 09/11/2026 EMTN	EUR	285.042,05	0,02

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Green Bond

(ausgedrückt in EUR)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
4.443.000	SPAREBANKEN SOER BOLIGKREDITT AS 0.010% 26/10/2026	EUR	4.245.889,42	0,35
			<b>25.306.994,32</b>	<b>2,09</b>
<b>Finnland</b>				
11.074.000	NORDEA BANK ABP 0.375% 28/05/2026 EMTN	EUR	10.762.417,51	0,90
3.080.000	STORA ENSO OYJ 0.625% 02/12/2030 EMTN	EUR	2.716.286,62	0,22
7.450.000	UPM-KYMMENE OYJ 0.125% 19/11/2028 EMTN	EUR	6.697.885,85	0,55
			<b>20.176.589,98</b>	<b>1,67</b>
<b>Südkorea</b>				
10.687.000	KOOKMIN BANK 0.048% 19/10/2026	EUR	10.189.975,42	0,85
3.632.000	LG CHEM LTD 3.625% 15/04/2029	USD	3.274.261,14	0,27
5.450.000	SK HYNIX INC 2.375% 19/01/2031	USD	4.287.712,23	0,35
			<b>17.751.948,79</b>	<b>1,47</b>
<b>Österreich</b>				
6.400.000	RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG 17/06/2033 FRN	EUR	5.458.579,71	0,44
3.300.000	VERBUND AG 0.900% 01/04/2041	EUR	2.857.903,26	0,24
2.200.000	VERBUND AG 1.500% 20/11/2024	EUR	2.242.347,01	0,19
			<b>10.558.829,98</b>	<b>0,87</b>
<b>Dänemark</b>				
2.083.000	AP MOLLER - MAERSK A/S 0.750% 25/11/2031 EMTN	EUR	1.883.261,42	0,16
1.778.000	KOMMUNEKREDIT 0.625% 21/11/2039	EUR	1.568.619,56	0,13
2.883.000	ORSTED AS 1.500% 26/11/2029	EUR	2.855.287,91	0,24
3.077.000	ORSTED AS 24/11/3017 FRN	EUR	3.093.158,00	0,25
			<b>9.400.326,89</b>	<b>0,78</b>
<b>Japan</b>				
3.628.000	MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP INC 0.848% 19/07/2029	EUR	3.416.647,09	0,28
5.620.000	NTT FINANCE CORP 0.399% 13/12/2028 EMTN	EUR	5.258.204,63	0,44
			<b>8.674.851,72</b>	<b>0,72</b>
<b>Chile</b>				
6.388.000	CHILE GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 0.830% 02/07/2031	EUR	5.816.741,92	0,48
3.265.000	CHILE GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 1.250% 29/01/2040	EUR	2.734.446,32	0,23
			<b>8.551.188,24</b>	<b>0,71</b>
<b>Vereinigtes Königreich</b>				
4.810.000	NATIONAL GRID ELECTRICITY TRANSMISSION PLC 0.190% 20/01/2025	EUR	4.705.862,20	0,39
4.028.000	NATIONAL GRID PLC 0.250% 01/09/2028 EMTN	EUR	3.683.601,29	0,30
			<b>8.389.463,49</b>	<b>0,69</b>
<b>Tschechische Republik</b>				
8.600.000	CESKA SPORITELNA AS 13/09/2028 FRN EMTN	EUR	7.637.677,11	0,63
			<b>7.637.677,11</b>	<b>0,63</b>
<b>Litauen</b>				
1.637.000	AB IGNITIS GRUPE 1.875% 10/07/2028 EMTN	EUR	1.634.455,53	0,13
2.649.000	AB IGNITIS GRUPE 2.000% 14/07/2027 EMTN	EUR	2.668.577,75	0,23
			<b>4.303.033,28</b>	<b>0,36</b>
<b>Hongkong</b>				
4.955.000	MTR CORP LTD 1.625% 19/08/2030 EMTN	USD	3.964.593,31	0,33
			<b>3.964.593,31</b>	<b>0,33</b>

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
<b>Portugal</b>				
3.500.000	EDP - ENERGIAS DE PORTUGAL SA 1.625% 15/04/2027 EMTN	EUR	3.522.120,39	0,29
			<b>3.522.120,39</b>	<b>0,29</b>
<b>Mexiko</b>				
3.530.000	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV 1.850% 01/09/2032	USD	2.751.000,93	0,23
			<b>2.751.000,93</b>	<b>0,23</b>
<b>Ungarn</b>				
2.757.000	HUNGARY GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 1.750% 05/06/2035	EUR	2.578.809,82	0,21
			<b>2.578.809,82</b>	<b>0,21</b>
<b>Indien</b>				
1.613.000	POWER FINANCE CORP LTD 1.841% 21/09/2028 GMTN	EUR	1.486.915,23	0,12
			<b>1.486.915,23</b>	<b>0,12</b>
			<b>1.189.170.061,93</b>	<b>98,22</b>
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>			<b>1.189.170.061,93</b>	<b>98,22</b>

### Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022

Zu erhalten	Zu zahlen	Fälligkeitsdatum	Engagement in EUR	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR
<b>Devisentermingeschäfte</b>				
30.291.442,33	EUR	33.610.905,81 USD	30/06/2022	30.291.442,33
190.569,23				190.569,23
6.167.640,45	USD	5.531.490,88 EUR	19/04/2022	5.531.490,88
9.302,94				9.302,94
954.991,68	SEK	89.383,27 EUR	19/04/2022	89.383,27
2.699,45				2.699,45
205.743,19	EUR	228.104,84 USD	19/04/2022	205.743,19
821,73				821,73
39.803,02	EUR	33.448,44 GBP	19/04/2022	39.803,02
243,27				243,27
3.324,40	EUR	3.711,53 USD	04/04/2022	3.324,40
(11,36)				(11,36)
34.676,26	EUR	374.696,36 SEK	19/04/2022	34.676,26
(1.452,91)				(1.452,91)
1.470.350,06	GBP	1.759.366,70 EUR	19/04/2022	1.759.366,70
(20.371,44)				(20.371,44)
			<b>37.955.230,05</b>	<b>181.800,91</b>
<b>Zins-Futures</b>				
(171)	EURO-BOBL FUTURE 08/06/2022	EUR	22.035.060,00	579.490,00
326	EURO-BUND FUTURE 08/06/2022	EUR	51.723.160,00	(2.881.255,49)
37	EURO-BUXL 30Y BOND 08/06/2022	EUR	6.889.400,00	(544.640,00)
(12)	US ULTRA BOND (CBT) 21/06/2022	USD	1.910.304,23	70.439,94
(66)	US 10YR NOTE (CBT) 21/06/2022	USD	7.288.680,18	193.709,84

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Green Bond

(ausgedrückt in EUR)

### Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl	Bezeichnung	Währung	Engagement in EUR	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR
(74)	US 10YR ULTRA FUTURE 21/06/2022	USD	9.009.740,26	271.747,07
(34)	US 2YR NOTE (CBT) 30/06/2022	USD	6.475.840,37	79.723,85
(51)	US 5YR NOTE (CBT) 30/06/2022	USD	5.256.875,48	125.513,27
			<b>110.589.060,52</b>	<b>(2.105.271,52)</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>				<b>(1.923.470,61)</b>

### Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick

		% NIW
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	<b>1.189.170.061,93</b>	<b>98,22</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	<b>(1.923.470,61)</b>	<b>(0,16)</b>
<b>Bankguthaben</b>	<b>19.646.873,63</b>	<b>1,62</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>	<b>3.882.312,98</b>	<b>0,32</b>
<b>Nettovermögen Gesamt</b>	<b>1.210.775.777,93</b>	<b>100,00</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.



## NN (L) Green Bond Short Duration

(ausgedrückt in EUR)

### Statistische Angaben

<b>Nettovermögen</b>	31.03.2022	EUR	341.461.818,74	<b>Anzahl der Anteile</b>	Distribution I (EUR)	31.03.2022	142
	30.09.2021	EUR	230.463.162,61			30.09.2021	142
	30.09.2020	EUR	92.214.075,39			30.09.2020	1.472
<b>Nettoinventarwert pro Anteil</b>				Distribution I Hedged (i) (USD)	31.03.2022	6.447	
	31.03.2022	EUR	487,90		30.09.2021	5.409	
	30.09.2021	EUR	511,06		30.09.2020	2.377	
Capitalisation I (EUR)	30.09.2020	EUR	509,14	<b>Laufende Kosten in %*</b>	Capitalisation I (EUR)	31.03.2022	0,33%
Capitalisation I Hedged (i) (GBP)	31.03.2022	GBP	97,81		Capitalisation I Hedged (i) (GBP)	31.03.2022	0,35%
	30.09.2021	GBP	102,05		Capitalisation P (EUR)	31.03.2022	0,59%
	30.09.2020	GBP	101,09	Capitalisation R (EUR)	31.03.2022	0,40%	
Capitalisation P (EUR)	31.03.2022	EUR	236,58	Capitalisation X (EUR)	31.03.2022	0,95%	
	30.09.2021	EUR	247,99	Distribution I (EUR)	31.03.2022	0,33%	
	30.09.2020	EUR	-	Distribution I Hedged (i) (USD)	31.03.2022	0,35%	
Capitalisation R (EUR)	31.03.2022	EUR	242,80	<b>Portfolioumsatz in %*</b>	31.03.2022	(18,32%)	
	30.09.2021	EUR	254,42				
	30.09.2020	EUR	253,68				
Capitalisation X (EUR)	31.03.2022	EUR	236,01				
	30.09.2021	EUR	247,97				
	30.09.2020	EUR	248,60				
Distribution I (EUR)	31.03.2022	EUR	7.311,78				
	30.09.2021	EUR	7.658,71				
	30.09.2020	EUR	7.637,87				
Distribution I Hedged (i) (USD)	31.03.2022	USD	4.959,32				
	30.09.2021	USD	5.166,13				
	30.09.2020	USD	5.105,59				
<b>Anzahl der Anteile</b>							
	31.03.2022		539.348				
	30.09.2021		350.515				
Capitalisation I (EUR)	30.09.2020		135.087				
	31.03.2022		48.170				
	30.09.2021		37.817				
Capitalisation I Hedged (i) (GBP)	30.09.2020		15.987				
	31.03.2022		1.519				
	30.09.2021		17.162				
Capitalisation P (EUR)	30.09.2020		-				
	31.03.2022		174.432				
	30.09.2021		67.116				
Capitalisation R (EUR)	30.09.2020		165				
	31.03.2022		1.070				
	30.09.2021		1.261				
Capitalisation X (EUR)	30.09.2020		80				

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

## NN (L) Green Bond Short Duration

(ausgedrückt in EUR)

### Finanzabschlüsse

#### Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022

	Erläuterungen	
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	2	<b>324.351.321,17</b>
Anleihen und andere Schuldtitel		324.351.321,17
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	2	<b>9.752.192,79</b>
Futures		9.752.192,79
<b>Bankguthaben</b>		<b>10.438.379,91</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte</b>	4, 12	<b>10.808.963,81</b>
<b>Vermögenswerte Gesamt</b>		<b>355.350.857,68</b>
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>	4	<b>(13.882.270,68)</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>		<b>(6.768,26)</b>
Devisentermingeschäfte		(6.768,26)
<b>Verbindlichkeiten Gesamt</b>		<b>(13.889.038,94)</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Berichtszeitraums</b>		<b>341.461.818,74</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Green Bond Short Duration

(ausgedrückt in EUR)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW	Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
<b>Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>									
<b>Anleihen und andere Schuldtitel</b>									
<b>Frankreich</b>									
2.300.000	BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL SA 0.100% 08/10/2027 EMTN	EUR	2.133.349,08	0,62	1.100.000	DE VOLKSBANK NV 0.010% 16/09/2024 EMTN	EUR	1.084.194,49	0,32
1.200.000	BNP PARIBAS SA 04/06/2026 FRN	EUR	1.166.926,92	0,34	1.900.000	DE VOLKSBANK NV 22/10/2030 FRN EMTN	EUR	1.872.369,44	0,55
2.600.000	BNP PARIBAS SA 1.125% 28/08/2024 EMTN	EUR	2.612.961,55	0,77	590.000	DIGITAL DUTCH FINCO BV 1.000% 15/01/2032	EUR	499.480,42	0,15
900.000	BNP PARIBAS SA 14/10/2027 FRN EMTN	EUR	849.143,88	0,25	1.000.000	DIGITAL DUTCH FINCO BV 1.500% 15/03/2030	EUR	920.234,48	0,27
3.300.000	BNP PARIBAS SA 30/05/2028 FRN EMTN	EUR	3.100.268,26	0,91	1.000.000	DIGITAL INTREPID HOLDING BV 0.625% 15/07/2031	EUR	830.227,46	0,24
500.000	CAISSE FRANCAISE DE FINANCEMENT LOCAL 0.100% 13/11/2029 EMTN	EUR	462.123,97	0,14	1.600.000	EDP FINANCE BV 0.375% 16/09/2026 EMTN	EUR	1.533.712,11	0,45
1.200.000	CNP ASSURANCES 27/07/2050 FRN	EUR	1.127.902,51	0,33	2.665.000	EDP FINANCE BV 1.875% 13/10/2025 EMTN	EUR	2.733.514,75	0,80
1.700.000	CREDIT AGRICOLE HOME LOAN SFH SA 0.050% 06/12/2029 EMTN	EUR	1.562.550,41	0,46	1.100.000	EDP FINANCE BV 1.875% 21/09/2029 EMTN	EUR	1.105.094,12	0,32
6.800.000	CREDIT AGRICOLE SA 0.375% 21/10/2025 EMTN	EUR	6.610.746,41	1,94	836.000	ENBW INTERNATIONAL FINANCE BV 1.875% 31/10/2033 EMTN	EUR	803.343,59	0,24
1.000.000	ELECTRICITE DE FRANCE SA 1.000% 13/10/2026 EMTN	EUR	991.421,52	0,29	1.600.000	ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV 1.000% 16/09/2024 EMTN	EUR	1.606.230,08	0,47
800.000	ENGIE SA FRN PERP	EUR	714.000,00	0,21	4.418.000	ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV 1.125% 16/09/2026 EMTN	EUR	4.390.076,30	1,28
1.000.000	ENGIE SA FRN PERP	EUR	995.246,56	0,29	500.000	ENEXIS HOLDING NV 0.625% 17/06/2032 EMTN	EUR	454.648,58	0,13
1.800.000	ENGIE SA 0.375% 21/06/2027 EMTN	EUR	1.697.870,54	0,50	2.791.000	E.ON INTERNATIONAL FINANCE BV 1.250% 19/10/2027 EMTN	EUR	2.776.507,82	0,81
2.000.000	ENGIE SA 0.375% 26/10/2029 EMTN	EUR	1.809.248,24	0,53	700.000	IBERDROLA INTERNATIONAL BV FRN PERP	EUR	636.110,34	0,19
200.000	ENGIE SA 1.375% 21/06/2039 EMTN	EUR	171.912,34	0,05	800.000	IBERDROLA INTERNATIONAL BV FRN PERP	EUR	756.244,10	0,22
1.600.000	ENGIE SA 1.375% 28/02/2029 EMTN	EUR	1.569.400,86	0,46	2.500.000	IBERDROLA INTERNATIONAL BV FRN PERP	EUR	2.580.728,08	0,76
400.000	ENGIE SA 1.750% 27/03/2028 EMTN	EUR	402.325,61	0,12	2.800.000	IBERDROLA INTERNATIONAL BV FRN PERP	EUR	2.822.174,12	0,83
8.800.000	FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 0.500% 25/06/2044	EUR	7.438.858,59	2,17	1.200.000	IBERDROLA INTERNATIONAL BV FRN PERP EMTN	EUR	1.220.974,12	0,36
20.985.000	FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 1.750% 25/06/2039	EUR	22.925.454,83	6,70	1.000.000	IBERDROLA INTERNATIONAL BV 0.375% 15/09/2025 EMTN	EUR	981.205,21	0,29
500.000	GECINA SA 0.875% 30/06/2036 EMTN	EUR	422.648,07	0,12	300.000	IBERDROLA INTERNATIONAL BV 1.125% 21/04/2026 EMTN	EUR	301.754,79	0,09
2.600.000	LA BANQUE POSTALE SA 1.375% 24/04/2029 EMTN	EUR	2.512.317,55	0,74	1.000.000	ING GROEP NV 01/07/2026 FRN	USD	833.705,38	0,24
1.300.000	LA POSTE SA 1.450% 30/11/2028 EMTN	EUR	1.314.490,23	0,38	500.000	ING GROEP NV 09/06/2032 FRN EMTN	EUR	465.464,71	0,14
300.000	REGIE AUTONOME DES TRANSPORTS PARISIENS 0.875% 25/05/2027 EMTN	EUR	299.382,98	0,09	900.000	ING GROEP NV 2.500% 15/11/2030 EMTN	EUR	948.379,37	0,28
1.800.000	RTE RESEAU DE TRANSPORT D'ELECTRICITE SADIR 0.750% 12/01/2034 EMTN	EUR	1.634.300,12	0,48	700.000	LEASEPLAN CORP NV 1.375% 07/03/2024 EMTN	EUR	705.507,79	0,21
1.800.000	SNCF RESEAU 0.750% 25/05/2036 EMTN	EUR	1.650.206,25	0,48	300.000	LEASEPLAN CORP NV 3.500% 09/04/2025 EMTN	EUR	318.030,08	0,09
1.300.000	SNCF RESEAU 0.875% 22/01/2029 EMTN	EUR	1.288.534,08	0,38	1.300.000	NATURGY FINANCE BV 0.875% 15/05/2025 EMTN	EUR	1.297.821,02	0,38
800.000	SNCF RESEAU 1.000% 09/11/2031 EMTN	EUR	786.371,56	0,23	6.400.000	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 0.500% 15/01/2040	EUR	6.042.147,84	1,76
2.000.000	SNCF RESEAU 1.875% 30/03/2034 EMTN	EUR	2.115.242,40	0,62	2.437.000	SWISSCOM FINANCE BV 0.375% 14/11/2028	EUR	2.306.603,29	0,68
1.000.000	SNCF RESEAU 2.250% 20/12/2047 EMTN	EUR	1.113.851,48	0,33	500.000	TELEFONICA EUROPE BV FRN PERP	EUR	469.421,29	0,14
3.500.000	SOCIETE DU GRAND PARIS EPIC 0.300% 25/11/2031 EMTN	EUR	3.212.112,19	0,94	900.000	TENNET HOLDING BV FRN PERP	EUR	920.110,69	0,27
4.000.000	SOCIETE DU GRAND PARIS EPIC 0.700% 15/10/2060 EMTN	EUR	2.823.843,80	0,83	1.771.000	TENNET HOLDING BV FRN PERP	EUR	1.774.772,41	0,52
2.300.000	SOCIETE DU GRAND PARIS EPIC 1.000% 18/02/2070 EMTN	EUR	1.696.668,39	0,50	1.100.000	TENNET HOLDING BV 0.500% 30/11/2040 EMTN	EUR	846.870,12	0,25
1.300.000	SOCIETE DU GRAND PARIS EPIC 1.125% 22/10/2028 EMTN	EUR	1.315.418,34	0,39	1.200.000	TENNET HOLDING BV 0.875% 03/06/2030 EMTN	EUR	1.141.060,48	0,33
2.500.000	SOCIETE DU GRAND PARIS EPIC 1.700% 25/05/2050 EMTN	EUR	2.542.375,38	0,74	906.000	TENNET HOLDING BV 0.875% 16/06/2035 EMTN	EUR	800.150,53	0,23
1.900.000	SOCIETE NATIONALE SNCF SA 0.625% 17/04/2030 EMTN	EUR	1.824.651,83	0,53	1.144.000	TENNET HOLDING BV 1.500% 03/06/2039 EMTN	EUR	1.062.673,29	0,31
400.000	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD SE 1.000% 14/03/2025 EMTN	EUR	396.773,45	0,12	1.342.000	TENNET HOLDING BV 1.875% 13/06/2036 EMTN	EUR	1.332.205,61	0,39
472.000	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD SE 2.500% 26/02/2024 EMTN	EUR	485.476,06	0,14	1.264.000	TENNET HOLDING BV 2.000% 05/06/2034 EMTN	EUR	1.283.445,88	0,38
<b>85.776.376,24</b>				<b>25,12</b>	1.245.000	VESTEDA FINANCE BV 0.750% 18/10/2031 EMTN	EUR	1.109.574,88	0,32
<b>Niederlande</b>									
1.000.000	ABN AMRO BANK NV 0.500% 15/04/2026 EMTN	EUR	982.427,83	0,29	2.445.000	VESTEDA FINANCE BV 1.500% 24/05/2027 EMTN	EUR	2.440.428,58	0,71
2.600.000	ALLIANDER NV 0.375% 10/06/2030 EMTN	EUR	2.397.306,99	0,70	900.000	VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV 0.875% 22/09/2028 EMTN	EUR	843.756,15	0,25
1.200.000	ALLIANDER NV 0.875% 24/06/2032 EMTN	EUR	1.117.563,12	0,33	1.900.000	VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV 1.250% 23/09/2032 EMTN	EUR	1.788.885,53	0,52
2.584.000	CTP NV 0.750% 18/02/2027 EMTN	EUR	2.326.408,07	0,68	<b>Deutschland</b>				
1.804.000	CTP NV 0.875% 20/01/2026 EMTN	EUR	1.699.934,24	0,50	500.000	BERLIN HYP AG 1.125% 25/10/2027 EMTN	EUR	488.333,47	0,14
1.400.000	CTP NV 1.500% 27/09/2031 EMTN	EUR	1.180.417,78	0,35	3.000.000	BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE ZCP 15/08/2031	EUR	2.865.578,31	0,84
					3.500.000	BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE ZCP 15/08/2050	EUR	2.957.430,63	0,88
					2.471.000	DEUTSCHE KREDITBANK AG 0.010% 23/02/2026	EUR	2.377.808,78	0,70
					300.000	DEUTSCHE KREDITBANK AG 0.750% 26/09/2024	EUR	299.073,68	0,09
					3.147.000	DZ HYP AG 0.750% 21/11/2029 EMTN	EUR	3.067.332,66	0,90
					1.200.000	ENBW ENERGIE BADEN-WUERTTEMBERG AG 05/08/2079 FRN	EUR	1.072.453,22	0,31
					2.400.000	ENBW ENERGIE BADEN-WUERTTEMBERG AG 05/11/2079 FRN	EUR	2.290.096,75	0,67
					500.000	ENBW ENERGIE BADEN-WUERTTEMBERG AG 29/06/2080 FRN	EUR	467.309,63	0,14
					1.200.000	ENBW ENERGIE BADEN-WUERTTEMBERG AG 31/08/2081 FRN	EUR	1.034.792,47	0,30
					<b>68.343.897,35</b>				
					<b>20,02</b>				

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.



## NN (L) Green Bond Short Duration

(ausgedrückt in EUR)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
<b>Vereinigte Staaten</b>				
800.000	APPLE INC ZCP 15/11/2025	EUR	780.059,60	0,23
1.361.000	APPLE INC 3.000% 20/06/2027	USD	1.236.730,69	0,36
1.809.000	DIGITAL EURO FINCO LLC 2.500% 16/01/2026	EUR	1.852.352,52	0,54
1.200.000	EQUINIX INC 1.000% 15/03/2033	EUR	1.010.010,24	0,30
380.000	PEPSICO INC 2.875% 15/10/2049	USD	314.481,52	0,09
861.000	VERIZON COMMUNICATIONS INC 3.875% 08/02/2029	USD	805.222,95	0,24
			<b>5.998.857,52</b>	<b>1,76</b>
<b>Finnland</b>				
2.580.000	NORDEA BANK ABP 0.375% 28/05/2026 EMTN	EUR	2.507.408,09	0,73
1.000.000	STORA ENSO OYJ 0.625% 02/12/2030 EMTN	EUR	881.911,24	0,26
2.060.000	UPM-KYMMENE OYJ 0.125% 19/11/2028 EMTN	EUR	1.852.032,86	0,54
			<b>5.241.352,19</b>	<b>1,53</b>
<b>Österreich</b>				
500.000	RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG 0.375% 25/09/2026 EMTN	EUR	474.938,78	0,14
1.500.000	RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG 17/06/2033 FRN	EUR	1.279.354,62	0,38
800.000	VERBUND AG 0.900% 01/04/2041	EUR	692.825,03	0,20
900.000	VERBUND AG 1.500% 20/11/2024	EUR	917.323,78	0,27
			<b>3.364.442,21</b>	<b>0,99</b>
<b>Chile</b>				
1.740.000	CHILE GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 0.830% 02/07/2031	EUR	1.584.397,46	0,47
740.000	CHILE GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 1.250% 29/01/2040	EUR	619.752,00	0,18
			<b>2.204.149,46</b>	<b>0,65</b>
<b>Japan</b>				
214.000	mitsubishi UFJ FINANCIAL GROUP INC 0.848% 19/07/2029	EUR	201.533,21	0,06
2.012.000	NTT FINANCE CORP 0.399% 13/12/2028 EMTN	EUR	1.882.474,68	0,55
			<b>2.084.007,89</b>	<b>0,61</b>
<b>Tschechische Republik</b>				
2.300.000	ceska sporitelna AS 13/09/2028 FRN EMTN	EUR	2.042.634,58	0,60
			<b>2.042.634,58</b>	<b>0,60</b>
<b>Vereinigtes Königreich</b>				
1.337.000	NATIONAL GRID ELECTRICITY TRANSMISSION PLC 0.190% 20/01/2025	EUR	1.308.053,59	0,38
655.000	NATIONAL GRID PLC 0.250% 01/09/2028 EMTN	EUR	598.996,73	0,18
			<b>1.907.050,32</b>	<b>0,56</b>
<b>Litauen</b>				
1.000.000	AB IGNITIS GRUPE 1.875% 10/07/2028 EMTN	EUR	998.445,65	0,29
361.000	AB IGNITIS GRUPE 2.000% 14/07/2027 EMTN	EUR	363.668,01	0,11
			<b>1.362.113,66</b>	<b>0,40</b>
<b>Dänemark</b>				
375.000	AP MOLLER - MAERSK A/S 0.750% 25/11/2031 EMTN	EUR	339.041,30	0,10
300.000	KOMMUNEKREDIT 0.625% 21/11/2039	EUR	264.671,47	0,08
505.000	ORSTED AS 1.500% 26/11/2029	EUR	500.145,82	0,14
			<b>1.103.858,59</b>	<b>0,32</b>
<b>Ungarn</b>				
630.000	HUNGARY GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 1.750% 05/06/2035	EUR	589.281,90	0,17
			<b>589.281,90</b>	<b>0,17</b>

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
<b>Indien</b>				
437.000	POWER FINANCE CORP LTD 1.841% 21/09/2028 GMTN	EUR	402.840,64	0,12
			<b>402.840,64</b>	<b>0,12</b>
<b>Indonesien</b>				
412.000	PERUSAHAAN PENERBIT SBSN INDONESIA III 3.750% 01/03/2023	USD	375.757,51	0,11
			<b>375.757,51</b>	<b>0,11</b>
<b>Hongkong</b>				
425.000	MTR CORP LTD 1.625% 19/08/2030 EMTN	USD	340.050,89	0,10
			<b>340.050,89</b>	<b>0,10</b>
<b>Mexiko</b>				
385.000	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV 1.850% 01/09/2032	USD	300.038,35	0,09
			<b>300.038,35</b>	<b>0,09</b>
<b>Portugal</b>				
200.000	EDP - ENERGIAS DE PORTUGAL SA 1.625% 15/04/2027 EMTN	EUR	201.264,02	0,06
			<b>201.264,02</b>	<b>0,06</b>
			<b>324.351.321,17</b>	<b>94,99</b>

**Wertpapierbestand Gesamt 324.351.321,17 94,99**

### Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022

Zu erhalten	Zu zahlen	Fälligkeits- datum	Engagement in EUR	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR		
<b>Devisentermingeschäfte</b>						
9.772.893,47	EUR	10.833.614,99	USD	30/06/2022	9.772.893,47	70.647,66
799.975,24	EUR	880.695,94	USD	19/04/2022	799.975,24	8.788,62
2.702.092,32	EUR	2.999.998,00	USD	01/04/2022	2.702.092,32	5.828,45
54.128,89	EUR	45.360,61	GBP	19/04/2022	54.128,89	480,52
492,18	EUR	415,99	GBP	01/04/2022	492,18	(0,08)
4.974,32	EUR	4.215,49	GBP	04/04/2022	4.974,32	(14,07)
2.687.086,80	EUR	2.999.998,06	USD	04/04/2022	2.687.086,80	(9.177,13)
33.059.789,59	USD	29.717.394,17	EUR	19/04/2022	29.717.394,17	(17.628,20)
4.780.540,92	GBP	5.719.679,60	EUR	19/04/2022	5.719.679,60	(65.694,03)
					<b>51.458.716,99</b>	<b>(6.768,26)</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Green Bond Short Duration

(ausgedrückt in EUR)

### Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl	Bezeichnung	Währung	Engagement in EUR	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR
<b>Zins-Futures</b>				
51	EURO-BOBL FUTURE 08/06/2022	EUR	6.571.860,00	(94.775,00)
(643)	EURO-BUND FUTURE 08/06/2022	EUR	102.018.380,00	4.842.964,03
(341)	EURO-BUXL 30Y BOND 08/06/2022	EUR	63.494.200,00	4.876.908,61
(1)	US ULTRA BOND (CBT) 21/06/2022	USD	159.192,02	5.870,00
(8)	US 10YR NOTE (CBT) 21/06/2022	USD	883.476,39	23.479,98
(12)	US 10YR ULTRA FUTURE 21/06/2022	USD	1.461.038,96	44.067,09
(4)	US 2YR NOTE (CBT) 30/06/2022	USD	761.863,57	9.379,28
(18)	US 5YR NOTE (CBT) 30/06/2022	USD	1.855.367,82	44.298,80
			<b>177.205.378,76</b>	<b>9.752.192,79</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>				<b>9.745.424,53</b>

### Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick

		%
		NIW
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	<b>324.351.321,17</b>	<b>94,99</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	<b>9.745.424,53</b>	<b>2,85</b>
<b>Bankguthaben</b>	<b>10.438.379,91</b>	<b>3,06</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>	<b>(3.073.306,87)</b>	<b>(0,90)</b>
<b>Nettovermögen Gesamt</b>	<b>341.461.818,74</b>	<b>100,00</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Health Care

(ausgedrückt in USD)

### Statistische Angaben

<b>Nettovermögen</b>	31.03.2022	USD	373.949.383,16	Distribution R (USD)	31.03.2022	USD	364,75
	30.09.2021	USD	365.226.506,17		30.09.2021	USD	363,65
	30.09.2020	USD	308.424.266,32		30.09.2020	USD	318,24
<b>Nettoinventarwert pro Anteil**</b>				Distribution R Hedged (ii) (EUR)	31.03.2022	EUR	345,67
					30.09.2021	EUR	344,02
					30.09.2020	EUR	302,87
Capitalisation I (USD)	31.03.2022	USD	3.405,16	<b>Anzahl der Anteile</b>	Capitalisation I (USD)	31.03.2022	15.071
	30.09.2021	USD	3.385,40			30.09.2021	7.756
	30.09.2020	USD	2.949,74			30.09.2020	5.779
Capitalisation I Hedged (ii) (EUR)	31.03.2022	EUR	9.692,22	Capitalisation I Hedged (ii) (EUR)	31.03.2022	3.963	
	30.09.2021	EUR	9.627,83		30.09.2021	4.235	
	30.09.2020	EUR	8.434,82		30.09.2020	3.399	
Capitalisation P (EUR)	31.03.2022	EUR	1.135,80	Capitalisation P (EUR)	31.03.2022	21.445	
	30.09.2021	EUR	1.089,48		30.09.2021	19.638	
	30.09.2020	EUR	947,54		30.09.2020	11.760	
Capitalisation P (USD)	31.03.2022	USD	2.886,76	Capitalisation P (USD)	31.03.2022	22.213	
	30.09.2021	USD	2.884,21		30.09.2021	23.289	
	30.09.2020	USD	2.538,02		30.09.2020	24.877	
Capitalisation P Hedged (i) (CZK)	31.03.2022	CZK	7.684,57	Capitalisation P Hedged (i) (CZK)	31.03.2022	79.877	
	30.09.2021	CZK	7.640,21		30.09.2021	59.203	
	30.09.2020	CZK	-		30.09.2020	-	
Capitalisation P Hedged (ii) (EUR)	31.03.2022	EUR	893,03	Capitalisation P Hedged (ii) (EUR)	31.03.2022	66.676	
	30.09.2021	EUR	891,68		30.09.2021	71.773	
	30.09.2020	EUR	788,63		30.09.2020	81.919	
Capitalisation R (EUR)	31.03.2022	EUR	432,23	Capitalisation R (EUR)	31.03.2022	727	
	30.09.2021	EUR	413,05		30.09.2021	1.331	
	30.09.2020	EUR	356,44		30.09.2020	1.612	
Capitalisation R (USD)	31.03.2022	USD	370,64	Capitalisation R (USD)	31.03.2022	9.437	
	30.09.2021	USD	368,93		30.09.2021	10.218	
	30.09.2020	USD	322,22		30.09.2020	12.795	
Capitalisation R Hedged (ii) (EUR)	31.03.2022	EUR	351,09	Capitalisation R Hedged (ii) (EUR)	31.03.2022	8.986	
	30.09.2021	EUR	349,13		30.09.2021	11.359	
	30.09.2020	EUR	306,68		30.09.2020	13.645	
Capitalisation X (EUR)	31.03.2022	EUR	1.102,94	Capitalisation X (EUR)	31.03.2022	34.209	
	30.09.2021	EUR	1.060,59		30.09.2021	37.830	
	30.09.2020	EUR	927,00		30.09.2020	46.056	
Capitalisation X (USD)	31.03.2022	USD	2.602,06	Capitalisation X (USD)	31.03.2022	5.632	
	30.09.2021	USD	2.606,25		30.09.2021	6.211	
	30.09.2020	USD	2.304,91		30.09.2020	6.577	
Distribution P (USD)	31.03.2022	USD	12.371,72	Distribution P (USD)	31.03.2022	844	
	30.09.2021	USD	12.360,82		30.09.2021	882	
	30.09.2020	USD	10.877,18		30.09.2020	965	
Distribution P Hedged (ii) (EUR)	31.03.2022	EUR	3.856,09				
	30.09.2021	EUR	3.849,08				
	30.09.2020	EUR	3.403,95				

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

## NN (L) Health Care

(ausgedrückt in USD)

### Statistische Angaben (Fortsetzung)

Portfolioumsatz in %\* 31.03.2022 318,47%

#### Anzahl der Anteile

Distribution P Hedged (ii) (EUR)	31.03.2022	3.898
	30.09.2021	4.196
	30.09.2020	4.173
Distribution R (USD)	31.03.2022	2.248
	30.09.2021	2.585
	30.09.2020	3.548
Distribution R Hedged (ii) (EUR)	31.03.2022	6.431
	30.09.2021	6.612
	30.09.2020	7.270

#### Dividende

Distribution R (USD)	14.12.2021	USD	0,60
Distribution R Hedged (ii) (EUR)	14.12.2021	EUR	0,55

#### Laufende Kosten in %\*

Capitalisation I (USD)	31.03.2022	0,81%
Capitalisation I Hedged (ii) (EUR)	31.03.2022	0,83%
Capitalisation P (EUR)	31.03.2022	1,80%
Capitalisation P (USD)	31.03.2022	1,80%
Capitalisation P Hedged (i) (CZK)	31.03.2022	1,82%
Capitalisation P Hedged (ii) (EUR)	31.03.2022	1,82%
Capitalisation R (EUR)	31.03.2022	1,05%
Capitalisation R (USD)	31.03.2022	1,05%
Capitalisation R Hedged (ii) (EUR)	31.03.2022	1,07%
Capitalisation X (EUR)	31.03.2022	2,30%
Capitalisation X (USD)	31.03.2022	2,30%
Distribution P (USD)	31.03.2022	1,80%
Distribution P Hedged (ii) (EUR)	31.03.2022	1,82%
Distribution R (USD)	31.03.2022	1,05%
Distribution R Hedged (ii) (EUR)	31.03.2022	1,07%

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.



## NN (L) Health Care

(ausgedrückt in USD)

### Finanzabschlüsse

#### Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022

	Erläuterungen	
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	2	<b>368.525.822,30</b>
Aktien		368.525.822,30
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	2	<b>669.314,68</b>
Devisentermingeschäfte		669.314,68
<b>Bankguthaben</b>		<b>5.133.144,63</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte</b>	4	<b>2.207.431,38</b>
<b>Vermögenswerte Gesamt</b>		<b>376.535.712,99</b>
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>	4, 12	<b>(2.586.329,83)</b>
<b>Verbindlichkeiten Gesamt</b>		<b>(2.586.329,83)</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Berichtszeitraums</b>		<b>373.949.383,16</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Health Care

(ausgedrückt in USD)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW	Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW
<b>Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>									
<b>Aktien</b>									
<b>Vereinigte Staaten</b>									
15.900	ABBVIE INC	USD	2.577.549,00	0,69					
1.600	ALIGN TECHNOLOGY INC	USD	697.600,00	0,19					
8.700	AMGEN INC	USD	2.103.834,00	0,56					
34.243	ANTHEM INC	USD	16.820.846,46	4,50					
7.600	BIOGEN INC	USD	1.600.560,00	0,43					
197.900	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	USD	14.452.637,00	3,85					
125.400	CARDINAL HEALTH INC	USD	7.110.180,00	1,90					
106.600	CENTENE CORP	USD	8.974.654,00	2,40					
1.600	CHARLES RIVER LABORATORIES INTERNATIONAL INC	USD	454.352,00	0,12					
60.349	CIGNA CORP	USD	14.460.223,89	3,87					
165.900	CVS HEALTH CORP	USD	16.790.739,00	4,49					
14.100	DANAHER CORP	USD	4.135.953,00	1,11					
21.000	DAVITA INC	USD	2.375.310,00	0,64					
80.364	ELI LILLY & CO	USD	23.013.838,68	6,15					
3.300	ENSIGN GROUP INC	USD	297.033,00	0,08					
37.800	HOLOGIC INC	USD	2.903.796,00	0,78					
16.000	HUMANA INC	USD	6.962.720,00	1,86					
5.900	IDEXX LABORATORIES INC	USD	3.227.654,00	0,86					
6.700	IQVIA HOLDINGS INC	USD	1.549.107,00	0,41					
185.125	JOHNSON & JOHNSON	USD	32.809.703,75	8,77					
27.200	MCKESSON CORP	USD	8.326.736,00	2,23					
62.913	MERCK & CO INC	USD	5.162.011,65	1,38					
8.413	METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL INC	USD	11.552.647,47	3,09					
1.000	MODERNA INC	USD	172.260,00	0,05					
8.200	MOLINA HEALTHCARE INC	USD	2.735.438,00	0,73					
5.621	ORGANON & CO	USD	196.341,53	0,05					
66.500	PFIZER INC	USD	3.442.705,00	0,92					
15.500	QUEST DIAGNOSTICS INC	USD	2.121.330,00	0,57					
1.900	QUIDEL CORP	USD	213.674,00	0,06					
10.500	R1 RCM INC	USD	280.980,00	0,08					
2.500	SYNEOS HEALTH INC - A	USD	202.375,00	0,05					
3.000	TENET HEALTHCARE CORP	USD	257.880,00	0,07					
35.317	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	USD	20.859.986,05	5,58					
41.783	UNITEDHEALTH GROUP INC	USD	21.308.076,51	5,70					
34.800	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	USD	9.081.756,00	2,43					
26.900	WATERS CORP	USD	8.349.491,00	2,23					
7.700	WEST PHARMACEUTICAL SERVICES INC	USD	3.162.467,00	0,85					
			<b>260.744.445,99</b>	<b>69,73</b>					
<b>Schweiz</b>									
65.308	ROCHE HOLDING AG - GENUSSSCHEIN	CHF	26.006.103,34	6,95					
11.600	SONOVA HOLDING AG - REG	CHF	4.885.802,77	1,31					
199	STRAUMANN HOLDING AG - REG	CHF	321.449,06	0,09					
			<b>31.213.355,17</b>	<b>8,35</b>					
<b>Vereinigtes Königreich</b>									
4.600	DECHRA PHARMACEUTICALS PLC	GBP	245.655,28	0,07					
525.700	GLAXOSMITHKLINE PLC	GBP	11.401.306,96	3,04					
141.300	ROYALTY PHARMA PLC - A	USD	5.505.048,00	1,46					
43.500	SMITH & NEPHEW PLC	GBP	698.746,13	0,19					
			<b>17.850.756,37</b>	<b>4,76</b>					
								<b>368.525.822,30</b>	<b>98,55</b>
<b>Dänemark</b>									
142.404	NOVO NORDISK AS - B	DKK	15.952.247,17	4,27					
			<b>15.952.247,17</b>	<b>4,27</b>					
<b>Japan</b>									
39.600	CHUGAI PHARMACEUTICAL CO LTD	JPY	1.336.693,72	0,36					
52.900	HOYA CORP	JPY	6.114.825,95	1,64					
167.900	TAKEDA PHARMACEUTICAL CO LTD	JPY	4.838.839,96	1,29					
			<b>12.290.359,63</b>	<b>3,29</b>					
<b>Australien</b>									
37.400	CSL LTD	AUD	7.531.134,57	2,02					
7.400	PRO MEDICUS LTD	AUD	272.238,89	0,07					
			<b>7.803.373,46</b>	<b>2,09</b>					
<b>Luxemburg</b>									
59.300	EUROFINS SCIENTIFIC SE	EUR	5.932.274,73	1,58					
			<b>5.932.274,73</b>	<b>1,58</b>					
<b>Deutschland</b>									
22.900	BAYER AG	EUR	1.582.288,41	0,42					
2.800	DERMAPHARM HOLDING SE	EUR	179.759,73	0,05					
45.500	FRESENIUS SE & CO KGAA	EUR	1.688.109,77	0,45					
3.600	SARTORIUS AG	EUR	1.609.025,39	0,43					
			<b>5.059.183,30</b>	<b>1,35</b>					
<b>Niederlande</b>									
126.900	KONINKLIJKE PHILIPS NV	EUR	3.915.345,18	1,05					
			<b>3.915.345,18</b>	<b>1,05</b>					
<b>Frankreich</b>									
14.200	IPSEN SA	EUR	1.790.098,05	0,48					
2.200	SARTORIUS STEDIM BIOTECH	EUR	911.816,66	0,24					
			<b>2.701.914,71</b>	<b>0,72</b>					
<b>Kanada</b>									
116.600	BAUSCH HEALTH COS INC	USD	2.664.310,00	0,71					
			<b>2.664.310,00</b>	<b>0,71</b>					
<b>Finnland</b>									
34.000	ORION OYJ - B	EUR	1.556.708,59	0,42					
			<b>1.556.708,59</b>	<b>0,42</b>					
<b>Israel</b>									
22.800	INMODE LTD	USD	841.548,00	0,23					
			<b>841.548,00</b>	<b>0,23</b>					
								<b>368.525.822,30</b>	<b>98,55</b>
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>								<b>368.525.822,30</b>	<b>98,55</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Health Care

(ausgedrückt in USD)

### Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022

Zu erhalten	Zu zahlen	Fälligkeits- datum	Engagement in USD	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in USD
<b>Devisentermingeschäfte</b>				
652.289.391,54	CZK 28.702.903,29	19/04/2022	28.702.903,29	958.646,31
4.479.380,85	EUR 575.366.960,00	20/04/2022	5.018.328,78	244.490,82
4.084.376,29	EUR 3.409.456,63	20/04/2022	4.585.003,56	58.031,51
2.795.732,90	USD 2.505.137,01	20/04/2022	2.795.732,90	7.097,66
204.895,63	AUD 135.462,12	20/04/2022	149.620,16	3.102,93
460.622,12	NZD 286.731,33	20/04/2022	313.983,03	1.134,46
5.497.396,32	DKK 738.785,24	20/04/2022	803.231,44	288,37
34.277,60	USD 749.750,59	04/04/2022	34.277,60	124,29
335,82	EUR 3.587,45	20/04/2022	377,20	(11,23)
10.687,60	EUR 272.703,19	20/04/2022	12.004,32	(502,03)
112.437,08	USD 2.480.654,29	01/04/2022	112.437,08	(563,91)
5.735.449,21	EUR 42.667.433,87	20/04/2022	6.438.445,46	(624,78)
60.256,55	GBP 72.891,71	20/04/2022	80.282,54	(1.812,69)
530.132,64	CHF 524.687,12	20/04/2022	573.105,79	(7.684,02)
279.825,63	EUR 462.032,68	20/04/2022	314.300,15	(9.802,53)
10.226.292,06	EUR 10.491.804,28	20/04/2022	11.463.856,46	(23.517,67)
49.684.351,00	JPY 391.285,35	20/04/2022	430.186,24	(26.099,16)
1.613.146,90	USD 36.851.921,58	19/04/2022	1.613.146,90	(62.620,20)
2.522.444,01	EUR 3.871.822,92	20/04/2022	2.830.931,80	(100.183,10)
88.411.730,87	EUR 98.787.180,26	20/04/2022	98.787.180,26	(370.180,35)
			<b>165.059.334,96</b>	<b>669.314,68</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>				<b>669.314,68</b>

### Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick

		% NIW
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	<b>368.525.822,30</b>	<b>98,55</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	<b>669.314,68</b>	<b>0,18</b>
<b>Bankguthaben</b>	<b>5.133.144,63</b>	<b>1,37</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>	<b>(378.898,45)</b>	<b>(0,10)</b>
<b>Nettovermögen Gesamt</b>	<b>373.949.383,16</b>	<b>100,00</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Health & Well-being

(ausgedrückt in EUR)

### Statistische Angaben

<b>Nettovermögen</b>	31.03.2022	EUR	314.367.300,54	Distribution R (USD)	31.03.2022	USD	303,78
	30.09.2021	EUR	324.440.268,89		30.09.2021	USD	327,73
	30.09.2020	EUR	98.254.092,93		30.09.2020	USD	264,42
<b>Nettoinventarwert pro Anteil**</b>				<b>Anzahl der Anteile</b>			
Capitalisation I (EUR)	31.03.2022	EUR	12.596,15	Capitalisation I (EUR)	31.03.2022		1.915
	30.09.2021	EUR	13.030,87		30.09.2021		653
	30.09.2020	EUR	10.365,91		30.09.2020		90
Capitalisation I (USD)	31.03.2022	USD	4.994,35	Capitalisation I (USD)	31.03.2022		432
	30.09.2021	USD	-		30.09.2021		-
	30.09.2020	USD	-		30.09.2020		-
Capitalisation P (EUR)	31.03.2022	EUR	1.194,77	Capitalisation P (EUR)	31.03.2022		27.563
	30.09.2021	EUR	1.242,13		30.09.2021		28.777
	30.09.2020	EUR	997,90		30.09.2020		33.633
Capitalisation P (USD)	31.03.2022	USD	248,35	Capitalisation P (USD)	31.03.2022		55.177
	30.09.2021	USD	268,94		30.09.2021		61.116
	30.09.2020	USD	218,61		30.09.2020		80.806
Capitalisation R (EUR)	31.03.2022	EUR	353,85	Capitalisation R (EUR)	31.03.2022		10.724
	30.09.2021	EUR	366,50		30.09.2021		9.964
	30.09.2020	EUR	292,25		30.09.2020		6.033
Capitalisation R (USD)	31.03.2022	USD	303,78	Capitalisation R (USD)	31.03.2022		656
	30.09.2021	USD	327,73		30.09.2021		656
	30.09.2020	USD	264,42		30.09.2020		656
Capitalisation X (EUR)	31.03.2022	EUR	1.073,50	Capitalisation X (EUR)	31.03.2022		31.679
	30.09.2021	EUR	1.118,83		30.09.2021		33.114
	30.09.2020	EUR	903,35		30.09.2020		36.580
Capitalisation X (USD)	31.03.2022	USD	210,12	Capitalisation X (USD)	31.03.2022		19.457
	30.09.2021	USD	228,10		30.09.2021		21.424
	30.09.2020	USD	186,35		30.09.2020		24.319
Distribution N (EUR)	31.03.2022	EUR	59,27	Distribution N (EUR)	31.03.2022		3.214.634
	30.09.2021	EUR	61,32		30.09.2021		3.392.492
	30.09.2020	EUR	-		30.09.2020		-
Distribution O (EUR)	31.03.2022	EUR	11.872,30	Distribution O (EUR)	31.03.2022		243
	30.09.2021	EUR	12.291,97		30.09.2021		290
	30.09.2020	EUR	-		30.09.2020		-
Distribution P (EUR)	31.03.2022	EUR	5.264,21	Distribution P (EUR)	31.03.2022		666
	30.09.2021	EUR	5.472,84		30.09.2021		709
	30.09.2020	EUR	4.396,72		30.09.2020		888
Distribution P (USD)	31.03.2022	USD	298,55	Distribution P (USD)	31.03.2022		15.552
	30.09.2021	USD	323,30		30.09.2021		17.649
	30.09.2020	USD	262,80		30.09.2020		24.851
Distribution R (EUR)	31.03.2022	EUR	346,97	Distribution R (EUR)	31.03.2022		432
	30.09.2021	EUR	359,37		30.09.2021		574
	30.09.2020	EUR	286,56		30.09.2020		574

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

## NN (L) Health & Well-being

(ausgedrückt in EUR)

### Statistische Angaben (Fortsetzung)

#### Anzahl der Anteile

Distribution R (USD)	31.03.2022	593
	30.09.2021	1.051
	30.09.2020	1.052

#### Dividende

Distribution O (EUR)	14.12.2021	EUR	23,70
----------------------	------------	-----	-------

#### Laufende Kosten in %\*

Capitalisation I (EUR)	31.03.2022	0,81%
Capitalisation I (USD)	31.03.2022	0,81%
Capitalisation P (EUR)	31.03.2022	1,80%
Capitalisation P (USD)	31.03.2022	1,80%
Capitalisation R (EUR)	31.03.2022	1,05%
Capitalisation R (USD)	31.03.2022	1,05%
Capitalisation X (EUR)	31.03.2022	2,30%
Capitalisation X (USD)	31.03.2022	2,30%
Distribution N (EUR)	31.03.2022	0,83%
Distribution O (EUR)	31.03.2022	0,60%
Distribution P (EUR)	31.03.2022	1,80%
Distribution P (USD)	31.03.2022	1,80%
Distribution R (EUR)	31.03.2022	1,05%
Distribution R (USD)	31.03.2022	1,05%
<b>Portfolioumsatz in %*</b>	31.03.2022	26,10%

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

## NN (L) Health & Well-being

(ausgedrückt in EUR)

### Finanzabschlüsse

#### Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022

	Erläuterungen	
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	2	<b>310.255.692,91</b>
Aktien		310.255.692,91
<b>Bankguthaben</b>		<b>3.040.276,33</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte</b>	4	<b>1.880.181,63</b>
<b>Vermögenswerte Gesamt</b>		<b>315.176.150,87</b>
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>	4	<b>(808.850,33)</b>
<b>Verbindlichkeiten Gesamt</b>		<b>(808.850,33)</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Berichtszeitraums</b>		<b>314.367.300,54</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Health & Well-being

(ausgedrückt in EUR)

## Wertpapierbestand zum 31.03.2022

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
<b>Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>				
<b>Aktien</b>				
<b>Vereinigte Staaten</b>				
105.000	ABBOTT LABORATORIES	USD	11.169.550,17	3,55
100.000	AMERICAN WATER WORKS CO INC	USD	14.877.095,22	4,73
22.000	ANTHEM INC	USD	9.712.703,91	3,09
68.500	BLOCK INC - A	USD	8.348.177,77	2,66
58.000	DANAHER CORP	USD	15.290.648,45	4,86
17.500	DEXCOM INC	USD	8.046.555,52	2,56
141.000	EDWARDS LIFESCIENCES CORP	USD	14.918.006,56	4,75
52.500	ETSY INC	USD	5.864.108,21	1,87
156.000	HOLOGIC INC	USD	10.770.610,70	3,42
21.500	ILLUMINA INC	USD	6.751.539,12	2,15
36.000	INTUITIVE SURGICAL INC	USD	9.760.913,14	3,10
28.000	MASTERCARD INC - A	USD	8.993.519,97	2,86
30.000	SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	USD	8.691.951,65	2,76
30.000	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	USD	15.925.493,19	5,07
36.000	UNITEDHEALTH GROUP INC	USD	16.500.175,26	5,25
47.000	VEEVA SYSTEMS INC - A	USD	8.974.628,14	2,85
34.000	VISA INC - A	USD	6.776.776,17	2,16
			<b>181.372.453,15</b>	<b>57,69</b>
<b>Dänemark</b>				
58.000	CHR HANSEN HOLDING AS	DKK	3.872.928,00	1,23
147.000	NOVO NORDISK AS - B	DKK	14.799.888,21	4,71
			<b>18.672.816,21</b>	<b>5,94</b>
<b>Niederlande</b>				
96.000	ALFEN BEHEER BV	EUR	8.860.800,00	2,82
47.000	KONINKLIJKE DSM NV	EUR	7.637.500,00	2,43
			<b>16.498.300,00</b>	<b>5,25</b>
<b>Japan</b>				
165.000	RECRUIT HOLDINGS CO LTD	JPY	6.614.764,29	2,10
284.000	SMS CO LTD	JPY	7.139.541,07	2,28
			<b>13.754.305,36</b>	<b>4,38</b>
<b>Indien</b>				
460.000	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP LTD	INR	13.041.990,82	4,15
			<b>13.041.990,82</b>	<b>4,15</b>
<b>Hongkong</b>				
1.350.000	AIA GROUP LTD	HKD	12.773.986,36	4,06
			<b>12.773.986,36</b>	<b>4,06</b>
<b>Färöer-Inseln</b>				
197.000	BAKKA Frost P/F	NOK	12.007.488,56	3,82
			<b>12.007.488,56</b>	<b>3,82</b>
<b>Schweiz</b>				
7.000	STRAUMANN HOLDING AG - REG	CHF	10.162.452,90	3,23
			<b>10.162.452,90</b>	<b>3,23</b>
<b>Irland</b>				
43.000	ICON PLC - ADR	USD	9.399.595,56	2,99
			<b>9.399.595,56</b>	<b>2,99</b>

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
<b>Vereinigtes Königreich</b>				
6.000.000	HELIOS TOWERS PLC	GBP	8.193.487,65	2,61
			<b>8.193.487,65</b>	<b>2,61</b>
<b>Schweden</b>				
75.000	MIPS AB	SEK	6.364.985,18	2,02
			<b>6.364.985,18</b>	<b>2,02</b>
<b>Deutschland</b>				
124.500	HELLOFRESH SE	EUR	5.099.520,00	1,62
			<b>5.099.520,00</b>	<b>1,62</b>
<b>Kenia</b>				
11.000.000	SAFARICOM PLC	KES	2.914.311,16	0,93
			<b>2.914.311,16</b>	<b>0,93</b>
			<b>310.255.692,91</b>	<b>98,69</b>
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>			<b>310.255.692,91</b>	<b>98,69</b>

## Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick

		% NIW
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	<b>310.255.692,91</b>	<b>98,69</b>
<b>Bankguthaben</b>	<b>3.040.276,33</b>	<b>0,97</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>	<b>1.071.331,30</b>	<b>0,34</b>
<b>Nettovermögen Gesamt</b>	<b>314.367.300,54</b>	<b>100,00</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Japan Equity

(ausgedrückt in JPY)

### Statistische Angaben

<b>Nettovermögen</b>	31.03.2022	JPY	16.192.884.145,00	Capitalisation Z (EUR)	31.03.2022	EUR	10.646,62
	30.09.2021	JPY	14.718.206.817,35		30.09.2021	EUR	10.725,11
	30.09.2020	JPY	19.403.983.805,00		30.09.2020	EUR	8.183,09
<b>Nettoinventarwert pro Anteil**</b>				Distribution P (JPY)	31.03.2022	JPY	5.472,00
					30.09.2021	JPY	5.360,00
					30.09.2020	JPY	3.996,00
Capitalisation I (EUR)	31.03.2022	EUR	53,99	Distribution R (JPY)	31.03.2022	JPY	5.505,00
	30.09.2021	EUR	54,58		30.09.2021	JPY	5.408,00
	30.09.2020	EUR	41,95		30.09.2020	JPY	4.029,00
Capitalisation I (JPY)	31.03.2022	JPY	7.247,00	<b>Anzahl der Anteile</b>	Capitalisation I (EUR)	31.03.2022	10.091
	30.09.2021	JPY	7.015,00		30.09.2021	5.335	
	30.09.2020	JPY	5.160,00		30.09.2020	30.637	
Capitalisation I Hedged (i) (PLN)	31.03.2022	PLN	64.720,84	Capitalisation I (JPY)	31.03.2022	693.768	
	30.09.2021	PLN	62.625,61	30.09.2021	632.060		
	30.09.2020	PLN	46.151,55	30.09.2020	726.809		
Capitalisation P (EUR)	31.03.2022	EUR	317,01	Capitalisation I Hedged (i) (PLN)	31.03.2022	1.863	
	30.09.2021	EUR	321,76	30.09.2021	1.938		
	30.09.2020	EUR	249,24	30.09.2020	2.420		
Capitalisation P (JPY)	31.03.2022	JPY	6.260,00	Capitalisation P (EUR)	31.03.2022	2.544	
	30.09.2021	JPY	6.084,00	30.09.2021	2.492		
	30.09.2020	JPY	4.510,00	30.09.2020	3.490		
Capitalisation R (EUR)	31.03.2022	EUR	290,95	Capitalisation P (JPY)	31.03.2022	468.045	
	30.09.2021	EUR	294,35	30.09.2021	473.570		
	30.09.2020	EUR	226,53	30.09.2020	535.218		
Capitalisation R (JPY)	31.03.2022	JPY	5.778,00	Capitalisation R (EUR)	31.03.2022	117	
	30.09.2021	JPY	5.598,00	30.09.2021	117		
	30.09.2020	JPY	4.123,00	30.09.2020	197		
Capitalisation V (EUR)	31.03.2022	EUR	184,32	Capitalisation R (JPY)	31.03.2022	26.248	
	30.09.2021	EUR	186,99	30.09.2021	28.394		
	30.09.2020	EUR	144,72	30.09.2020	29.677		
Capitalisation X (JPY)	31.03.2022	JPY	5.591,00	Capitalisation V (EUR)	31.03.2022	693	
	30.09.2021	JPY	5.448,00	30.09.2021	1.077		
	30.09.2020	JPY	4.059,00	30.09.2020	1.973		
Capitalisation X (USD)	31.03.2022	USD	146,26	Capitalisation X (JPY)	31.03.2022	188.166	
	30.09.2021	USD	155,01	30.09.2021	170.391		
	30.09.2020	USD	122,10	30.09.2020	180.493		
Capitalisation X Hedged (i) (CZK)	31.03.2022	CZK	14.474,35	Capitalisation X (USD)	31.03.2022	3.303	
	30.09.2021	CZK	13.981,87	30.09.2021	2.766		
	30.09.2020	CZK	10.450,76	30.09.2020	1.321		
Capitalisation X Hedged (i) (USD)	31.03.2022	USD	314,55	Capitalisation X Hedged (i) (CZK)	31.03.2022	6.074	
	30.09.2021	USD	306,23	30.09.2021	5.765		
	30.09.2020	USD	227,56	30.09.2020	6.390		
Capitalisation Y Hedged (i) (USD)	31.03.2022	USD	293,43				
	30.09.2021	USD	287,47				
	30.09.2020	USD	215,38				

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.



## NN (L) Japan Equity

(ausgedrückt in JPY)

### Statistische Angaben (Fortsetzung)

Anzahl der Anteile				Laufende Kosten in %*		
Capitalisation X Hedged (i) (USD)	31.03.2022	381		Capitalisation I (EUR)	31.03.2022	0,81%
	30.09.2021	287		Capitalisation I (JPY)	31.03.2022	0,81%
	30.09.2020	522		Capitalisation I Hedged (i) (PLN)	31.03.2022	0,83%
Capitalisation Y Hedged (i) (USD)	31.03.2022	1.973		Capitalisation P (EUR)	31.03.2022	1,60%
	30.09.2021	796		Capitalisation P (JPY)	31.03.2022	1,60%
	30.09.2020	855		Capitalisation R (EUR)	31.03.2022	0,95%
Capitalisation Z (EUR)	31.03.2022	1.612		Capitalisation R (JPY)	31.03.2022	0,95%
	30.09.2021	1.328		Capitalisation V (EUR)	31.03.2022	1,51%
	30.09.2020	8.223		Capitalisation X (JPY)	31.03.2022	2,10%
Distribution P (JPY)	31.03.2022	50.618		Capitalisation X (USD)	31.03.2022	2,10%
	30.09.2021	56.783		Capitalisation X Hedged (i) (CZK)	31.03.2022	2,12%
	30.09.2020	70.131		Capitalisation X Hedged (i) (USD)	31.03.2022	2,11%
Distribution R (JPY)	31.03.2022	16.422		Capitalisation Y Hedged (i) (USD)	31.03.2022	3,12%
	30.09.2021	17.382		Capitalisation Z (EUR)	31.03.2022	0,09%
	30.09.2020	16.791		Distribution P (JPY)	31.03.2022	1,60%
Dividende				Distribution R (JPY)	31.03.2022	0,95%
				<b>Portfolioumsatz in %*</b>	31.03.2022	40,09%
Distribution P (JPY)	14.12.2021	JPY	42,00			
Distribution R (JPY)	14.12.2021	JPY	74,00			

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

## NN (L) Japan Equity

(ausgedrückt in JPY)

### Finanzabschlüsse

#### Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022

	Erläuterungen	
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	2	<b>15.573.897.152,00</b>
Aktien		15.573.897.152,00
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	2	<b>266.930.819,25</b>
Devisentermingeschäfte		266.930.819,25
<b>Bankguthaben</b>		<b>119.742.726,00</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte</b>	4	<b>714.733.736,75</b>
<b>Vermögenswerte Gesamt</b>		<b>16.675.304.434,00</b>
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>	4,12	<b>(482.420.289,00)</b>
<b>Verbindlichkeiten Gesamt</b>		<b>(482.420.289,00)</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Berichtszeitraums</b>		<b>16.192.884.145,00</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Japan Equity

(ausgedrückt in JPY)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in JPY	% NIW	Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in JPY	% NIW
<b>Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>									
<b>Aktien</b>									
<b>Japan</b>									
36.800	ADEKA CORP	JPY	99.456.224,00	0,61	28.000	NEC CORP	JPY	143.864.782,00	0,89
34.100	AISIN CORP	JPY	142.826.772,00	0,88	58.200	NGK SPARK PLUG CO LTD	JPY	114.881.162,00	0,71
11.400	ALPEN CO LTD	JPY	23.318.027,00	0,14	41.700	NHK SPRING CO LTD	JPY	36.706.516,00	0,23
33.900	ARCLAND SAKAMOTO CO LTD	JPY	51.341.468,00	0,32	24.200	NICHIHA CORP	JPY	60.675.075,00	0,37
27.100	BANDAI NAMCO HOLDINGS INC	JPY	251.015.002,00	1,55	36.600	NIHON UNISYS LTD	JPY	113.818.461,00	0,70
17.100	CHUBU STEEL PLATE CO LTD	JPY	14.686.392,00	0,09	5.200	NINTENDO CO LTD	JPY	319.696.983,00	1,97
90.100	DAI-ICHI LIFE HOLDINGS INC	JPY	224.188.543,00	1,38	18.200	NIPPON SHINYAKU CO LTD	JPY	151.536.377,00	0,94
151.600	DAIICHI SANKYO CO LTD	JPY	405.788.227,00	2,51	168.400	NIPPON TELEGRAPH & TELEPHONE CORP	JPY	596.669.052,00	3,68
107.200	DAIWA HOUSE INDUSTRY CO LTD	JPY	342.317.409,00	2,11	10.800	NIPPON YUSEN KK	JPY	116.194.030,00	0,72
43.900	DENSO CORP	JPY	343.362.267,00	2,12	32.200	NISSHINBO HOLDINGS INC	JPY	34.179.906,00	0,21
38.000	FCC CO LTD	JPY	50.875.226,00	0,31	17.500	NITTO DENKO CORP	JPY	154.028.382,00	0,95
32.700	FUJI MEDIA HOLDINGS INC	JPY	38.325.671,00	0,24	22.200	NOK CORP	JPY	25.395.971,00	0,16
5.700	FUJI SOFT INC	JPY	34.974.419,00	0,22	6.500	NS SOLUTIONS CORP	JPY	23.866.029,00	0,15
53.000	FUJIFILM HOLDINGS CORP	JPY	396.806.038,00	2,45	27.900	OKAMURA CORP	JPY	33.674.413,00	0,21
16.500	FURUKAWA CO LTD	JPY	21.215.290,00	0,13	18.200	OSAKA STEEL CO LTD	JPY	28.316.155,00	0,17
5.200	FUYO GENERAL LEASE CO LTD	JPY	36.299.150,00	0,22	8.000	PALTAC CORP	JPY	36.299.440,00	0,22
10.300	GOLDCREST CO LTD	JPY	17.353.715,00	0,11	60.900	PAN PACIFIC INTERNATIONAL HOLDINGS CORP	JPY	119.329.764,00	0,74
26.300	GS YUASA CORP	JPY	61.366.789,00	0,38	20.000	ROHM CO LTD	JPY	190.958.076,00	1,18
7.300	GUNZE LTD	JPY	27.308.672,00	0,17	21.200	SANYO SPECIAL STEEL CO LTD	JPY	45.083.009,00	0,28
9.400	HAMAKYOREX CO LTD	JPY	26.949.048,00	0,17	32.500	SBI HOLDINGS INC/JAPAN	JPY	100.624.215,00	0,62
97.000	HASEKO CORP	JPY	136.240.617,00	0,84	54.000	SEINO HOLDINGS CO LTD	JPY	59.967.060,00	0,37
56.600	HITACHI LTD	JPY	348.179.144,00	2,15	31.600	SEKISUI HOUSE LTD	JPY	74.846.300,00	0,46
14.400	HOKKOKU FINANCIAL HOLDINGS INC	JPY	44.062.415,00	0,27	38.700	SEVEN & I HOLDINGS CO LTD	JPY	224.610.853,00	1,39
101.700	HONDA MOTOR CO LTD	JPY	351.997.682,00	2,17	26.500	SHIN-ETSU CHEMICAL CO LTD	JPY	496.424.400,00	3,07
69.000	IHI CORP	JPY	203.859.012,00	1,26	55.500	SHINKO ELECTRIC INDUSTRIES CO LTD	JPY	323.358.753,00	2,00
223.500	INPEX CORP	JPY	324.469.398,00	2,00	17.400	SOFTBANK GROUP CORP	JPY	95.986.835,00	0,59
192.600	ISETAN MITSUKOSHI HOLDINGS LTD	JPY	185.867.920,00	1,15	39.200	SOMPO HOLDINGS INC	JPY	210.154.710,00	1,30
150.600	ISUZU MOTORS LTD	JPY	237.973.779,00	1,47	35.000	SONY GROUP CORP	JPY	440.070.794,00	2,72
81.300	ITOCHU CORP	JPY	336.993.508,00	2,08	58.400	STARTS CORP INC	JPY	139.915.867,00	0,86
12.200	KI-STAR REAL ESTATE CO LTD	JPY	64.166.297,00	0,40	112.800	SUMCO CORP	JPY	227.563.971,00	1,41
12.100	KOHNAN SHOJI CO LTD	JPY	42.317.357,00	0,26	27.300	SUMITOMO METAL MINING CO LTD	JPY	168.894.283,00	1,04
65.900	KOMATSU LTD	JPY	193.506.835,00	1,20	74.500	SUMITOMO MITSUI FINANCIAL GROUP INC	JPY	289.988.500,00	1,79
11.000	KONOIKE TRANSPORT CO LTD	JPY	12.689.636,00	0,08	57.100	SUMITOMO MITSUI TRUST HOLDINGS INC	JPY	228.595.414,00	1,41
165.400	K'S HOLDINGS CORP	JPY	208.613.005,00	1,29	78.800	TADANO LTD	JPY	80.977.316,00	0,50
84.000	KUBOTA CORP	JPY	192.985.671,00	1,19	25.000	TAIYO YUDEX CO LTD	JPY	138.381.679,00	0,85
13.300	KUMAGAI GUMI CO LTD	JPY	35.981.973,00	0,22	20.900	TAKARA HOLDINGS INC	JPY	22.961.843,00	0,14
10.800	KYOCERA CORP	JPY	74.160.482,00	0,46	36.900	TBS HOLDINGS INC	JPY	65.841.560,00	0,41
43.500	KYUSHU ELECTRIC POWER CO INC	JPY	35.554.261,00	0,22	98.600	T&D HOLDINGS INC	JPY	164.073.537,00	1,01
11.800	MABUCHI MOTOR CO LTD	JPY	45.076.629,00	0,28	29.300	TDK CORP	JPY	130.018.929,00	0,80
211.700	MARUBENI CORP	JPY	300.833.687,00	1,86	92.000	TOKAI CARBON CO LTD	JPY	105.667.718,00	0,65
53.400	MATSUYA CO LTD	JPY	40.871.553,00	0,25	65.800	TOKIO MARINE HOLDINGS INC	JPY	467.636.948,00	2,89
277.600	MEBUKI FINANCIAL GROUP INC	JPY	70.938.528,00	0,45	24.800	TOKYO SEIMITSU CO LTD	JPY	120.355.843,00	0,74
39.400	MINEBEA MITSUMI INC	JPY	105.925.884,00	0,65	255.800	TOKYU FUDOSAN HOLDINGS CORP	JPY	172.117.640,00	1,07
97.400	MITSUBISHI CHEMICAL HOLDINGS CORP	JPY	79.382.210,00	0,49	18.900	TOYOTA INDUSTRIES CORP	JPY	159.673.512,00	0,99
89.300	MITSUBISHI CORP	JPY	409.844.519,00	2,53	2.000	TSUTSUMI JEWELRY CO LTD	JPY	3.765.729,00	0,02
243.400	MITSUBISHI ESTATE CO LTD	JPY	441.522.870,00	2,73	12.400	WACOAL HOLDINGS CORP	JPY	22.795.383,00	0,14
45.800	MITSUBISHI GAS CHEMICAL CO INC	JPY	95.236.742,00	0,59	3.700	WACOM CO LTD	JPY	3.489.100,00	0,02
31.800	MITSUBISHI HEAVY INDUSTRIES LTD	JPY	127.864.288,00	0,79	43.000	WEST JAPAN RAILWAY CO	JPY	218.232.679,00	1,35
602.820	MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP INC	JPY	455.391.600,00	2,82	44.200	ZEON CORP	JPY	60.123.491,00	0,37
86.700	mitsui & CO LTD	JPY	287.357.281,00	1,77				<b>15.573.897.152,00</b>	<b>96,18</b>
22.500	mitsui chemicals inc	JPY	69.373.765,00	0,43				<b>15.573.897.152,00</b>	<b>96,18</b>
4.400	mitsui-soko holdings co ltd	JPY	11.049.499,00	0,07					
10.600	mizuho leasing co ltd	JPY	31.546.311,00	0,19					
					<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>			<b>15.573.897.152,00</b>	<b>96,18</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Japan Equity

(ausgedrückt in JPY)

### Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022

Zu erhalten	Zu zahlen	Fälligkeits- datum	Engagement in JPY	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in JPY
<b>Devisentermingeschäfte</b>				
135.862.136,10 PLN	3.695.886.730,00 JPY	05/04/2022	3.695.886.730,00	260.840.302,00
95.330.655,64 CZK	481.917.867,00 JPY	05/04/2022	481.917.867,00	45.096.947,00
824.132,39 USD	95.062.700,00 JPY	19/04/2022	95.062.700,00	4.941.231,00
2.562.707,00 JPY	461.965,45 CZK	19/04/2022	2.562.707,00	13.693,00
14.019.012,00 JPY	120.349,96 USD	19/04/2022	14.019.012,00	(584.793,00)
86.299.603,69 CZK	478.791.943,00 JPY	19/04/2022	478.791.943,00	(2.611.536,00)
523.456.092,00 JPY	95.330.655,64 CZK	05/04/2022	523.456.092,00	(3.558.722,00)
121.802.261,97 PLN	3.547.819.015,00 JPY	19/04/2022	3.547.819.015,00	(6.128.981,00)
3.925.649.711,00 JPY	135.862.136,10 PLN	05/04/2022	3.925.649.711,00	(31.077.321,75)
			<b>12.765.165.777,00</b>	<b>266.930.819,25</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>			<b>266.930.819,25</b>	

### Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick

		% NIW
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	<b>15.573.897.152,00</b>	<b>96,18</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	<b>266.930.819,25</b>	<b>1,65</b>
<b>Bankguthaben</b>	<b>119.742.726,00</b>	<b>0,74</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>	<b>232.313.447,75</b>	<b>1,43</b>
<b>Nettovermögen Gesamt</b>	<b>16.192.884.145,00</b>	<b>100,00</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Multi Asset Factor Opportunities

(ausgedrückt in USD)

### Statistische Angaben

<b>Nettovermögen</b>	31.03.2022	USD	342.186.088,78	<b>Anzahl der Anteile</b>		
	30.09.2021	USD	334.373.660,66			
	30.09.2020	USD	208.557.447,43			
<b>Nettoinventarwert pro Anteil**</b>				Capitalisation I Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	-
					30.09.2021	-
					30.09.2020	60
Capitalisation I (USD)	31.03.2022	USD	6.224,03	Capitalisation I Hedged (i) (GBP)	31.03.2022	104.385
	30.09.2021	USD	6.229,45		30.09.2021	94.912
	30.09.2020	USD	5.517,29		30.09.2020	40.218
Capitalisation I Hedged (i) (CHF)	31.03.2022	CHF	-	Capitalisation I Hedged (i) (PLN)	31.03.2022	962
	30.09.2021	CHF	-		30.09.2021	887
	30.09.2020	CHF	4.326,75		30.09.2020	1.845
Capitalisation I Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	EUR	-	Capitalisation P (USD)	31.03.2022	239
	30.09.2021	EUR	-		30.09.2021	14
	30.09.2020	EUR	4.260,88		30.09.2020	23
Capitalisation I Hedged (i) (GBP)	31.03.2022	GBP	97,04	Capitalisation P Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	4.527
	30.09.2021	GBP	97,39		30.09.2021	3.202
	30.09.2020	GBP	86,65		30.09.2020	2.095
Capitalisation I Hedged (i) (PLN)	31.03.2022	PLN	20.374,43	Capitalisation R Hedged (i) (GBP)	31.03.2022	-
	30.09.2021	PLN	20.393,00		30.09.2021	-
	30.09.2020	PLN	18.188,34		30.09.2020	73
Capitalisation P (USD)	31.03.2022	USD	226,62	Capitalisation X (USD)	31.03.2022	-
	30.09.2021	USD	227,66		30.09.2021	-
	30.09.2020	USD	203,25		30.09.2020	6.633
Capitalisation P Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	EUR	220,93	Capitalisation Z Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	50.455
	30.09.2021	EUR	223,71		30.09.2021	47.191
	30.09.2020	EUR	201,67		30.09.2020	29.905
Capitalisation R Hedged (i) (GBP)	31.03.2022	GBP	-			
	30.09.2021	GBP	-			
	30.09.2020	GBP	83,33			
Capitalisation X (USD)	31.03.2022	USD	-	<b>Laufende Kosten in %*</b>		
	30.09.2021	USD	-	Capitalisation I (USD)	31.03.2022	0,80%
	30.09.2020	USD	199,05	Capitalisation I Hedged (i) (GBP)	31.03.2022	0,83%
Capitalisation Z Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	EUR	5.753,03	Capitalisation I Hedged (i) (PLN)	31.03.2022	0,83%
	30.09.2021	EUR	5.787,16	Capitalisation P (USD)	31.03.2022	1,56%
	30.09.2020	EUR	5.144,12	Capitalisation P Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	1,57%
<b>Anzahl der Anteile</b>				Capitalisation Z Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	0,23%
	31.03.2022		2			
	30.09.2021		2	<b>Portfolioumsatz in %*</b>	31.03.2022	(38,41%)
			1.684			
Capitalisation I Hedged (i) (CHF)	31.03.2022		-			
	30.09.2021		-			
	30.09.2020		755			

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

## NN (L) Multi Asset Factor Opportunities

(ausgedrückt in USD)

### Finanzabschlüsse

#### Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022

	Erläuterungen	
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	2	<b>213.876.293,00</b>
Anleihen und andere Schuldtitel		61.201,57
Geldmarktinstrumente		213.815.091,43
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	2	<b>14.768.689,81</b>
Total Return Swaps		6.460.818,58
Futures		8.307.871,23
<b>Bankguthaben</b>		<b>73.582.167,68</b>
<b>Hinterlegte Sicherheiten</b>		<b>31.490.354,21</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte</b>	4, 12	<b>55.112.259,74</b>
<b>Vermögenswerte Gesamt</b>		<b>388.829.764,44</b>
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>	4, 12	<b>(43.461.668,99)</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	2	<b>(3.182.006,67)</b>
Devisentermingeschäfte		(3.182.006,67)
<b>Verbindlichkeiten Gesamt</b>		<b>(46.643.675,66)</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Berichtszeitraums</b>		<b>342.186.088,78</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Multi Asset Factor Opportunities

(ausgedrückt in USD)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW
<b>Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>				
<b>Anleihen und andere Schuldtitel</b>				
<b>Vereinigte Staaten</b>				
10.300	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 2.500% 15/02/2045	USD	10.032,84	0,01
8.900	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 3.125% 15/11/2041	USD	9.592,53	0,00
7.300	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 5.250% 15/02/2029	USD	8.591,19	0,00
7.300	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 5.250% 15/11/2028	USD	8.546,70	0,00
6.700	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 6.125% 15/08/2029	USD	8.381,28	0,00
6.800	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 6.625% 15/02/2027	USD	8.071,81	0,00
6.800	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 6.750% 15/08/2026	USD	7.985,22	0,00
			<b>61.201,57</b>	<b>0,01</b>
			<b>61.201,57</b>	<b>0,01</b>
<b>Geldmarktinstrumente</b>				
<b>Niederlande</b>				
13.000.000	ABN AMRO BANK NV ZCP 12/07/2022	USD	12.957.080,24	3,79
15.000.000	COOPERATIEVE RABOBANK UA ZCP 15/03/2023 (1)	USD	14.679.105,00	4,29
15.000.000	ING BANK NV ZCP 01/11/2022	USD	14.855.296,35	4,34
			<b>42.491.481,59</b>	<b>12,42</b>
<b>Frankreich</b>				
15.000.000	BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL SA ZCP 03/06/2022	USD	14.976.012,45	4,37
13.000.000	BPCÉ SA ZCP 03/01/2023	USD	12.760.609,03	3,73
12.000.000	METROPOLE DE LYON ZCP 14/04/2022	USD	11.998.534,32	3,51
			<b>39.735.155,80</b>	<b>11,61</b>
<b>Australien</b>				
12.000.000	ANZ BANKING GROUP ZCP 07/06/2022	USD	11.979.282,60	3,50
13.000.000	BANK OF CHINA LTD ZCP 14/04/2022 (1)	USD	12.997.942,88	3,80
14.000.000	MIZUHO BANK LTD ZCP 25/04/2022	USD	13.995.512,44	4,09
			<b>38.972.737,92</b>	<b>11,39</b>
<b>Kanada</b>				
10.000.000	TORONTO-DOMINION BANK/THE ZCP 14/11/2022	USD	9.895.515,40	2,89
7.000.000	TORONTO-DOMINION BANK/THE ZCP 28/07/2022	USD	6.973.208,34	2,04
			<b>16.868.723,74</b>	<b>4,93</b>
<b>Vereinigtes Königreich</b>				
15.000.000	QATAR NATIONAL BANK ZCP 28/06/2022 (1)	USD	14.960.227,05	4,37
			<b>14.960.227,05</b>	<b>4,37</b>
<b>Schweden</b>				
15.000.000	SWEDBANK AB ZCP 15/08/2022	USD	14.922.234,00	4,36
			<b>14.922.234,00</b>	<b>4,36</b>
<b>Norwegen</b>				
15.000.000	DNB BANK ASA ZCP 19/10/2022	USD	14.873.541,90	4,35
			<b>14.873.541,90</b>	<b>4,35</b>

(1) Kurzfristiges Einlagezertifikat.

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW
<b>Dänemark</b>				
13.000.000	DANSKE BANK AS ZCP 05/04/2022	USD	12.999.547,34	3,80
			<b>12.999.547,34</b>	<b>3,80</b>
<b>Deutschland</b>				
13.000.000	HSH PORTFOLIOMANAGEMENT AOER ZCP 12/05/2022	USD	12.992.476,64	3,80
			<b>12.992.476,64</b>	<b>3,80</b>
<b>Luxemburg</b>				
5.000.000	INDUSTRIAL AND COMMERCIAL BANK OF CHINA ZCP 15/04/2022 (1)	USD	4.998.965,45	1,46
			<b>4.998.965,45</b>	<b>1,46</b>
			<b>213.815.091,43</b>	<b>62,49</b>
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>			<b>213.876.293,00</b>	<b>62,50</b>

### Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022

Stückzahl	Bezeichnung	Fälligkeits- datum	Währung	Nennwert	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in USD
<b>Total Return Swaps</b>					
3.342.605	TRS COMMODITY ENHANCED CURVE INDEX	28/07/2022	USD	371.676.948,62	31.709.621,94
442.634	TRS SUGAR CAPPED INDEX	26/05/2022	USD	56.545.000,00	4.639.553,67
637.347	TRS SOYBEAN MEAL CAPPED INDEX	26/05/2022	USD	67.421.000,00	4.503.558,76
222.536	TRS ZINC CAPPED INDEX	26/05/2022	USD	40.831.000,00	4.158.368,80
394.611	TRS SOYBEANS CAPPED INDEX	26/05/2022	USD	84.928.000,00	4.120.292,56
566.072	TRS LEAN HOGS CAPPED INDEX	26/05/2022	USD	35.808.000,00	2.060.217,49
132.160	TRS CORN CAPPED INDEX	26/05/2022	USD	14.168.000,00	1.148.541,06
57.909	TRS COPPER CAPPED INDEX	26/05/2022	USD	12.835.000,00	965.496,47
53.106	TRS COTTON CAPPED INDEX	26/05/2022	USD	6.967.000,00	686.091,92
7.686	TRS ALUMINUM SUBINDEX CAPPED INDEX	26/05/2022	USD	974.000,00	60.353,08
193.000	TRS HEATING OIL CAPPED INDEX	26/05/2022	USD	1.229,53	(21.651,72)
543.000	TRS GOLD CAPPED INDEX	26/05/2022	USD	2.711,27	(34.909,10)
4.654.000	TRS NATURAL GAS CAPPED INDEX	26/05/2022	USD	133.500,86	(565.362,97)
14.596.000	TRS SOYBEAN OIL CAPPED INDEX	26/05/2022	USD	98.743,04	(617.122,94)
9.703.000	TRS UNLEADED GASOLINE CAPPED INDEX	26/05/2022	USD	47.753,15	(710.562,85)
17.777.000	TRS LIVE CATTLE CAPPED INDEX	26/05/2022	USD	154.364,77	(926.067,08)
18.682.000	TRS SILVER CAPPED INDEX	26/05/2022	USD	93.722,65	(1.118.756,15)
11.581.000	TRS GAS OIL CAPPED INDEX	26/05/2022	USD	82.288,41	(1.269.627,15)
8.774.000	TRS NICKEL CAPPED INDEX	26/05/2022	USD	36.917,98	(1.343.534,86)
21.349.000	TRS WTI CRUDE OIL CAPPED INDEX	26/05/2022	USD	174.132,28	(1.637.053,01)
42.777.000	TRS COFFEE CAPPED INDEX	26/05/2022	USD	408.490,09	(1.706.590,41)
18.201.000	TRS BRENT CRUDE CAPPED INDEX	26/05/2022	USD	204.435,79	(1.724.927,14)
23.263.000	TRS WHEAT CAPPED INDEX	26/05/2022	USD	256.489,70	(1.828.207,49)
29.927.000	TRS KANSAS WHEAT CAPPED INDEX	26/05/2022	USD	415.063,03	(2.229.676,21)

## NN (L) Multi Asset Factor Opportunities

(ausgedrückt in USD)

### Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl	Bezeichnung	Fälligkeitsdatum	Währung	Nennwert	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in USD	
370.161.950	TRS COMMODITY INDEX	28/07/2022	USD	3.231.382,28	(31.857.228,09)	
					<b>6.460.818,58</b>	
Zu erhalten	Zu zahlen	Fälligkeitsdatum	Engagement in USD	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in USD		
<b>Devisentermingeschäfte</b>						
6.188.182.000,00	JPY	50.090.136,12	USD	28/04/2022	50.090.136,12	917.249,49
34.640.000,00	GBP	45.362.008,35	USD	28/04/2022	45.362.008,35	239.679,86
24.965.067,41	PLN	5.879.301,43	USD	19/04/2022	5.879.301,43	103.217,01
1.888.889,91	USD	2.250.159.000,00	KRW	21/04/2022	1.888.889,91	34.924,19
3.484.193,25	NZD	2.400.196,62	USD	28/04/2022	2.400.196,62	22.366,49
1.868.883,78	USD	1.410.271,53	GBP	19/04/2022	1.868.883,78	12.247,08
12.904.000,00	CAD	10.319.303,43	USD	28/04/2022	10.319.303,43	10.565,53
1.856.444,29	USD	2.250.159.000,00	KRW	30/06/2022	1.856.444,29	3.042,92
60.555,97	USD	54.239,75	EUR	04/04/2022	60.555,97	206,10
26.171,34	USD	19.865,90	GBP	04/04/2022	26.171,34	14,89
2.250.159.000,00	KRW	1.856.873,25	USD	21/04/2022	1.856.873,25	(2.907,53)
18.148.793,61	USD	24.181.889,76	AUD	28/04/2022	18.148.793,61	(15.733,32)
1.121.616,34	USD	4.915.725,90	PLN	19/04/2022	1.121.616,34	(56.366,49)
11.636.497,07	GBP	15.521.904,74	USD	19/04/2022	15.521.904,74	(202.338,94)
32.031.912,77	USD	28.972.438,89	EUR	19/04/2022	32.031.912,77	(218.273,83)
26.580.892,77	USD	250.405.000,00	SEK	28/04/2022	26.580.892,77	(299.901,34)
344.705.000,00	NOK	39.716.979,09	USD	28/04/2022	39.716.979,09	(307.493,15)
53.529.980,72	USD	48.609.000,00	EUR	28/04/2022	53.529.980,72	(593.016,06)
322.862.047,18	EUR	360.099.661,05	USD	19/04/2022	360.099.661,05	(711.163,97)
129.078.208,19	USD	120.636.000,00	CHF	28/04/2022	129.078.208,19	(2.118.325,60)
					<b>797.438.713,77</b>	<b>(3.182.006,67)</b>

Stückzahl	Bezeichnung	Währung	Engagement in USD	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in USD
<b>Futures auf Aktienindizes</b>				
467	EURO STOXX 50 17/06/2022	EUR	19.864.596,28	1.199.486,75
(92)	CBOE VIX FUTURE 18/05/2022	USD	2.298.868,40	36.631,60
(140)	CBOE VIX FUTURE 20/04/2022	USD	3.285.660,00	90.140,00
(216)	FTSE 100 INDEX FUTURE 17/06/2022	GBP	21.289.913,74	(809.140,65)
64	HANG SENG INDEX FUTURE 28/04/2022	HKD	8.985.366,60	77.348,88
(398)	KOSPI2 INDEX FUTURE 09/06/2022	KRW	30.021.162,49	(1.094.832,60)
132	NIKKEI 225 (SGX) 09/06/2022	JPY	15.114.067,97	1.546.615,86
557	OMXS30 INDEX FUTURE 13/04/2022	SEK	12.461.585,51	218.152,46

Stückzahl	Bezeichnung	Währung	Engagement in USD	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in USD
54	SPI 200 FUTURES 16/06/2022	AUD	7.582.079,01	364.961,69
(201)	S&P/TSX 60 IX FUTURE 16/06/2022	CAD	42.390.152,52	(516.368,44)
(136)	S&P500 EMINI FUTURE 17/06/2022	USD	30.809.100,00	(345.927,50)
117	SWISS MARKET INDEX FUTURE 17/06/2022	CHF	15.299.951,10	765.378,97
			<b>209.402.503,62</b>	<b>1.532.447,02</b>

### Zins-Futures

771	AUSTRALIA 10Y BOND FUTURE 15/06/2022	AUD	73.381.985,36	(2.889.023,43)
(483)	CANADA 10YR BOND FUTURE 21/06/2022	CAD	50.486.753,93	2.168.992,43
(195)	EURO-BTP FUTURE 08/06/2022	EUR	30.008.670,65	1.082.107,74
(174)	EURO-BUND FUTURE 08/06/2022	EUR	30.716.749,97	1.407.479,97
(189)	EURO-OAT FUTURE 08/06/2022	EUR	31.861.166,10	1.280.671,25
998	KOREA 10YR BOND FUTURE 21/06/2022	KRW	96.337.609,83	(2.124.178,05)
(891)	LONG GILT FUTURE 28/06/2022	GBP	142.219.169,11	1.841.334,96
(1.238)	US 10YR NOTE (CBT) 21/06/2022	USD	152.119.250,00	4.008.039,34
			<b>607.131.354,95</b>	<b>6.775.424,21</b>

**Derivative Finanzinstrumente Gesamt 11.586.683,14**

### Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick

		% NIW
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	<b>213.876.293,00</b>	<b>62,50</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	<b>11.586.683,14</b>	<b>3,39</b>
<b>Bankguthaben</b>	<b>73.582.167,68</b>	<b>21,50</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>	<b>43.140.944,96</b>	<b>12,61</b>
<b>Nettovermögen Gesamt</b>	<b>342.186.088,78</b>	<b>100,00</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.



## NN (L) Multi Asset High Income

(ausgedrückt in EUR)

### Statistische Angaben

Portfolioumsatz in %\* 31.03.2022 156,68%

<b>Nettovermögen</b>	31.03.2022	EUR	5.561.195,55
	30.09.2021	EUR	5.652.977,10
	30.09.2020	EUR	5.067.310,90
<b>Nettoinventarwert pro Anteil**</b>			
Capitalisation I (EUR)	31.03.2022	EUR	5.343,77
	30.09.2021	EUR	5.447,87
	30.09.2020	EUR	4.903,64
Capitalisation P (EUR)	31.03.2022	EUR	255,65
	30.09.2021	EUR	261,54
	30.09.2020	EUR	236,99
Capitalisation Z (EUR)	31.03.2022	EUR	5.546,35
	30.09.2021	EUR	5.637,50
	30.09.2020	EUR	5.043,76
Distribution X (EUR)	31.03.2022	EUR	193,94
	30.09.2021	EUR	207,20
	30.09.2020	EUR	197,57
<b>Anzahl der Anteile</b>			
Capitalisation I (EUR)	31.03.2022		7
	30.09.2021		7
	30.09.2020		7
Capitalisation P (EUR)	31.03.2022		86
	30.09.2021		86
	30.09.2020		107
Capitalisation Z (EUR)	31.03.2022		991
	30.09.2021		991
	30.09.2020		991
Distribution X (EUR)	31.03.2022		13
	30.09.2021		13
	30.09.2020		33
<b>Dividende</b>			
Distribution X (EUR)	14.12.2021	EUR	8,10
<b>Laufende Kosten in %*</b>			
Capitalisation I (EUR)	31.03.2022		0,96%
Capitalisation P (EUR)	31.03.2022		1,67%
Capitalisation Z (EUR)	31.03.2022		0,36%
Distribution X (EUR)	31.03.2022		2,44%

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

## NN (L) Multi Asset High Income

(ausgedrückt in EUR)

### Finanzabschlüsse

#### Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022

	Erläuterungen	
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	2	<b>5.234.233,43</b>
Organismen für gemeinsame Anlagen		5.174.278,38
Börsengehandelte Wertpapiere		59.955,05
<b>Bankguthaben</b>		<b>298.917,69</b>
<b>Hinterlegte Sicherheiten</b>		<b>75.616,30</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte</b>	4	<b>4,51</b>
<b>Vermögenswerte Gesamt</b>		<b>5.608.771,93</b>
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>	4	<b>(12.883,81)</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	2	<b>(34.692,57)</b>
Devisentermingeschäfte		(20.502,30)
Futures		(14.190,27)
<b>Verbindlichkeiten Gesamt</b>		<b>(47.576,38)</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Berichtszeitraums</b>		<b>5.561.195,55</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Multi Asset High Income

(ausgedrückt in EUR)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>				
<b>Jersey</b>				
4.824	WISDOMTREE ALUMINIUM	USD	21.049,31	0,38
651	WISDOMTREE CARBON	USD	17.020,26	0,31
582	WISDOMTREE COPPER	USD	21.885,48	0,39
			<b>59.955,05</b>	<b>1,08</b>
			<b>59.955,05</b>	<b>1,08</b>
<b>Organismen für gemeinsame Anlagen</b>				
<b>Offene Fonds</b>				
<b>Luxemburg</b>				
57	NN (L) EMERGING MARKETS CORPORATE DEBT - Z CAP USD	USD	335.763,38	6,04
27	NN (L) EMERGING MARKETS DEBT (HARD CURRENCY) - I CAP USD	USD	194.572,53	3,50
47	NN (L) EMERGING MARKETS ENHANCED INDEX SUSTAINABLE EQUITY - I CAP EUR	EUR	256.519,42	4,61
54	NN (L) EUROPEAN ABS - I CAP EUR	EUR	283.106,88	5,09
1.198	NN (L) EUROPEAN HIGH DIVIDEND - I CAP EUR	EUR	705.885,56	12,69
75	NN (L) GLOBAL ENHANCED INDEX SUSTAINABLE EQUITY - I CAP USD	USD	493.066,78	8,87
1.636	NN (L) GLOBAL HIGH YIELD - I CAP EUR (HEDGED III)	EUR	978.916,96	17,60
1.256	NN (L) GLOBAL SUSTAINABLE EQUITY - I CAP EUR	EUR	853.740,88	15,35
715	NN (L) LIQUID EUR - B CAP EUR*	EUR	827.355,10	14,88
21	NN (L) US HIGH YIELD - Z CAP USD	USD	118.670,90	2,13
			<b>5.047.598,39</b>	<b>90,76</b>
<b>Irland</b>				
24.111	ISHARES CHINA CNY BOND UCITS ETF	USD	126.679,99	2,28
			<b>126.679,99</b>	<b>2,28</b>
			<b>5.174.278,38</b>	<b>93,04</b>
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>			<b>5.234.233,43</b>	<b>94,12</b>

### Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022

Zu erhalten	Zu zahlen	Fälligkeitsdatum	Engagement in EUR	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR
<b>Devisentermingeschäfte</b>				
33.001,14	EUR	4.300.000,00 JPY 27/05/2022	33.001,14	1.181,19
51.210,44	EUR	43.000,00 GBP 27/05/2022	51.210,44	438,05
1.296.506,55	EUR	1.470.000,00 USD 27/05/2022	1.296.506,55	(22.121,54)
			<b>1.380.718,13</b>	<b>(20.502,30)</b>

Stückzahl	Bezeichnung	Währung	Engagement in EUR	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR
<b>Futures auf Aktienindizes</b>				
(4)	EURO STOXX 50 17/06/2022	EUR	152.920,00	(1.979,59)
(1)	MSCI EMERGING MARKETS 17/06/2022	USD	50.577,45	(1.838,13)
(1)	S&P500 EMINI FUTURE 17/06/2022	USD	203.601,76	(12.444,92)
			<b>407.099,21</b>	<b>(16.262,64)</b>
<b>Zins-Futures</b>				
2	US 10YR NOTE (CBT) 21/06/2022	USD	220.869,10	(3.377,17)
(4)	US 5YR NOTE (CBT) 30/06/2022	USD	412.303,96	5.449,54
			<b>633.173,06</b>	<b>2.072,37</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>				<b>(34.692,57)</b>

### Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick

		% NIW
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	<b>5.234.233,43</b>	<b>94,12</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	<b>(34.692,57)</b>	<b>(0,62)</b>
<b>Bankguthaben</b>	<b>298.917,69</b>	<b>5,38</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>	<b>62.737,00</b>	<b>1,12</b>
<b>Nettovermögen Gesamt</b>	<b>5.561.195,55</b>	<b>100,00</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) North America Enhanced Index Sustainable Equity

(ausgedrückt in USD)

### Statistische Angaben

<b>Nettovermögen</b>	31.03.2022	USD	1.059.989.071,69	<b>Anzahl der Anteile</b>				
	30.09.2021	USD	814.352.387,74					
	30.09.2020	USD	224.022.517,51		Capitalisation R (USD)	31.03.2022	9	
<b>Nettoinventarwert pro Anteil</b>					30.09.2021	9		
					30.09.2020	29		
Capitalisation I (USD)	31.03.2022	USD	7.583,81	Capitalisation X Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	8		
	30.09.2021	USD	7.313,79		30.09.2021	8		
	30.09.2020	USD	5.742,63		30.09.2020	-		
Capitalisation I Hedged (ii) (EUR)	31.03.2022	EUR	4.772,51	Capitalisation Z (EUR)	31.03.2022	793		
	30.09.2021	EUR	-		30.09.2021	741		
	30.09.2020	EUR	-		30.09.2020	206		
Capitalisation P (USD)	31.03.2022	USD	376,03	Distribution Z (EUR)	31.03.2022	1.619		
	30.09.2021	USD	363,16		30.09.2021	1.247		
	30.09.2020	USD	286,12		30.09.2020	5.005		
Capitalisation Q (EUR)	31.03.2022	EUR	748.063,44	<b>Dividende</b>				
	30.09.2021	EUR	692.435,53		Distribution Z (EUR)	14.12.2021	EUR	56,95
	30.09.2020	EUR	537.233,63					
Capitalisation R (USD)	31.03.2022	USD	378,21	<b>Laufende Kosten in %*</b>				
	30.09.2021	USD	364,89		Capitalisation I (USD)	31.03.2022	0,19%	
	30.09.2020	USD	286,83		Capitalisation I Hedged (ii) (EUR)	31.03.2022	0,21%	
Capitalisation X Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	EUR	261,44	Capitalisation P (USD)	31.03.2022	0,53%		
	30.09.2021	EUR	255,21	Capitalisation Q (EUR)	31.03.2022	0,14%		
	30.09.2020	EUR	-	Capitalisation R (USD)	31.03.2022	0,28%		
Capitalisation Z (EUR)	31.03.2022	EUR	781.032,19	Capitalisation X Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	1,04%		
	30.09.2021	EUR	722.842,36	Capitalisation Z (EUR)	31.03.2022	0,11%		
	30.09.2020	EUR	560.663,26	Distribution Z (EUR)	31.03.2022	0,11%		
Distribution Z (EUR)	31.03.2022	EUR	7.304,39	<b>Portfolioumsatz in %*</b>				
	30.09.2021	EUR	6.812,21			31.03.2022	40,28%	
	30.09.2020	EUR	5.343,14					
<b>Anzahl der Anteile</b>								
Capitalisation I (USD)	31.03.2022		20.846					
	30.09.2021		14.196					
	30.09.2020		12					
Capitalisation I Hedged (ii) (EUR)	31.03.2022		17.605					
	30.09.2021		-					
	30.09.2020		-					
Capitalisation P (USD)	31.03.2022		9					
	30.09.2021		9					
	30.09.2020		29					
Capitalisation Q (EUR)	31.03.2022		127					
	30.09.2021		100					
	30.09.2020		91					

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

## NN (L) North America Enhanced Index Sustainable Equity

(ausgedrückt in USD)

### Finanzabschlüsse

#### Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022

	Erläuterungen	
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	2	<b>1.058.087.581,41</b>
Aktien		1.058.087.581,41
<b>Bankguthaben</b>		<b>2.111.368,99</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte</b>	4, 12	<b>9.475.544,77</b>
<b>Vermögenswerte Gesamt</b>		<b>1.069.674.495,17</b>
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>	4	<b>(8.534.461,12)</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	2	<b>(1.150.962,36)</b>
Devisentermingeschäfte		(1.150.962,36)
<b>Verbindlichkeiten Gesamt</b>		<b>(9.685.423,48)</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Berichtszeitraums</b>		<b>1.059.989.071,69</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) North America Enhanced Index Sustainable Equity

(ausgedrückt in USD)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW	Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW
<b>Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>									
<b>Aktien</b>									
<b>Vereinigte Staaten</b>									
51.190	ABBOTT LABORATORIES	USD	6.058.848,40	0,57	1.672	BOOKING HOLDINGS INC	USD	3.926.608,40	0,37
52.117	ABBVIE INC	USD	8.448.686,87	0,80	10.560	BORGWARNER INC	USD	410.784,00	0,04
13.944	ADOBE INC	USD	6.353.165,28	0,60	7.413	BOSTON PROPERTIES INC	USD	954.794,40	0,09
63.991	ADVANCED MICRO DEVICES INC	USD	6.996.775,94	0,66	13.033	BOSTON SCIENTIFIC CORP	USD	577.231,57	0,05
35.611	AFLAC INC	USD	2.292.992,29	0,22	62.984	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	USD	4.599.721,52	0,43
13.622	AGILENT TECHNOLOGIES INC	USD	1.802.599,26	0,17	723	BROWN & BROWN INC	USD	52.251,21	0,00
23.371	AGNC INVESTMENT CORP	USD	306.160,10	0,03	2.023	BROWN-FORMAN CORP - B	USD	135.581,46	0,01
7.504	AIR PRODUCTS AND CHEMICALS INC	USD	1.875.324,64	0,18	2.419	BURLINGTON STORES INC	USD	440.669,23	0,04
4.498	AKAMAI TECHNOLOGIES INC	USD	537.016,22	0,05	9.314	CADENCE DESIGN SYSTEMS INC	USD	1.531.780,44	0,14
5.556	ALBEMARLE CORP	USD	1.228.709,40	0,12	11.106	CAMPBELL SOUP CO	USD	494.994,42	0,05
8.277	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC	USD	1.665.746,25	0,16	3.611	CARMAX INC	USD	348.389,28	0,03
3.264	ALIGN TECHNOLOGY INC	USD	1.423.104,00	0,13	38.788	CARRIER GLOBAL CORP	USD	1.779.205,56	0,17
9.029	ALLSTATE CORP/THE	USD	1.250.606,79	0,12	4.367	CARVANA CO - A	USD	520.939,43	0,05
15.688	ALLY FINANCIAL INC	USD	682.114,24	0,06	6.848	CBOE GLOBAL MARKETS INC	USD	783.548,16	0,07
2.813	ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	USD	459.334,77	0,04	12.728	CBRE GROUP INC - A	USD	1.164.866,56	0,11
7.493	ALPHABET INC - A	USD	20.840.655,55	1,97	11.734	CENTENE CORP	USD	987.885,46	0,09
8.273	ALPHABET INC - C	USD	23.106.406,27	2,18	7.626	CH ROBINSON WORLDWIDE INC	USD	821.396,46	0,08
11.750	AMAZON.COM INC	USD	38.304.412,50	3,61	1.724	CHARLES RIVER LABORATORIES INTERNATIONAL INC	USD	489.564,28	0,05
26.701	AMERICAN EXPRESS CO	USD	4.993.087,00	0,47	44.656	CHARLES SCHWAB CORP/THE	USD	3.764.947,36	0,36
33.785	AMERICAN INTERNATIONAL GROUP INC	USD	2.120.684,45	0,20	3.728	CHARTER COMMUNICATIONS INC - A	USD	2.033.698,56	0,19
15.146	AMERICAN TOWER CORP	USD	3.804.978,12	0,36	14.529	CHURCH & DWIGHT CO INC	USD	1.443.892,02	0,14
4.519	AMERICAN WATER WORKS CO INC	USD	748.030,07	0,07	7.440	CIGNA CORP	USD	1.782.698,40	0,17
5.305	AMERIPRISE FINANCIAL INC	USD	1.593.409,80	0,15	3.902	CINCINNATI FINANCIAL CORP	USD	530.515,92	0,05
675	AMERISOURCEBERGEN CORP - A	USD	104.429,25	0,01	106.988	CISCO SYSTEMS INC/DELAWARE	USD	5.965.650,88	0,56
16.208	AMGEN INC	USD	3.919.418,56	0,37	17.623	CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	USD	798.850,59	0,08
60.369	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	USD	424.997,76	0,04	5.154	CLOROX CO/THE	USD	716.560,62	0,07
2.611	ANSYS INC	USD	829.384,15	0,08	13.158	CME GROUP INC - A	USD	3.129.761,88	0,30
7.446	ANTHEM INC	USD	3.657.624,12	0,35	2.928	COGNEX CORP	USD	225.895,20	0,02
417.510	APPLE INC	USD	72.901.421,10	6,89	10.453	COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORP - A	USD	937.320,51	0,09
37.080	APPLIED MATERIALS INC	USD	4.887.144,00	0,46	30.057	COLGATE-PALMOLIVE CO	USD	2.279.222,31	0,22
6.043	ARAMARK	USD	227.216,80	0,02	127.386	COMCAST CORP - A	USD	5.964.212,52	0,56
14.425	ARISTA NETWORKS INC	USD	2.004.786,50	0,19	12.367	CONSOLIDATED EDISON INC	USD	1.170.907,56	0,11
9.007	ARTHUR J GALLAGHER & CO	USD	1.572.622,20	0,15	10.423	CONSTELLATION BRANDS INC - A	USD	2.400.625,36	0,23
218.385	AT&T INC	USD	5.160.437,55	0,49	372	COOPER COS INC/THE	USD	155.343,48	0,01
6.919	AUTODESK INC	USD	1.483.087,65	0,14	41.460	CORTEVA INC	USD	2.383.120,80	0,22
9.627	AUTOMATIC DATA PROCESSING INC	USD	2.190.527,58	0,21	19.174	COSTAR GROUP INC	USD	1.277.180,14	0,12
685	AUTOZONE INC	USD	1.400.537,30	0,13	18.680	COSTCO WHOLESALE CORP	USD	10.756.878,00	1,01
6.080	AVALARA INC	USD	605.020,80	0,06	2.221	COUPA SOFTWARE INC	USD	225.720,23	0,02
5.183	AVALONBAY COMMUNITIES INC	USD	1.287.301,71	0,12	4.304	CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	USD	977.352,32	0,09
10.588	AVANTOR INC	USD	358.086,16	0,03	15.318	CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	USD	2.827.702,80	0,27
1.958	AVERY DENNISON CORP	USD	340.633,26	0,03	112.044	CSX CORP	USD	4.196.047,80	0,40
142.628	BAKER HUGHES CO - A	USD	5.193.085,48	0,49	8.649	CUMMINS INC	USD	1.773.996,39	0,17
262.635	BANK OF AMERICA CORP	USD	10.825.814,70	1,02	36.400	CVS HEALTH CORP	USD	3.684.044,00	0,35
37.938	BANK OF NEW YORK MELLON CORP/THE	USD	1.882.862,94	0,18	21.376	DANAHER CORP	USD	6.270.222,08	0,59
8.825	BAXTER INTERNATIONAL INC	USD	684.290,50	0,06	11.184	DEERE & CO	USD	4.646.504,64	0,44
6.345	BECTON DICKINSON AND CO	USD	1.687.770,00	0,16	13.852	DELL TECHNOLOGIES INC - C	USD	695.231,88	0,07
6.457	BEST BUY CO INC	USD	586.941,30	0,06	24.774	DELTA AIR LINES INC	USD	980.307,18	0,09
3.567	BILL.COM HOLDINGS INC	USD	808.959,93	0,08	5.132	DENTSPLY SIRONA INC	USD	252.597,04	0,02
5.074	BIOGEN INC	USD	1.068.584,40	0,10	4.318	DEXCOM INC	USD	2.209.088,80	0,21
8.674	BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	USD	668.765,40	0,06	721	DIGITAL REALTY TRUST INC	USD	102.237,80	0,01
727	BIO-RAD LABORATORIES INC - A	USD	409.468,21	0,04	11.994	DISCOVER FINANCIAL SERVICES	USD	1.321.618,86	0,12
1.015	BIO-TECHNE CORP	USD	439.535,60	0,04	14.418	DISH NETWORK CORP - A	USD	456.329,70	0,04
11.880	BLOCK INC - A	USD	1.610.928,00	0,15	7.959	DOCUSIGN INC - A	USD	852.568,08	0,08
					1.715	DOMINO'S PIZZA INC	USD	698.022,15	0,07
					12.192	DOVER CORP	USD	1.912.924,80	0,18
					10.482	DR HORTON INC	USD	781.013,82	0,07
					5.585	DUPONT DE NEMOURS INC	USD	410.944,30	0,04
					5.426	DYNATRACE INC	USD	255.564,60	0,02
					21.180	EBAY INC	USD	1.212.766,80	0,11
					9.759	ECOLAB INC	USD	1.723.049,04	0,16

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) North America Enhanced Index Sustainable Equity

(ausgedrückt in USD)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW	Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW
24.257	EDWARDS LIFESCIENCES CORP	USD	2.855.534,04	0,27	126.509	INTEL CORP	USD	6.269.786,04	0,59
13.394	ELANCO ANIMAL HEALTH INC	USD	349.449,46	0,03	18.260	INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	USD	2.412.511,20	0,23
6.518	ELECTRONIC ARTS INC	USD	824.592,18	0,08	15.972	INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP	USD	2.076.679,44	0,20
24.408	ELI LILLY & CO	USD	6.989.718,96	0,66	10.873	INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCES INC	USD	1.427.951,09	0,13
32.823	EMERSON ELECTRIC CO	USD	3.218.295,15	0,30	20.875	INTERNATIONAL PAPER CO	USD	963.381,25	0,09
6.588	ENPHASE ENERGY INC	USD	1.329.326,64	0,13	33.404	INTERPUBLIC GROUP OF COS INC/THE	USD	1.184.171,80	0,11
3.009	ENTEGRIS INC	USD	394.961,34	0,04	8.752	INTUIT INC	USD	4.208.311,68	0,40
2.111	EPAM SYSTEMS INC	USD	626.143,71	0,06	13.232	INTUITIVE SURGICAL INC	USD	3.991.829,76	0,38
1.024	EQUINIX INC	USD	759.418,88	0,07	6.479	IQVIA HOLDINGS INC	USD	1.498.009,59	0,14
29.089	EQUITABLE HOLDINGS INC	USD	899.140,99	0,08	10.165	IRON MOUNTAIN INC	USD	563.242,65	0,05
17.680	EQUITY RESIDENTIAL	USD	1.589.785,60	0,15	7.624	J M SMUCKER CO/THE	USD	1.032.365,84	0,10
127.985	ESSENTIAL UTILITIES INC	USD	6.543.873,05	0,62	93.435	JPMORGAN CHASE & CO	USD	12.737.059,20	1,20
1.964	ESSEX PROPERTY TRUST INC	USD	678.522,72	0,06	42.118	KEURIG DR PEPPER INC	USD	1.596.272,20	0,15
6.645	ETSY INC	USD	825.840,60	0,08	21.630	KEYCORP	USD	484.079,40	0,05
7.584	EXACT SCIENCES CORP	USD	530.273,28	0,05	5.343	KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	USD	844.033,71	0,08
8.236	EXPEDIA GROUP INC	USD	1.611.538,12	0,15	6.088	KIMCO REALTY CORP	USD	150.373,60	0,01
10.832	EXPEDITORS INTERNATIONAL OF WASHINGTON INC	USD	1.117.429,12	0,11	603.590	KINDER MORGAN INC/DE	USD	11.413.886,90	1,09
26.292	FASTENAL CO	USD	1.561.744,80	0,15	7.186	KLA CORP	USD	2.630.507,16	0,25
9.569	FEDEX CORP	USD	2.214.170,91	0,21	41.352	KROGER CO/THE	USD	2.372.364,24	0,22
11.136	FIDELITY NATIONAL FINANCIAL INC	USD	543.882,24	0,05	2.678	LABORATORY CORP OF AMERICA HOLDINGS	USD	706.081,48	0,07
18.791	FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES INC	USD	1.886.992,22	0,18	5.100	LAM RESEARCH CORP	USD	2.741.811,00	0,26
38.767	FIFTH THIRD BANCORP	USD	1.668.531,68	0,16	23.207	LEAR CORP	USD	3.309.086,13	0,31
5.868	FIRST REPUBLIC BANK/CA	USD	951.202,80	0,09	12.139	LENNAR CORP - A	USD	985.322,63	0,09
16.460	FISERV INC	USD	1.669.044,00	0,16	4.847	LIBERTY BROADBAND CORP - C	USD	655.896,04	0,06
285	FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	USD	70.982,10	0,01	1.236	LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM - C	USD	56.522,28	0,01
9.456	FMC CORP	USD	1.244.125,92	0,12	12.774	LINCOLN NATIONAL CORP	USD	834.908,64	0,08
264.663	FORD MOTOR CO	USD	4.475.451,33	0,43	20.791	LKQ CORP	USD	944.119,31	0,09
6.945	FORTINET INC	USD	2.373.384,30	0,22	22.920	LOWE'S COS INC	USD	4.634.194,80	0,44
15.638	FORTIVE CORP	USD	952.823,34	0,09	5.553	LULULEMON ATHLETICA INC	USD	2.028.122,19	0,19
11.634	FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	USD	864.173,52	0,08	25.584	LYFT INC - A	USD	982.425,60	0,09
18.132	FOX CORP - A	USD	715.307,40	0,07	572	MARKEL CORP	USD	843.837,28	0,08
9.499	FRANKLIN RESOURCES INC	USD	265.212,08	0,03	1.425	MARKETAXESS HOLDINGS INC	USD	484.785,00	0,05
1.814	GARTNER INC	USD	539.592,44	0,05	13.444	MARRIOTT INTERNATIONAL INC/MD - A	USD	2.362.783,00	0,22
4.009	GENERAC HOLDINGS INC	USD	1.191.715,34	0,11	20.122	MARSH & MCLENNAN COS INC	USD	3.429.191,24	0,32
32.257	GENERAL MILLS INC	USD	2.184.444,04	0,21	7.310	MASCO CORP	USD	372.810,00	0,04
38.865	GILEAD SCIENCES INC	USD	2.310.524,25	0,22	1.619	MASIMO CORP	USD	235.629,26	0,02
9.435	GLOBAL PAYMENTS INC	USD	1.291.085,40	0,12	21.216	MASTERCARD INC - A	USD	7.582.174,08	0,72
10.210	GODADDY INC - A	USD	854.577,00	0,08	12.960	MATCH GROUP INC	USD	1.409.270,40	0,13
225.453	HALLIBURTON CO	USD	8.537.905,11	0,81	12.987	MCCORMICK & CO INC/MD	USD	1.296.102,60	0,12
12.456	HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP INC/THE	USD	894.465,36	0,08	23.666	MCDONALD'S CORP	USD	5.852.128,48	0,55
5.891	HASBRO INC	USD	482.590,72	0,05	68.836	MERCK & CO INC	USD	5.647.993,80	0,53
8.480	HCA HEALTHCARE INC	USD	2.125.257,60	0,20	33.417	METLIFE INC	USD	2.348.546,76	0,22
20.341	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	USD	698.306,53	0,07	605	METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL INC	USD	830.779,95	0,08
13.045	HERSHEY CO/THE	USD	2.825.938,35	0,27	181.441	MICROSOFT CORP	USD	55.940.074,71	5,28
16.733	HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	USD	279.608,43	0,03	81.740	MONDELEZ INTERNATIONAL INC - A	USD	5.131.637,20	0,48
14.073	HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	USD	2.135.437,02	0,20	4.635	MONGODB INC - A	USD	2.056.039,65	0,19
7.185	HOLOGIC INC	USD	551.951,70	0,05	14.919	MONSTER BEVERAGE CORP	USD	1.192.028,10	0,11
29.262	HOME DEPOT INC/THE	USD	8.758.994,46	0,83	6.990	MOODY'S CORP	USD	2.358.495,90	0,22
46.283	HOST HOTELS & RESORTS INC	USD	899.278,69	0,08	58.290	MORGAN STANLEY	USD	5.094.546,00	0,48
36.207	HP INC	USD	1.314.314,10	0,12	2.139	MOTOROLA SOLUTIONS INC	USD	518.065,80	0,05
1.843	HUBSPOT INC	USD	875.314,42	0,08	3.870	MSCI INC - A	USD	1.946.145,60	0,18
2.925	HUMANA INC	USD	1.272.872,25	0,12	946	M&T BANK CORP	USD	160.347,00	0,02
25.948	HUNTINGTON BANCSHARES INC/OH	USD	379.359,76	0,04	6.761	NASDAQ INC	USD	1.204.810,20	0,11
3.730	IDEX CORP	USD	715.152,90	0,07	4.456	NETAPP INC	USD	369.848,00	0,03
4.000	IDEXX LABORATORIES INC	USD	2.188.240,00	0,21	11.949	NETFLIX INC	USD	4.475.975,91	0,42
15.663	ILLINOIS TOOL WORKS INC	USD	3.279.832,20	0,31	1.548	NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	USD	145.125,00	0,01
5.281	ILLUMINA INC	USD	1.845.181,40	0,17	26.238	NEWS CORP - A	USD	581.171,70	0,05
8.309	INCYTE CORP	USD	659.900,78	0,06	38.466	NIKE INC - B	USD	5.175.984,96	0,49
46.419	INGERSOLL-RAND PLC	USD	2.337.196,65	0,22	4.756	NORDSON CORP	USD	1.079.992,48	0,10
3.658	INSULET CORP	USD	974.454,62	0,09	12.217	NORFOLK SOUTHERN CORP	USD	3.484.532,74	0,33
					8.643	NORTHERN TRUST CORP	USD	1.006.477,35	0,09

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) North America Enhanced Index Sustainable Equity

(ausgedrückt in USD)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW	Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW
76.157	NVIDIA CORP	USD	20.780.199,02	1,96	27.038	SUNRUN INC	USD	821.144,06	0,08
9.514	OKTA INC - A	USD	1.436.233,44	0,14	2.330	SVB FINANCIAL GROUP	USD	1.303.518,50	0,12
6.449	OMNICOM GROUP INC	USD	547.391,12	0,05	21.967	SYNCHRONY FINANCIAL	USD	764.671,27	0,07
87.700	ONEOK INC	USD	6.194.251,00	0,58	5.837	SYNOPLYS INC	USD	1.945.296,99	0,18
48.737	ORACLE CORP	USD	4.032.012,01	0,38	26.207	SYSCO CORP	USD	2.139.801,55	0,20
17.325	OTIS WORLDWIDE CORP	USD	1.333.158,75	0,13	4.745	TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC	USD	729.496,30	0,07
10.491	OWENS CORNING	USD	959.926,50	0,09	16.116	TARGET CORP	USD	3.420.137,52	0,32
15.069	PACCAR INC	USD	1.327.126,83	0,13	4.683	TELADOC HEALTH INC	USD	337.784,79	0,03
3.785	PACKAGING CORP OF AMERICA	USD	590.876,35	0,06	615	TELEFLEX INC	USD	218.220,45	0,02
3.046	PALO ALTO NETWORKS INC	USD	1.896.165,46	0,18	6.518	TERADYNE INC	USD	770.623,14	0,07
27.712	PARAMOUNT GLOBAL - B	USD	1.047.790,72	0,10	34.677	TEXAS INSTRUMENTS INC	USD	6.362.535,96	0,60
2.580	PAYCOM SOFTWARE INC	USD	893.660,40	0,08	11.864	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	USD	7.007.471,60	0,66
31.940	PAYPAL HOLDINGS INC	USD	3.693.861,00	0,35	43.979	TJX COS INC/THE	USD	2.664.247,82	0,25
34.967	PEPSICO INC	USD	5.852.776,46	0,55	26.585	T-MOBILE US INC	USD	3.412.184,75	0,32
2.827	PERKINELMER INC	USD	493.198,42	0,05	6.725	TRACTOR SUPPLY CO	USD	1.569.413,25	0,15
161.928	PFIZER INC	USD	8.383.012,56	0,79	8.734	TRANSUNION	USD	902.571,56	0,09
38.340	PINTEREST INC - A	USD	943.547,40	0,09	8.118	TRAVELERS COS INC/THE	USD	1.483.402,14	0,14
32.693	PLUG POWER INC	USD	935.346,73	0,09	17.985	TRUIST FINANCIAL CORP	USD	1.019.749,50	0,10
15.735	PNC FINANCIAL SERVICES GROUP INC/THE	USD	2.902.320,75	0,27	8.434	TWILIO INC - A	USD	1.390.007,54	0,13
3.024	POOL CORP	USD	1.278.698,40	0,12	39.428	TWITTER INC	USD	1.525.469,32	0,14
8.979	PPG INDUSTRIES INC	USD	1.176.877,53	0,11	2.260	UDR INC	USD	129.656,20	0,01
8.361	PRINCIPAL FINANCIAL GROUP INC	USD	613.781,01	0,06	5.897	UNITED RENTALS INC	USD	2.094.673,37	0,20
81.652	PROCTER & GAMBLE CO/THE	USD	12.476.425,60	1,18	25.430	UNITEDHEALTH GROUP INC	USD	12.968.537,10	1,22
17.819	PROGRESSIVE CORP/THE	USD	2.031.187,81	0,19	61.089	US BANCORP	USD	3.246.880,35	0,31
26.984	PROLOGIS INC	USD	4.357.376,32	0,41	2.589	VAIL RESORTS INC	USD	673.839,03	0,06
20.380	PRUDENTIAL FINANCIAL INC	USD	2.408.304,60	0,23	21.037	VENTAS INC	USD	1.299.245,12	0,12
1.633	PTC INC	USD	175.906,76	0,02	230	VERISIGN INC	USD	51.165,80	0,00
6.378	PUBLIC STORAGE	USD	2.489.205,84	0,23	2.694	VERISK ANALYTICS INC - A	USD	578.213,22	0,05
10.969	PULTEGROUP INC	USD	459.601,10	0,04	103.859	VERIZON COMMUNICATIONS INC	USD	5.290.577,46	0,50
11.952	QORVO INC	USD	1.483.243,20	0,14	11.569	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	USD	3.019.161,93	0,28
1.324	QUEST DIAGNOSTICS INC	USD	181.202,64	0,02	12.550	VF CORP	USD	713.593,00	0,07
4.097	RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	USD	450.301,27	0,04	44.326	VISA INC - A	USD	9.830.177,02	0,93
31.343	REALTY INCOME CORP	USD	2.172.069,90	0,20	4.592	VMWARE INC - A	USD	522.891,04	0,05
16.031	REGENCY CENTERS CORP	USD	1.143.651,54	0,11	3.517	VORNADO REALTY TRUST	USD	159.390,44	0,02
3.755	REGENERON PHARMACEUTICALS INC	USD	2.622.567,10	0,25	39.125	WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	USD	1.751.626,25	0,17
39.430	REGIONS FINANCIAL CORP	USD	877.711,80	0,08	51.332	WALT DISNEY CO/THE	USD	7.040.697,12	0,66
5.672	REPUBLIC SERVICES INC - A	USD	751.540,00	0,07	8.904	WASTE MANAGEMENT INC	USD	1.411.284,00	0,13
5.838	RESMED INC	USD	1.415.773,38	0,13	510	WATERS CORP	USD	158.298,90	0,01
4.119	RINGCENTRAL INC - A	USD	482.787,99	0,05	852	WEST PHARMACEUTICAL SERVICES INC	USD	349.924,92	0,03
11.553	ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	USD	1.319.121,54	0,12	14.536	WESTINGHOUSE AIR BRAKE TECHNOLOGIES CORP	USD	1.397.927,12	0,13
7.746	ROCKWELL AUTOMATION INC	USD	2.169.112,38	0,20	12.123	WEYERHAEUSER CO	USD	459.461,70	0,04
5.198	ROKU INC - A	USD	651.153,46	0,06	1.919	WHIRLPOOL CORP	USD	331.564,82	0,03
5.314	ROPER TECHNOLOGIES INC	USD	2.509.430,22	0,24	2.521	WW GRAINGER INC	USD	1.300.306,59	0,12
11.857	ROSS STORES INC	USD	1.072.584,22	0,10	10.061	XYLEM INC/NY	USD	857.800,86	0,08
27.227	SALESFORCE.COM INC	USD	5.780.836,64	0,55	11.342	YUM! BRANDS INC	USD	1.344.367,26	0,13
2.153	SBA COMMUNICATIONS CORP - A	USD	740.847,30	0,07	1.452	ZEBRA TECHNOLOGIES CORP - A	USD	600.692,40	0,06
61.219	SEMPRA ENERGY	USD	10.292.138,28	0,97	857	ZENDESK INC	USD	103.088,53	0,01
6.850	SERVICENOW INC	USD	3.814.696,50	0,36	5.651	ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	USD	722.762,90	0,07
10.301	SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	USD	2.571.335,62	0,24	16.153	ZOETIS INC - A	USD	3.046.294,27	0,29
2.685	SIGNATURE BANK/NEW YORK NY	USD	788.020,65	0,07	6.283	ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS INC - A	USD	736.556,09	0,07
9.201	SKYWORKS SOLUTIONS INC	USD	1.226.309,28	0,12	3.886	ZSCALER INC	USD	937.614,08	0,09
49.358	SNAP INC - A	USD	1.776.394,42	0,17	5.081	10X GENOMICS INC - A	USD	386.511,67	0,04
788	SNAP-ON INC	USD	161.918,24	0,02	19.758	3M CO	USD	2.941.571,04	0,28
2.333	SOLAREDDGE TECHNOLOGIES INC	USD	752.089,21	0,07				<b>937.630.317,64</b>	<b>88,46</b>
9.211	SOUTHWEST AIRLINES CO	USD	421.863,80	0,04		<b>Kanada</b>			
15.451	S&P GLOBAL INC	USD	6.337.691,18	0,60	36.691	AGNICO EAGLE MINES LTD	CAD	2.247.197,07	0,21
6.863	SPLUNK INC	USD	1.019.910,43	0,10	43.072	BALLARD POWER SYSTEMS INC	CAD	501.739,40	0,05
8.374	STANLEY BLACK & DECKER INC	USD	1.170.601,46	0,11	16.910	BANK OF MONTREAL	CAD	1.991.617,71	0,19
40.792	STARBUCKS CORP	USD	3.710.848,24	0,35	22.698	BANK OF NOVA SCOTIA/THE	CAD	1.628.230,09	0,15
14.996	STATE STREET CORP	USD	1.306.451,52	0,12	24.851	BCE INC	CAD	1.378.787,32	0,13
3.093	STRYKER CORP	USD	826.913,55	0,08					

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.



## NN (L) North America Enhanced Index Sustainable Equity

(ausgedrückt in USD)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW
29.510	BLACKBERRY LTD	CAD	219.012,61	0,02
1.569	CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	CAD	190.621,47	0,02
29.439	CANADIAN NATIONAL RAILWAY CO	CAD	3.952.540,17	0,37
42.175	CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	CAD	3.483.941,00	0,33
1.527	CANADIAN TIRE CORP LTD - A	CAD	230.764,60	0,02
8.276	EMPIRE CO LTD - A	CAD	293.789,55	0,03
2.510	GEORGE WESTON LTD	CAD	309.366,72	0,03
287.458	HYDRO ONE LTD	CAD	7.751.159,23	0,74
2.058	INTACT FINANCIAL CORP	CAD	304.354,32	0,03
7.798	LIGHTSPEED COMMERCE INC	CAD	238.051,11	0,02
12.973	LOBLAW COS LTD	CAD	1.165.134,41	0,11
126.721	LUNDIN MINING CORP	CAD	1.285.420,98	0,12
34.286	MANULIFE FINANCIAL CORP	CAD	731.807,98	0,07
20.233	METRO INC	CAD	1.165.659,25	0,11
1.432	NATIONAL BANK OF CANADA	CAD	109.866,35	0,01
99.719	NORTHLAND POWER INC	CAD	3.317.978,98	0,31
44.163	NUTRIEN LTD	CAD	4.568.866,63	0,43
174.272	PEMBINA PIPELINE CORP	CAD	6.553.425,28	0,62
3.177	RITCHIE BROS AUCTIONEERS INC	CAD	187.814,48	0,02
17.190	ROGERS COMMUNICATIONS INC - B	CAD	973.831,63	0,09
48.129	ROYAL BANK OF CANADA	CAD	5.303.611,19	0,50
27.148	SHAW COMMUNICATIONS INC - B	CAD	843.314,84	0,08
4.548	SHOPIFY INC - A	CAD	3.078.497,71	0,29
53.064	TELUS CORP	CAD	1.387.510,70	0,13
12.095	THOMSON REUTERS CORP	CAD	1.314.322,36	0,12
50.290	TORONTO-DOMINION BANK/THE	CAD	3.993.647,25	0,38
827	WASTE CONNECTIONS INC	USD	115.531,90	0,01
5.725	WEST FRASER TIMBER CO LTD	CAD	471.457,11	0,04
42.071	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	CAD	2.002.418,60	0,19
10.855	WSP GLOBAL INC	CAD	1.441.858,25	0,14
			<b>64.733.148,25</b>	<b>6,11</b>
<b>Irland</b>				
17.010	ACCENTURE PLC - A	USD	5.736.282,30	0,54
1.142	ALLEGION PLC	USD	125.368,76	0,01
7.911	AON PLC - A	USD	2.576.058,93	0,24
9.731	HORIZON THERAPEUTICS PLC	USD	1.023.798,51	0,10
40.827	JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	USD	2.677.026,39	0,26
20.123	LINDE PLC	USD	6.427.889,89	0,61
40.523	MEDTRONIC PLC	USD	4.496.026,85	0,43
8.743	PENTAIR PLC	USD	473.958,03	0,04
2.820	STERIS PLC	USD	681.791,40	0,06
8.306	TRANE TECHNOLOGIES PLC	USD	1.268.326,20	0,12
4.532	WILLIS TOWERS WATSON PLC	USD	1.070.549,04	0,10
			<b>26.557.076,30</b>	<b>2,51</b>
<b>Curacao</b>				
194.301	SCHLUMBERGER NV	USD	8.026.574,31	0,76
			<b>8.026.574,31</b>	<b>0,76</b>
<b>Schweiz</b>				
16.126	CHUBB LTD	USD	3.449.351,40	0,32
11.252	GARMIN LTD	USD	1.334.599,72	0,13
8.545	TE CONNECTIVITY LTD	USD	1.119.224,10	0,11
			<b>5.903.175,22</b>	<b>0,56</b>
<b>Jersey</b>				
33.003	APTIV PLC	USD	3.950.789,13	0,37
2.785	NOVOCURE LTD	USD	230.737,25	0,02
			<b>4.181.526,38</b>	<b>0,39</b>

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW
<b>Niederlande</b>				
20.899	NXP SEMICONDUCTORS NV	USD	3.867.986,92	0,36
			<b>3.867.986,92</b>	<b>0,36</b>
<b>Bermuda</b>				
11.432	ARCH CAPITAL GROUP LTD	USD	553.537,44	0,05
19.743	BUNGE LTD	USD	2.187.721,83	0,21
635	EVEREST RE GROUP LTD	USD	191.376,30	0,02
20.707	INVESCO LTD	USD	477.503,42	0,04
			<b>3.410.138,99</b>	<b>0,32</b>
<b>Panama</b>				
65.208	CARNIVAL CORP	USD	1.318.505,76	0,12
			<b>1.318.505,76</b>	<b>0,12</b>
<b>Vereinigtes Königreich</b>				
3.235	LIBERTY GLOBAL PLC - A	USD	82.524,85	0,01
18.847	LIBERTY GLOBAL PLC - C	USD	488.325,77	0,04
13.872	SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING PLC	USD	705.391,20	0,07
			<b>1.276.241,82</b>	<b>0,12</b>
<b>Liberia</b>				
14.119	ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	USD	1.182.889,82	0,11
			<b>1.182.889,82</b>	<b>0,11</b>
			<b>1.058.087.581,41</b>	<b>99,82</b>

### Wertpapierbestand Gesamt

**1.058.087.581,41 99,82**

### Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022

Zu erhalten	Zu zahlen	Fälligkeits- datum	Engagement in USD	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in USD		
<b>Devisentermingeschäfte</b>						
3.660.332,49	CAD	2.607.733,80	EUR	20/04/2022	2.870.787,51	27.458,21
64,97	USD	58,22	EUR	19/04/2022	64,97	0,16
2.128,40	EUR	2.374,49	USD	19/04/2022	2.374,49	(5,30)
7.563.973,36	EUR	10.696.145,23	CAD	20/04/2022	8.477.730,38	(142.898,53)
128.186.815,36	EUR	143.136.564,22	USD	20/04/2022	143.136.564,22	(443.262,40)
54.844.768,76	USD	49.801.184,60	EUR	20/04/2022	54.844.768,76	(592.254,50)
					<b>209.332.290,33</b>	<b>(1.150.962,36)</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>						
						<b>(1.150.962,36)</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) North America Enhanced Index Sustainable Equity

(ausgedrückt in USD)

### Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick

		% NIW
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	1.058.087.581,41	99,82
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	(1.150.962,36)	(0,11)
<b>Bankguthaben</b>	2.111.368,99	0,20
<b>Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>	941.083,65	0,09
<b>Nettovermögen Gesamt</b>	1.059.989.071,69	100,00

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Smart Connectivity

(ausgedrückt in EUR)

### Statistische Angaben

<b>Nettovermögen</b>	31.03.2022	EUR	689.002.288,88	Distribution P (USD)	31.03.2022	USD	10.886,49
	30.09.2021	EUR	802.597.724,56		30.09.2021	USD	12.725,16
	30.09.2020	EUR	173.158.355,53		30.09.2020	USD	10.352,26
<b>Nettoinventarwert pro Anteil</b>				Distribution P Hedged (ii) (EUR)	31.03.2022	EUR	443,30
	31.03.2022	EUR	6.066,27		30.09.2021	EUR	514,91
	30.09.2021	EUR	6.774,03		30.09.2020	EUR	424,01
Capitalisation I (EUR)	30.09.2020	EUR	5.392,98	Distribution R (USD)	31.03.2022	USD	355,11
	31.03.2022	USD	2.685,28		30.09.2021	USD	413,54
	30.09.2021	USD	3.123,34		30.09.2020	USD	333,92
Capitalisation I (USD)	30.09.2020	USD	2.515,91	Distribution R Hedged (ii) (EUR)	31.03.2022	EUR	335,07
	31.03.2022	EUR	1.688,33		30.09.2021	EUR	387,12
	30.09.2021	EUR	1.894,64		30.09.2020	EUR	316,52
Capitalisation P (EUR)	30.09.2020	EUR	1.523,35	<b>Anzahl der Anteile</b>			
	31.03.2022	USD	2.277,78		Capitalisation I (EUR)	31.03.2022	712
	30.09.2021	USD	2.662,48		30.09.2021	516	
Capitalisation P (USD)	30.09.2020	USD	2.166,00	30.09.2020	97		
	31.03.2022	EUR	112,82	Capitalisation I (USD)	31.03.2022	18.387	
	30.09.2021	EUR	130,99	30.09.2021	20.244		
Capitalisation P Hedged (ii) (EUR)	30.09.2020	EUR	107,91	30.09.2020	20.918		
	31.03.2022	EUR	404,05	Capitalisation P (EUR)	31.03.2022	1.593	
	30.09.2021	EUR	451,72	30.09.2021	1.625		
Capitalisation R (EUR)	30.09.2020	EUR	360,49	30.09.2020	1.779		
	31.03.2022	USD	359,23	Capitalisation P (USD)	31.03.2022	20.847	
	30.09.2021	USD	418,33	30.09.2021	22.496		
Capitalisation R (USD)	30.09.2020	USD	337,78	30.09.2020	26.027		
	31.03.2022	EUR	338,70	Capitalisation P Hedged (ii) (EUR)	31.03.2022	206.431	
	30.09.2021	EUR	391,08	30.09.2021	217.786		
Capitalisation R Hedged (ii) (EUR)	30.09.2020	EUR	319,83	30.09.2020	270.508		
	31.03.2022	EUR	6.326,55	Capitalisation R (EUR)	31.03.2022	61	
	30.09.2021	EUR	7.116,84	30.09.2021	77		
Capitalisation X (EUR)	30.09.2020	EUR	5.749,91	30.09.2020	77		
	31.03.2022	HUF	243.863,96	Capitalisation R (USD)	31.03.2022	2.324	
	30.09.2021	HUF	268.353,95	30.09.2021	2.604		
Capitalisation X (HUF)	30.09.2020	HUF	219.229,29	30.09.2020	2.980		
	31.03.2022	USD	2.048,90	Capitalisation R Hedged (ii) (EUR)	31.03.2022	1.501	
	30.09.2021	USD	2.400,66	30.09.2021	1.666		
Capitalisation X (USD)	30.09.2020	USD	1.962,35	30.09.2020	1.871		
	31.03.2022	CZK	7.693,52	Capitalisation X (EUR)	31.03.2022	2.195	
	30.09.2021	CZK	8.533,33	30.09.2021	2.304		
Capitalisation X Hedged (i) (CZK)	30.09.2020	CZK	6.879,12	30.09.2020	2.709		
	31.03.2022	EUR	56,49	Capitalisation X (HUF)	31.03.2022	4.312	
	30.09.2021	EUR	63,09	30.09.2021	4.327		
Distribution N (EUR)	30.09.2020	EUR	-	30.09.2020	6.745		

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

## NN (L) Smart Connectivity

(ausgedrückt in EUR)

### Statistische Angaben (Fortsetzung)

Anzahl der Anteile			Capitalisation X Hedged (i) (CZK)	31.03.2022	2,33%	
Capitalisation X (USD)	31.03.2022	9.602	Distribution N (EUR)	31.03.2022	0,83%	
	30.09.2021	7.844		Distribution P (USD)	31.03.2022	1,80%
	30.09.2020	7.761			Distribution P Hedged (ii) (EUR)	31.03.2022
Capitalisation X Hedged (i) (CZK)	31.03.2022	14.737	Distribution R (USD)	31.03.2022		1,05%
	30.09.2021	11.740		Distribution R Hedged (ii) (EUR)	31.03.2022	1,06%
	30.09.2020	4.350			<b>Portfolioumsatz in %*</b>	31.03.2022
Distribution N (EUR)	31.03.2022	9.228.048				
	30.09.2021	9.632.077				
	30.09.2020	-				
Distribution P (USD)	31.03.2022	494				
	30.09.2021	532				
	30.09.2020	674				
Distribution P Hedged (ii) (EUR)	31.03.2022	10.356				
	30.09.2021	10.920				
	30.09.2020	13.822				
Distribution R (USD)	31.03.2022	1.471				
	30.09.2021	1.565				
	30.09.2020	1.648				
Distribution R Hedged (ii) (EUR)	31.03.2022	242				
	30.09.2021	242				
	30.09.2020	880				
Laufende Kosten in %*						
Capitalisation I (EUR)	31.03.2022	0,81%				
Capitalisation I (USD)	31.03.2022	0,81%				
Capitalisation P (EUR)	31.03.2022	1,80%				
Capitalisation P (USD)	31.03.2022	1,80%				
Capitalisation P Hedged (ii) (EUR)	31.03.2022	1,82%				
Capitalisation R (EUR)	31.03.2022	1,05%				
Capitalisation R (USD)	31.03.2022	1,05%				
Capitalisation R Hedged (ii) (EUR)	31.03.2022	1,07%				
Capitalisation X (EUR)	31.03.2022	2,30%				
Capitalisation X (HUF)	31.03.2022	2,30%				
Capitalisation X (USD)	31.03.2022	2,30%				

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

## NN (L) Smart Connectivity

(ausgedrückt in EUR)

### Finanzabschlüsse

#### Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022

	Erläuterungen	
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	2	<b>678.344.343,23</b>
Aktien		678.344.343,23
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	2	<b>173.564,55</b>
Devisentermingeschäfte		173.564,55
<b>Bankguthaben</b>		<b>10.447.468,80</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte</b>	4	<b>1.643.356,05</b>
<b>Vermögenswerte Gesamt</b>		<b>690.608.732,63</b>
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>	4, 12	<b>(1.606.443,75)</b>
<b>Verbindlichkeiten Gesamt</b>		<b>(1.606.443,75)</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Berichtszeitraums</b>		<b>689.002.288,88</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Smart Connectivity

(ausgedrückt in EUR)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
<b>Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>				
<b>Aktien</b>				
<b>Vereinigte Staaten</b>				
36.000	ADOBE INC	USD	14.741.670,79	2,14
95.000	ANSYS INC	USD	27.121.511,71	3,94
160.000	BLOCK INC - A	USD	19.499.393,34	2,83
155.000	BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS INC	USD	21.691.502,27	3,15
125.000	ETSY INC	USD	13.962.162,41	2,03
120.000	IDEX CORP	USD	20.678.200,69	3,00
70.000	INTUIT INC	USD	30.251.022,33	4,39
55.000	INTUITIVE SURGICAL INC	USD	14.912.506,18	2,16
65.000	MASTERCARD INC - A	USD	20.877.814,23	3,03
75.100	MICROSOFT CORP	USD	20.809.851,26	3,02
27.000	PALO ALTO NETWORKS INC	USD	15.106.071,09	2,19
63.000	PAYCOM SOFTWARE INC	USD	19.612.582,57	2,85
825.000	SHOALS TECHNOLOGIES GROUP INC - A	USD	12.634.700,94	1,83
190.000	TRANSUNION	USD	17.646.699,32	2,56
45.000	TYLER TECHNOLOGIES INC/THE	USD	17.993.124,52	2,61
145.000	VEEVA SYSTEMS INC - A	USD	27.687.682,56	4,02
85.000	VERISK ANALYTICS INC - A	USD	16.396.485,87	2,38
70.000	VISA INC - A	USD	13.952.186,22	2,02
40.000	ZSCALER INC	USD	8.674.066,42	1,26
			<b>354.249.234,72</b>	<b>51,41</b>
<b>Vereinigtes Königreich</b>				
2.500.000	GB GROUP PLC	GBP	16.330.174,70	2,37
1.100.000	HALMA PLC	GBP	32.672.182,86	4,74
9.300.000	HELIOS TOWERS PLC	GBP	12.699.905,86	1,85
1.000.000	RELX PLC	GBP	28.199.135,01	4,09
1.250.000	RWS HOLDINGS PLC	GBP	5.472.975,22	0,79
			<b>95.374.373,65</b>	<b>13,84</b>
<b>Niederlande</b>				
10.000	ADYEN NV	EUR	18.090.000,00	2,63
250.000	ALFEN BEHEER BV	EUR	23.075.000,00	3,34
55.000	ASML HOLDING NV	EUR	33.550.000,00	4,87
			<b>74.715.000,00</b>	<b>10,84</b>
<b>Japan</b>				
41.008	KEYENCE CORP	JPY	17.384.261,95	2,52
675.000	SMS CO LTD	JPY	16.968.979,66	2,47
			<b>34.353.241,61</b>	<b>4,99</b>
<b>Kanada</b>				
475.000	DESCARTES SYSTEMS GROUP INC	CAD	31.283.740,08	4,54
			<b>31.283.740,08</b>	<b>4,54</b>
<b>Dänemark</b>				
450.000	NETCOMPANY GROUP AS	DKK	27.017.707,91	3,92
			<b>27.017.707,91</b>	<b>3,92</b>
<b>Irland</b>				
70.000	ACCENTURE PLC - A	USD	21.216.105,69	3,08
			<b>21.216.105,69</b>	<b>3,08</b>

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
<b>Schweiz</b>				
70.000	SIKA AG - REG	CHF	21.015.392,00	3,05
			<b>21.015.392,00</b>	<b>3,05</b>
<b>Frankreich</b>				
160.000	LEGRAND SA	EUR	13.820.800,00	2,01
			<b>13.820.800,00</b>	<b>2,01</b>
<b>Kenia</b>				
20.000.000	SAFARICOM PLC	KES	5.298.747,57	0,77
			<b>5.298.747,57</b>	<b>0,77</b>
			<b>678.344.343,23</b>	<b>98,45</b>
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>			<b>678.344.343,23</b>	<b>98,45</b>

### Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022

Zu erhalten	Zu zahlen	Fälligkeits- datum	Engagement in EUR	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR	
<b>Devisentermingeschäfte</b>					
121.935.843,03	CZK	4.807.471,14 EUR	19/04/2022	4.807.471,14	173.771,07
1.483.920,39	EUR	190.726.775,00 JPY	20/04/2022	1.483.920,39	71.869,03
4.255.103,95	EUR	3.552.669,64 GBP	20/04/2022	4.255.103,95	53.486,01
35.145,67	CZK	1.406,42 EUR	20/04/2022	1.406,42	29,14
25.888,90	EUR	632.207,02 CZK	04/04/2022	25.888,90	5,77
47.084,21	CZK	1.922,20 EUR	01/04/2022	1.922,20	5,47
945.181,75	DKK	127.064,58 EUR	20/04/2022	127.064,58	1,27
33,74	EUR	2.876,62 INR	21/04/2022	33,74	(0,26)
9,85	EUR	105,18 SEK	20/04/2022	9,85	(0,30)
35,21	EUR	13.396,60 HUF	20/04/2022	35,21	(1,17)
933,36	EUR	3.369,37 ILS	20/04/2022	933,36	(15,35)
2.626,04	EUR	25.923,79 NOK	20/04/2022	2.626,04	(36,77)
1.056,11	EUR	26.947,54 CZK	20/04/2022	1.056,11	(44,56)
199.227,00	JPY	1.582,59 EUR	20/04/2022	1.582,59	(107,61)
306.181,65	CAD	220.332,07 EUR	20/04/2022	220.332,07	(135,44)
50.259,50	CHF	49.352,44 EUR	20/04/2022	49.352,44	(263,61)
1.283.837,77	EUR	9.552.283,91 DKK	20/04/2022	1.283.837,77	(326,98)
902.451,27	EUR	926.473,00 CHF	20/04/2022	902.451,27	(2.441,84)
256.838,06	EUR	6.429.487,89 CZK	19/04/2022	256.838,06	(5.815,12)
368.800,60	GBP	442.004,76 EUR	20/04/2022	442.004,76	(5.837,22)
1.385.240,56	USD	1.269.359,66 EUR	20/04/2022	1.269.359,66	(24.945,70)
1.496.693,32	EUR	2.118.905,59 CAD	20/04/2022	1.496.693,32	(27.159,81)
16.446.572,40	EUR	18.372.870,17 USD	20/04/2022	16.446.572,40	(58.471,47)
				<b>33.076.496,23</b>	<b>173.564,55</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>				<b>173.564,55</b>	

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Smart Connectivity

(ausgedrückt in EUR)

### Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick

		%
		NIW
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	678.344.343,23	98,45
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	173.564,55	0,03
<b>Bankguthaben</b>	10.447.468,80	1,52
<b>Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>	36.912,30	0,00
<b>Nettovermögen Gesamt</b>	689.002.288,88	100,00

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Sovereign Green Bond

(ausgedrückt in EUR)

### Statistische Angaben

<b>Nettovermögen</b>	31.03.2022	EUR	155.473.494,43	<b>Anzahl der Anteile</b>			
	30.09.2021	EUR	171.922.132,25				
	30.09.2020	EUR	-				
<b>Nettoinventarwert pro Anteil</b>				Capitalisation X (EUR)	31.03.2022	8	
					30.09.2021	8	
					30.09.2020	-	
Capitalisation I (EUR)	31.03.2022	EUR	9.069,32	Capitalisation Z (EUR)	31.03.2022	8.307	
	30.09.2021	EUR	9.896,93		30.09.2021	6.638	
	30.09.2020	EUR	-		30.09.2020	-	
Capitalisation I Hedged (i) (GBP)	31.03.2022	GBP	92,77	Distribution I (EUR)	31.03.2022	1.944	
	30.09.2021	GBP	-		30.09.2021	-	
	30.09.2020	GBP	-		30.09.2020	-	
Capitalisation P (EUR)	31.03.2022	EUR	4,52	Distribution R Hedged (i) (GBP)	31.03.2022	45.556	
	30.09.2021	EUR	4,94		30.09.2021	37.137	
	30.09.2020	EUR	-		30.09.2020	-	
Capitalisation R (EUR)	31.03.2022	EUR	4,53	<b>Laufende Kosten in %*</b>			
	30.09.2021	EUR	4,95		Capitalisation I (EUR)	31.03.2022	0,33%
	30.09.2020	EUR	-				
Capitalisation X (EUR)	31.03.2022	EUR	226,54	Capitalisation I Hedged (i) (GBP)	31.03.2022	0,35%	
	30.09.2021	EUR	247,97	Capitalisation P (EUR)	31.03.2022	0,60%	
	30.09.2020	EUR	-	Capitalisation R (EUR)	31.03.2022	0,40%	
Capitalisation Z (EUR)	31.03.2022	EUR	3.862,23	Capitalisation X (EUR)	31.03.2022	0,95%	
	30.09.2021	EUR	4.210,46	Capitalisation Z (EUR)	31.03.2022	0,13%	
	30.09.2020	EUR	-	Distribution I (EUR)	31.03.2022	0,33%	
Distribution I (EUR)	31.03.2022	EUR	4.555,68	Distribution R Hedged (i) (GBP)	31.03.2022	0,33%	
	30.09.2021	EUR	-				
	30.09.2020	EUR	-	<b>Portfolioumsatz in %*</b>	31.03.2022	(4,18%)	
Distribution R Hedged (i) (GBP)	31.03.2022	GBP	90,62				
	30.09.2021	GBP	98,51				
	30.09.2020	GBP	-				
<b>Anzahl der Anteile</b>							
Capitalisation I (EUR)	31.03.2022		12.084				
	30.09.2021		14.112				
	30.09.2020		-				
Capitalisation I Hedged (i) (GBP)	31.03.2022		80				
	30.09.2021		-				
	30.09.2020		-				
Capitalisation P (EUR)	31.03.2022		5.000				
	30.09.2021		5.000				
	30.09.2020		-				
Capitalisation R (EUR)	31.03.2022		5.000				
	30.09.2021		5.000				
	30.09.2020		-				

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.



## NN (L) Sovereign Green Bond

(ausgedrückt in EUR)

### Finanzabschlüsse

#### Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022

	Erläuterungen	
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	2	<b>151.901.623,54</b>
Anleihen und andere Schuldtitel		151.901.623,54
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	2	<b>325.433,71</b>
Futures		325.433,71
<b>Bankguthaben</b>		<b>4.216.851,18</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte</b>	4	<b>1.394.153,08</b>
<b>Vermögenswerte Gesamt</b>		<b>157.838.061,51</b>
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>	4	<b>(2.315.981,60)</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	2	<b>(48.585,48)</b>
Devisentermingeschäfte		(48.585,48)
<b>Verbindlichkeiten Gesamt</b>		<b>(2.364.567,08)</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Berichtszeitraums</b>		<b>155.473.494,43</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Sovereign Green Bond

(ausgedrückt in EUR)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW	Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
<b>Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>									
<b>Anleihen und andere Schuldtitel</b>									
<b>Frankreich</b>					<b>Supranational-Multinational</b>				
900.000	ELECTRICITE DE FRANCE SA 1.000% 13/10/2026 EMTN	EUR	892.279,37	0,57	5.500.000	EUROFIMA EUROPAEISCHE GESELLSCHAFT FUER DIE FINANZIERUNG VON EISENBahnMATERIA 0.150% 10/10/2034 EMTN	EUR	4.731.192,24	3,04
6.000.000	FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 0.500% 25/06/2044	EUR	5.071.949,04	3,26	1.000.000	EUROPEAN INVESTMENT BANK 0.010% 15/11/2035	EUR	847.682,17	0,55
15.200.000	FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 1.750% 25/06/2039	EUR	16.605.523,63	10,69	2.305.000	EUROPEAN INVESTMENT BANK 1.500% 15/11/2047	EUR	2.444.905,87	1,57
1.800.000	LA BANQUE POSTALE SA 1.375% 24/04/2029 EMTN	EUR	1.739.296,76	1,12	6.050.000	EUROPEAN UNION 0.400% 04/02/2037	EUR	5.378.676,21	3,47
1.900.000	LA POSTE SA 1.450% 30/11/2028 EMTN	EUR	1.921.178,03	1,24	<b>13.402.456,49 8,63</b>				
1.600.000	REGIE AUTONOME DES TRANSPORTS PARISIENS 0.875% 25/05/2027 EMTN	EUR	1.596.709,22	1,03	<b>Italien</b>				
400.000	RTE RESEAU DE TRANSPORT D'ELECTRICITE SADIR 0.750% 12/01/2034 EMTN	EUR	363.177,80	0,23	700.000	ACEA SPA ZCP 28/09/2025 EMTN	EUR	674.678,05	0,43
2.000.000	SNCF RESEAU 0.750% 25/05/2036 EMTN	EUR	1.833.562,50	1,18	400.000	ACEA SPA 0.250% 28/07/2030 EMTN	EUR	348.762,36	0,22
700.000	SNCF RESEAU 1.000% 09/11/2031 EMTN	EUR	688.075,12	0,44	1.679.000	FERROVIE DELLO STATO ITALIANE SPA 1.125% 09/07/2026 EMTN	EUR	1.657.795,35	1,07
4.000.000	SOCIETE DU GRAND PARIS EPIC 0.300% 25/11/2031 EMTN	EUR	3.670.985,36	2,36	7.300.000	ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 1.500% 30/04/2045	EUR	6.213.828,77	4,00
3.400.000	SOCIETE DU GRAND PARIS EPIC 0.700% 15/10/2060 EMTN	EUR	2.400.267,23	1,54	<b>8.895.064,53 5,72</b>				
100.000	SOCIETE DU GRAND PARIS EPIC 1.000% 26/11/2051 EMTN	EUR	83.957,34	0,05	<b>Belgien</b>				
7.700.000	SOCIETE DU GRAND PARIS EPIC 1.125% 25/05/2034 EMTN	EUR	7.491.206,11	4,82	5.700.000	BELGIUM GOVERNMENT BOND 1.250% 22/04/2033	EUR	5.883.062,28	3,79
1.800.000	SOCIETE DU GRAND PARIS 1.625% 08/04/2042 EMTN	EUR	1.813.031,55	1,17	1.500.000	PROXIMUS SADP 0.750% 17/11/2036 EMTN	EUR	1.323.498,98	0,85
1.400.000	SOCIETE NATIONALE SNCF SA 0.625% 17/04/2030 EMTN	EUR	1.344.480,30	0,86	<b>7.206.561,26 4,64</b>				
<b>47.515.679,36</b>				<b>30,56</b>	<b>Irland</b>				
<b>Deutschland</b>					1.231.000	ESB FINANCE DAC 1.000% 19/07/2034 EMTN	EUR	1.134.608,44	0,73
7.000.000	BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE ZCP 15/08/2030	EUR	6.751.655,54	4,34	4.400.000	IRELAND GOVERNMENT BOND 1.350% 18/03/2031	EUR	4.597.611,35	2,96
3.000.000	BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE ZCP 15/08/2050	EUR	2.534.940,54	1,63	<b>5.732.219,79 3,69</b>				
4.500.000	DEUTSCHE KREDITBANK AG 0.010% 23/02/2026	EUR	4.330.287,14	2,79	<b>Schweden</b>				
700.000	ENBW ENERGIE BADEN-WUERTTEMBERG AG 05/11/2079 FRN	EUR	667.944,89	0,43	1.900.000	VATTENFALL AB 0.125% 12/02/2029 EMTN	EUR	1.716.349,78	1,10
600.000	ENBW ENERGIE BADEN-WUERTTEMBERG AG 29/06/2080 FRN	EUR	560.771,56	0,36	3.000.000	VATTENFALL AB 0.500% 24/06/2026 EMTN	EUR	2.903.327,73	1,87
1.500.000	ENBW ENERGIE BADEN-WUERTTEMBERG AG 31/08/2081 FRN	EUR	1.293.490,59	0,83	<b>4.619.677,51 2,97</b>				
3.100.000	KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU ZCP 15/06/2029 EMTN	EUR	2.912.284,12	1,87	<b>Spanien</b>				
5.700.000	KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU ZCP 15/09/2028 EMTN	EUR	5.407.797,48	3,48	1.500.000	ADIF ALTA VELOCIDAD 0.550% 31/10/2031 EMTN	EUR	1.374.156,15	0,88
2.000.000	LANDESBANK BADEN-WUERTTEMBERG 0.375% 29/07/2026 EMTN	EUR	1.916.186,50	1,23	300.000	INSTITUTO DE CREDITO OFICIAL ZCP 30/04/2027 EMTN	EUR	286.081,67	0,18
3.900.000	LANDWIRTSCHAFTLICHE RENTENBANK ZCP 30/06/2031 EMTN	EUR	3.548.731,13	2,28	2.774.000	SPAIN GOVERNMENT BOND 1.000% 30/07/2042	EUR	2.401.618,46	1,55
1.500.000	LANDWIRTSCHAFTLICHE RENTENBANK 0.100% 08/03/2027 EMTN	EUR	1.456.861,07	0,94	<b>4.061.856,28 2,61</b>				
2.600.000	NRW BANK 0.625% 02/02/2029 EMTN	EUR	2.528.285,76	1,63	<b>Dänemark</b>				
<b>33.909.236,32</b>				<b>21,81</b>	1.000.000	KOMMUNEKREDIT 0.125% 26/09/2040 EMTN	EUR	793.314,26	0,51
<b>Niederlande</b>					700.000	ORSTED AS 1.500% 26/11/2029	EUR	693.271,43	0,45
2.300.000	ALLIANDER NV 0.375% 10/06/2030 EMTN	EUR	2.120.694,65	1,36	1.200.000	ORSTED AS 18/02/3021 FRN	EUR	1.080.253,79	0,69
1.000.000	ALLIANDER NV 0.875% 22/04/2026 EMTN	EUR	992.431,11	0,64	<b>2.566.839,48 1,65</b>				
500.000	ALLIANDER NV 0.875% 24/06/2032 EMTN	EUR	465.651,30	0,30	<b>Südkorea</b>				
2.000.000	ENEXIS HOLDING NV 0.625% 17/06/2032 EMTN	EUR	1.818.594,32	1,17	1.300.000	KOREA INTERNATIONAL BOND 2.000% 19/06/2024	USD	1.153.579,94	0,74
1.600.000	NEDERLANDSE WATERSCHAPSBANK NV 0.500% 26/04/2051 EMTN	EUR	1.338.997,82	0,86	<b>1.153.579,94 0,74</b>				
5.800.000	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 0.500% 15/01/2040	EUR	5.475.696,48	3,53	<b>Chile</b>				
2.300.000	SWISSCOM FINANCE BV 0.375% 14/11/2028	EUR	2.176.933,76	1,40	850.000	CHILE GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 0.830% 02/07/2031	EUR	773.987,26	0,49
300.000	TENNET HOLDING BV FRN PERP	EUR	300.639,03	0,19	400.000	CHILE GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 1.250% 29/01/2040	EUR	335.001,08	0,22
400.000	TENNET HOLDING BV FRN PERP	EUR	408.938,08	0,26	<b>1.108.988,34 0,71</b>				
1.500.000	TENNET HOLDING BV 0.500% 09/06/2031 EMTN	EUR	1.368.272,85	0,88					

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) Sovereign Green Bond

(ausgedrückt in EUR)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in EUR	% NIW
<b>Indien</b>				
644.000	POWER FINANCE CORP LTD 1.841% 21/09/2028 GMTN	EUR	593.659,89	0,38
			<b>593.659,89</b>	<b>0,38</b>
<b>Österreich</b>				
600.000	VERBUND AG 0.900% 01/04/2041	EUR	519.618,77	0,33
			<b>519.618,77</b>	<b>0,33</b>
<b>Litauen</b>				
500.000	AB IGNITIS GRUPE 2.000% 14/07/2027 EMTN	EUR	503.695,31	0,32
			<b>503.695,31</b>	<b>0,32</b>
<b>Ungarn</b>				
500.000	HUNGARY GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 1.750% 05/06/2035	EUR	467.684,05	0,30
			<b>467.684,05</b>	<b>0,30</b>
			<b>151.901.623,54</b>	<b>97,70</b>
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>			<b>151.901.623,54</b>	<b>97,70</b>

### Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick

		% NIW
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	<b>151.901.623,54</b>	<b>97,70</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	<b>276.848,23</b>	<b>0,18</b>
<b>Bankguthaben</b>	<b>4.216.851,18</b>	<b>2,71</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>	<b>(921.828,52)</b>	<b>(0,59)</b>
<b>Nettovermögen Gesamt</b>	<b>155.473.494,43</b>	<b>100,00</b>

### Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022

Zu erhalten	Zu zahlen	Fälligkeits- datum	Engagement in EUR	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR	
<b>Devisentermingeschäfte</b>					
1.325.364,31	EUR	1.469.000,00 USD	30/06/2022	1.325.364,31	9.773,97
249.412,58	EUR	208.640,66 GBP	19/04/2022	249.412,58	2.651,54
860,01	GBP	1.014,82 EUR	04/04/2022	1.014,82	2,87
6.208,80	EUR	5.247,68 GBP	01/04/2022	6.208,80	(1,02)
4.372.102,96	GBP	5.231.935,44 EUR	19/04/2022	5.231.935,44	(61.012,84)
				<b>6.813.935,95</b>	<b>(48.585,48)</b>
<b>Zins-Futures</b>					
37	EURO-BOBL FUTURE 08/06/2022	EUR	4.767.820,00	(135.840,00)	
(95)	EURO-BUND FUTURE 08/06/2022	EUR	15.072.700,00	799.427,44	
24	EURO-BUXL 30Y BOND 08/06/2022	EUR	4.468.800,00	(352.920,00)	
(6)	US 5YR NOTE (CBT) 30/06/2022	USD	618.455,94	14.766,27	
			<b>24.927.775,94</b>	<b>325.433,71</b>	
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>			<b>276.848,23</b>		

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) US Behavioural Equity

(ausgedrückt in USD)

### Statistische Angaben

<b>Nettovermögen</b>	31.03.2022	USD	38.658.723,60
	30.09.2021	USD	37.307.525,96
	30.09.2020	USD	-
<b>Nettoinventarwert pro Anteil</b>			
Capitalisation I (USD)	31.03.2022	USD	5.259,69
	30.09.2021	USD	5.091,07
	30.09.2020	USD	-
Capitalisation P (USD)	31.03.2022	USD	260,65
	30.09.2021	USD	253,56
	30.09.2020	USD	-
Capitalisation R (USD)	31.03.2022	USD	262,41
	30.09.2021	USD	254,32
	30.09.2020	USD	-
Distribution Z (EUR)	31.03.2022	EUR	5.784,32
	30.09.2021	EUR	5.359,12
	30.09.2020	EUR	-
<b>Anzahl der Anteile</b>			
Capitalisation I (USD)	31.03.2022		6
	30.09.2021		6
	30.09.2020		-
Capitalisation P (USD)	31.03.2022		19
	30.09.2021		19
	30.09.2020		-
Capitalisation R (USD)	31.03.2022		19
	30.09.2021		19
	30.09.2020		-
Distribution Z (EUR)	31.03.2022		6.000
	30.09.2021		6.000
	30.09.2020		-
<b>Laufende Kosten in %*</b>			
Capitalisation I (USD)	31.03.2022		0,81%
Capitalisation P (USD)	31.03.2022		1,80%
Capitalisation R (USD)	31.03.2022		1,05%
Distribution Z (EUR)	31.03.2022		0,21%
<b>Portfolioumsatz in %*</b>	31.03.2022		370,34%

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

## NN (L) US Behavioural Equity

(ausgedrückt in USD)

### Finanzabschlüsse

#### Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022

	Erläuterungen	
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	2	<b>38.526.548,58</b>
Aktien		38.526.548,58
<b>Bankguthaben</b>		<b>115.630,20</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte</b>	4	<b>23.951,19</b>
<b>Vermögenswerte Gesamt</b>		<b>38.666.129,97</b>
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>	4	<b>(7.406,37)</b>
<b>Verbindlichkeiten Gesamt</b>		<b>(7.406,37)</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Berichtszeitraums</b>		<b>38.658.723,60</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) US Behavioural Equity

(ausgedrückt in USD)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW	Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW
<b>Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>									
<b>Aktien</b>									
<b>Vereinigte Staaten</b>									
595	ADOBE INC	USD	271.093,90	0,70	2.955	ELI LILLY & CO	USD	846.223,35	2,19
2.162	ADVANCED ENERGY INDUSTRIES INC	USD	186.104,96	0,48	4.391	EMERSON ELECTRIC CO	USD	430.537,55	1,11
199	AIR PRODUCTS AND CHEMICALS INC	USD	49.732,09	0,13	1.800	ENLINK MIDSTREAM LLC	USD	17.370,00	0,04
1.834	ALLSTATE CORP/THE	USD	254.027,34	0,66	2.700	EOG RESOURCES INC	USD	321.921,00	0,83
505	ALPHABET INC - A	USD	1.404.581,75	3,63	5.900	EXELON CORP	USD	281.017,00	0,73
360	AMAZON.COM INC	USD	1.173.582,00	3,04	349	EXLSERVICE HOLDINGS INC	USD	50.001,23	0,13
774	AMERICAN TOWER CORP	USD	194.444,28	0,50	100	EXPEDIA GROUP INC	USD	19.567,00	0,05
917	AMERISOURCEBERGEN CORP - A	USD	141.869,07	0,37	7.328	EXXON MOBIL CORP	USD	605.219,52	1,57
1.588	AMPHENOL CORP - A	USD	119.655,80	0,31	2.700	FASTENAL CO	USD	160.380,00	0,41
2.300	ANTERO RESOURCES CORP	USD	70.219,00	0,18	2.300	FIDELITY NATIONAL FINANCIAL INC	USD	112.332,00	0,29
896	ANTHEM INC	USD	440.133,12	1,14	1.400	FORD MOTOR CO	USD	23.674,00	0,06
14.171	APPLE INC	USD	2.474.398,31	6,41	148	FTI CONSULTING INC	USD	23.268,56	0,06
837	APPLIED MATERIALS INC	USD	110.316,60	0,29	500	GENERAL MOTORS CO	USD	21.870,00	0,06
1.329	ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	USD	119.955,54	0,31	1.800	HALLIBURTON CO	USD	68.166,00	0,18
125	ARISTA NETWORKS INC	USD	17.372,50	0,04	1.100	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	USD	37.763,00	0,10
751	ASBURY AUTOMOTIVE GROUP INC	USD	120.310,20	0,31	2.766	HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	USD	419.712,84	1,09
1.584	AUTONATION INC	USD	157.734,72	0,41	3.009	HOME DEPOT INC/THE	USD	900.683,97	2,33
16.000	BANK OF AMERICA CORP	USD	659.520,00	1,72	445	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	USD	86.588,10	0,22
2.500	BATH & BODY WORKS INC	USD	119.500,00	0,31	628	ILLINOIS TOOL WORKS INC	USD	131.503,20	0,34
895	BERKSHIRE HATHAWAY INC - B	USD	315.854,45	0,82	1.200	IRON MOUNTAIN INC	USD	66.492,00	0,17
400	BERRY GLOBAL GROUP INC	USD	23.184,00	0,06	4.287	JOHNSON & JOHNSON	USD	759.785,01	1,97
1.476	BLACKSTONE INC	USD	187.363,44	0,48	1.515	JPMORGAN CHASE & CO	USD	206.524,80	0,53
600	BOK FINANCIAL CORP	USD	56.370,00	0,15	3.900	KINDER MORGAN INC/DE	USD	73.749,00	0,19
5.100	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	USD	372.453,00	0,96	3.300	KKR & CO INC	USD	192.951,00	0,50
1.407	BROADCOM INC	USD	885.959,76	2,29	68	KLA CORP	USD	24.892,08	0,06
2.900	CAESARS ENTERTAINMENT INC	USD	224.344,00	0,58	2.700	KULICKE & SOFFA INDUSTRIES INC	USD	151.254,00	0,39
800	CALIFORNIA RESOURCES CORP	USD	35.784,00	0,09	837	LAM RESEARCH CORP	USD	449.979,57	1,16
3.700	CARDINAL HEALTH INC	USD	209.790,00	0,54	8.800	LESLIE'S INC	USD	170.368,00	0,44
3.700	CARRIER GLOBAL CORP	USD	169.719,00	0,44	4.000	LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY SIRIUSXM	USD	182.840,00	0,47
1.595	CATERPILLAR INC	USD	355.397,90	0,92	7.400	LIVENT CORP	USD	192.918,00	0,50
2.430	CBRE GROUP INC - A	USD	222.393,60	0,58	1.072	MARRIOTT INTERNATIONAL INC/MD - A	USD	188.404,00	0,49
700	CHARLES SCHWAB CORP/THE	USD	59.017,00	0,15	835	MARSH & MCLENNAN COS INC	USD	142.300,70	0,37
927	CHEVRON CORP	USD	150.943,41	0,39	125	MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	USD	48.111,25	0,12
1.493	CHURCH & DWIGHT CO INC	USD	148.374,34	0,38	2.200	MASCO CORP	USD	112.200,00	0,29
2.681	CIGNA CORP	USD	642.394,41	1,66	2.390	MAXIMUS INC	USD	179.130,50	0,46
309	CLOROX CO/THE	USD	42.960,27	0,11	200	MAXLINEAR INC - A	USD	11.670,00	0,03
7.600	COCA-COLA CO	USD	471.200,00	1,22	1.353	MCDONALD'S CORP	USD	334.569,84	0,87
2.600	COGNEX CORP	USD	200.590,00	0,52	1.064	MERCK & CO INC	USD	87.301,20	0,23
4.755	COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORP - A	USD	426.380,85	1,10	855	META PLATFORMS INC - A	USD	190.117,80	0,49
1.524	COHEN & STEERS INC	USD	130.896,36	0,34	212	METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL INC	USD	291.116,28	0,75
600	COMMERCIAL METALS CO	USD	24.972,00	0,06	3.900	MGC INVESTMENT CORP	USD	52.845,00	0,14
6.000	CONAGRA BRANDS INC	USD	201.420,00	0,52	10.357	MICROSOFT CORP	USD	3.193.166,67	8,27
166	CONSENSUS CLOUD SOLUTIONS INC	USD	9.981,58	0,03	129	MOLINA HEALTHCARE INC	USD	43.033,11	0,11
287	CONSOLIDATED EDISON INC	USD	27.173,16	0,07	600	MONDELEZ INTERNATIONAL INC - A	USD	37.668,00	0,10
432	COSTCO WHOLESALE CORP	USD	248.767,20	0,64	1.511	MOODY'S CORP	USD	509.826,51	1,32
3.339	CVS HEALTH CORP	USD	337.940,19	0,87	3.860	MORGAN STANLEY	USD	337.364,00	0,87
1.359	DATADOG INC - A	USD	205.847,73	0,53	300	MOSAIC CO	USD	19.950,00	0,05
1.600	DELL TECHNOLOGIES INC - C	USD	80.304,00	0,21	1.041	MURPHY USA INC	USD	208.158,36	0,54
243	DIAMONDBACK ENERGY INC	USD	33.310,44	0,09	600	NATIONAL FUEL GAS CO	USD	41.220,00	0,11
4.500	DISCOVERY INC	USD	112.140,00	0,29	395	NEXTERA ENERGY INC	USD	33.460,45	0,09
600	DISH NETWORK CORP - A	USD	18.990,00	0,05	1.769	NEXTERA ENERGY PARTNERS LP	USD	147.463,84	0,38
2.800	DROPBOX INC - A	USD	65.100,00	0,17	2.259	NVIDIA CORP	USD	616.390,74	1,59
963	DTE ENERGY CO	USD	127.318,23	0,33	700	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	USD	39.718,00	0,10
					4.165	ORACLE CORP	USD	344.570,45	0,89
					1.680	ORGANON & CO	USD	58.682,40	0,15
					210	ORION OFFICE REIT INC	USD	2.940,00	0,01
					3.678	OTIS WORLDWIDE CORP	USD	283.022,10	0,73
					1.035	PARKER-HANNIFIN CORP	USD	293.691,60	0,76
					2.429	PEPSICO INC	USD	406.566,02	1,05
					3.600	PILGRIM'S PRIDE CORP	USD	90.360,00	0,23
					6.800	PLUG POWER INC	USD	194.548,00	0,50

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) US Behavioural Equity

(ausgedrückt in USD)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

### Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW		% NIW	
					<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	<b>38.526.548,58</b>	<b>99,66</b>
					<b>Bankguthaben</b>	<b>115.630,20</b>	<b>0,30</b>
					<b>Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>	<b>16.544,82</b>	<b>0,04</b>
					<b>Nettovermögen Gesamt</b>	<b>38.658.723,60</b>	<b>100,00</b>
114	POOL CORP	USD	48.204,90	0,12			
2.118	PROCTER & GAMBLE CO/THE	USD	323.630,40	0,84			
2.162	PROGRESSIVE CORP/THE	USD	246.446,38	0,64			
2.550	PROLOGIS INC	USD	411.774,00	1,07			
3.300	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GROUP INC	USD	231.000,00	0,60			
2.610	QUALCOMM INC	USD	398.860,20	1,03			
1.818	QUIDEL CORP	USD	204.452,28	0,53			
808	RLI CORP	USD	89.389,04	0,23			
700	SERVICE CORP INTERNATIONAL/US	USD	46.074,00	0,12			
565	SERVISFIRST BANCSHARES INC	USD	53.838,85	0,14			
918	SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	USD	229.151,16	0,59			
1.858	S&P GLOBAL INC	USD	762.114,44	1,97			
7.000	STARWOOD PROPERTY TRUST INC	USD	169.190,00	0,44			
1.900	TARGA RESOURCES CORP	USD	143.393,00	0,37			
1.080	TERADYNE INC	USD	127.688,40	0,33			
91	TESLA INC	USD	98.061,60	0,25			
827	TEXAS INSTRUMENTS INC	USD	151.737,96	0,39			
1.488	TEXAS ROADHOUSE INC - A	USD	124.590,24	0,32			
713	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	USD	421.133,45	1,09			
60	UNION PACIFIC CORP	USD	16.392,60	0,04			
816	UNITEDHEALTH GROUP INC	USD	416.135,52	1,08			
500	VERIZON COMMUNICATIONS INC	USD	25.470,00	0,07			
1.035	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	USD	270.103,95	0,70			
1.605	VMWARE INC - A	USD	182.761,35	0,47			
600	VONTIER CORP	USD	15.234,00	0,04			
2.702	WALT DISNEY CO/THE	USD	370.606,32	0,96			
96	WASTE MANAGEMENT INC	USD	15.216,00	0,04			
667	WATERS CORP	USD	207.030,13	0,54			
2.000	WELLS FARGO & CO	USD	96.920,00	0,25			
2.700	WEYERHAEUSER CO	USD	102.330,00	0,26			
6.500	WILLIAMS COS INC	USD	217.165,00	0,56			
87	ZEBRA TECHNOLOGIES CORP - A	USD	35.991,90	0,09			
192	ZIFF DAVIS INC	USD	18.581,76	0,05			
2.660	3M CO	USD	396.020,80	1,02			
			<b>37.144.993,73</b>	<b>96,08</b>			
<b>Irland</b>							
2.305	ACCENTURE PLC - A	USD	777.315,15	2,01			
285	ICON PLC - ADR	USD	69.317,70	0,18			
500	JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	USD	32.785,00	0,08			
365	LINDE PLC	USD	116.591,95	0,30			
746	WILLIS TOWERS WATSON PLC	USD	176.220,12	0,46			
			<b>1.172.229,92</b>	<b>3,03</b>			
<b>Jersey</b>							
7.000	AMCOR PLC	USD	79.310,00	0,21			
			<b>79.310,00</b>	<b>0,21</b>			
<b>Bermuda</b>							
453	BUNGE LTD	USD	50.196,93	0,13			
100	ENSTAR GROUP LTD	USD	26.115,00	0,07			
			<b>76.311,93</b>	<b>0,20</b>			
<b>Curacao</b>							
1.300	SCHLUMBERGER NV	USD	53.703,00	0,14			
			<b>53.703,00</b>	<b>0,14</b>			
			<b>38.526.548,58</b>	<b>99,66</b>			
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>			<b>38.526.548,58</b>	<b>99,66</b>			

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) US Credit

(ausgedrückt in USD)

### Statistische Angaben

<b>Nettovermögen</b>	31.03.2022	USD	2.451.617.995,42	Capitalisation Y (USD)	31.03.2022	USD	333,07
	30.09.2021	USD	3.016.046.924,61		30.09.2021	USD	364,68
	30.09.2020	USD	4.915.913.248,42		30.09.2020	USD	361,05
<b>Nettoinventarwert pro Anteil**</b>				Capitalisation Z (USD)	31.03.2022	USD	6.370,24
					30.09.2021	USD	6.903,25
					30.09.2020	USD	6.694,26
Capitalisation I (EUR)	31.03.2022	EUR	6.026,88	Capitalisation Z Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	EUR	5.563,26
	30.09.2021	EUR	6.281,58		30.09.2021	EUR	6.063,82
	30.09.2020	EUR	6.042,32		30.09.2020	EUR	5.934,39
Capitalisation I (USD)	31.03.2022	USD	10.446,57	Distribution I (Q) (USD)	31.03.2022	USD	5.442,17
	30.09.2021	USD	11.341,12		30.09.2021	USD	5.955,95
	30.09.2020	USD	11.037,88		30.09.2020	USD	5.913,74
Capitalisation I Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	EUR	6.511,56	Distribution P (EUR)	31.03.2022	EUR	239,49
	30.09.2021	EUR	7.114,21		30.09.2021	EUR	250,20
	30.09.2020	EUR	6.992,86		30.09.2020	EUR	-
Capitalisation N Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	EUR	27,78	Distribution P (USD)	31.03.2022	USD	3.400,37
	30.09.2021	EUR	30,34		30.09.2021	USD	3.752,39
	30.09.2020	EUR	29,82		30.09.2020	USD	3.743,19
Capitalisation P (EUR)	31.03.2022	EUR	239,29	Distribution P (M) (USD)	31.03.2022	USD	225,72
	30.09.2021	EUR	-		30.09.2021	USD	246,12
	30.09.2020	EUR	-		30.09.2020	USD	-
Capitalisation P (USD)	31.03.2022	USD	1.565,76	Distribution R (USD)	31.03.2022	USD	3.401,14
	30.09.2021	USD	1.703,72		30.09.2021	USD	3.761,04
	30.09.2020	USD	1.665,78		30.09.2020	USD	3.751,64
Capitalisation P Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	EUR	269,75	Distribution X (M) (USD)	31.03.2022	USD	110,64
	30.09.2021	EUR	295,34		30.09.2021	USD	122,75
	30.09.2020	EUR	291,46		30.09.2020	USD	124,58
Capitalisation R (USD)	31.03.2022	USD	290,31	Distribution X (M) Hedged (i) (AUD)	31.03.2022	AUD	241,92
	30.09.2021	USD	315,27		30.09.2021	AUD	269,23
	30.09.2020	USD	307,06		30.09.2020	AUD	274,43
Capitalisation R Hedged (i) (CHF)	31.03.2022	CHF	262,87	Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR)	31.03.2022	ZAR	3.776,00
	30.09.2021	CHF	287,57		30.09.2021	ZAR	4.181,73
	30.09.2020	CHF	283,69		30.09.2020	ZAR	4.236,28
Capitalisation R Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	EUR	230,83	Distribution Y (M) (USD)	31.03.2022	USD	228,03
	30.09.2021	EUR	252,26		30.09.2021	USD	254,46
	30.09.2020	EUR	-		30.09.2020	USD	261,20
Capitalisation R Hedged (i) (GBP)	31.03.2022	GBP	113,17	Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD)	31.03.2022	AUD	260,58
	30.09.2021	GBP	123,12		30.09.2021	AUD	291,74
	30.09.2020	GBP	120,29		30.09.2020	AUD	300,81
Capitalisation R Hedged (i) (SEK)	31.03.2022	SEK	2.281,85	Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR)	31.03.2022	ZAR	3.687,83
	30.09.2021	SEK	2.491,28		30.09.2021	ZAR	4.107,37
	30.09.2020	SEK	-		30.09.2020	ZAR	4.200,03
Capitalisation X (USD)	31.03.2022	USD	1.486,34				
	30.09.2021	USD	1.619,29				
	30.09.2020	USD	1.587,13				

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.



## NN (L) US Credit

(ausgedrückt in USD)

### Anzahl der Anteile

Capitalisation I (EUR)	31.03.2022	5.438
	30.09.2021	5.228
	30.09.2020	2.217
Capitalisation I (USD)	31.03.2022	61.055
	30.09.2021	58.555
	30.09.2020	153.128
Capitalisation I Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	126.618
	30.09.2021	143.565
	30.09.2020	165.580
Capitalisation N Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	810.372
	30.09.2021	852.374
	30.09.2020	1.195.563
Capitalisation P (EUR)	31.03.2022	879
	30.09.2021	-
	30.09.2020	-
Capitalisation P (USD)	31.03.2022	70.037
	30.09.2021	85.145
	30.09.2020	130.042
Capitalisation P Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	105.649
	30.09.2021	117.735
	30.09.2020	229.751
Capitalisation R (USD)	31.03.2022	83.067
	30.09.2021	128.112
	30.09.2020	84.006
Capitalisation R Hedged (i) (CHF)	31.03.2022	17.261
	30.09.2021	62.582
	30.09.2020	67.248
Capitalisation R Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	1.384
	30.09.2021	1.397
	30.09.2020	-
Capitalisation R Hedged (i) (GBP)	31.03.2022	8
	30.09.2021	8
	30.09.2020	2.043
Capitalisation R Hedged (i) (SEK)	31.03.2022	3.489
	30.09.2021	2.061
	30.09.2020	-
Capitalisation X (USD)	31.03.2022	47.271
	30.09.2021	60.860
	30.09.2020	108.035
Capitalisation Y (USD)	31.03.2022	118.054
	30.09.2021	140.638
	30.09.2020	188.506

### Anzahl der Anteile

Capitalisation Z (USD)	31.03.2022	4.531
	30.09.2021	8.147
	30.09.2020	72.424
Capitalisation Z Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	18.853
	30.09.2021	17.460
	30.09.2020	11.681
Distribution I (Q) (USD)	31.03.2022	14.873
	30.09.2021	15.307
	30.09.2020	11.444
Distribution P (EUR)	31.03.2022	1.573
	30.09.2021	100
	30.09.2020	-
Distribution P (USD)	31.03.2022	9.429
	30.09.2021	14.780
	30.09.2020	18.952
Distribution P (M) (USD)	31.03.2022	400
	30.09.2021	400
	30.09.2020	-
Distribution R (USD)	31.03.2022	7.379
	30.09.2021	6.998
	30.09.2020	11.147
Distribution X (M) (USD)	31.03.2022	846.080
	30.09.2021	1.000.111
	30.09.2020	1.348.557
Distribution X (M) Hedged (i) (AUD)	31.03.2022	73.792
	30.09.2021	80.280
	30.09.2020	106.651
Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR)	31.03.2022	13.380
	30.09.2021	13.311
	30.09.2020	22.095
Distribution Y (M) (USD)	31.03.2022	552.466
	30.09.2021	667.351
	30.09.2020	892.734
Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD)	31.03.2022	103.427
	30.09.2021	117.999
	30.09.2020	158.381
Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR)	31.03.2022	49.964
	30.09.2021	57.143
	30.09.2020	80.973

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

## NN (L) US Credit

(ausgedrückt in USD)

### Statistische Angaben (Fortsetzung)

#### Dividende

Distribution I (Q) (USD)	11.02.2022	USD	23,02	Distribution Y (M) (USD)	02.11.2021	USD	0,78
Distribution I (Q) (USD)	11.11.2021	USD	23,60	Distribution Y (M) (USD)	04.10.2021	USD	0,78
Distribution P (USD)	14.12.2021	USD	52,45	Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD)	02.03.2022	AUD	0,92
Distribution P (M) (USD)	02.03.2022	USD	0,24	Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD)	02.02.2022	AUD	0,92
Distribution P (M) (USD)	02.02.2022	USD	0,24	Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD)	04.01.2022	AUD	0,92
Distribution R (USD)	14.12.2021	USD	67,35	Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD)	02.12.2021	AUD	0,92
Distribution X (M) (USD)	02.03.2022	USD	0,36	Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD)	02.11.2021	AUD	0,92
Distribution X (M) (USD)	02.02.2022	USD	0,36	Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD)	04.10.2021	AUD	0,92
Distribution X (M) (USD)	04.01.2022	USD	0,36	Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR)	02.03.2022	ZAR	26,50
Distribution X (M) (USD)	02.12.2021	USD	0,36	Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR)	02.02.2022	ZAR	26,50
Distribution X (M) (USD)	02.11.2021	USD	0,36	Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR)	04.01.2022	ZAR	26,50
Distribution X (M) (USD)	04.10.2021	USD	0,36	Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR)	02.12.2021	ZAR	26,50
Distribution X (M) Hedged (i) (AUD)	02.03.2022	AUD	0,81	Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR)	02.11.2021	ZAR	26,50
Distribution X (M) Hedged (i) (AUD)	02.02.2022	AUD	0,81	Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR)	04.10.2021	ZAR	26,50
Distribution X (M) Hedged (i) (AUD)	04.01.2022	AUD	0,81				
Distribution X (M) Hedged (i) (AUD)	02.12.2021	AUD	0,81	<b>Laufende Kosten in %*</b>			
Distribution X (M) Hedged (i) (AUD)	02.11.2021	AUD	0,81	Capitalisation I (EUR)	31.03.2022		0,49%
Distribution X (M) Hedged (i) (AUD)	04.10.2021	AUD	0,81	Capitalisation I (USD)	31.03.2022		0,49%
Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR)	02.03.2022	ZAR	26,50	Capitalisation I Hedged (i) (EUR)	31.03.2022		0,51%
Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR)	02.02.2022	ZAR	26,50	Capitalisation N Hedged (i) (EUR)	31.03.2022		0,57%
Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR)	04.01.2022	ZAR	26,50	Capitalisation P (EUR)	31.03.2022		0,95%
Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR)	02.12.2021	ZAR	26,50	Capitalisation P (USD)	31.03.2022		0,95%
Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR)	02.11.2021	ZAR	26,50	Capitalisation P Hedged (i) (EUR)	31.03.2022		0,97%
Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR)	04.10.2021	ZAR	26,50	Capitalisation R (USD)	31.03.2022		0,55%
Distribution Y (M) (USD)	02.03.2022	USD	0,78	Capitalisation R Hedged (i) (CHF)	31.03.2022		0,57%
Distribution Y (M) (USD)	02.02.2022	USD	0,78	Capitalisation R Hedged (i) (EUR)	31.03.2022		0,57%
Distribution Y (M) (USD)	04.01.2022	USD	0,78	Capitalisation R Hedged (i) (GBP)	31.03.2022		0,55%
Distribution Y (M) (USD)	02.12.2021	USD	0,78	Capitalisation R Hedged (i) (SEK)	31.03.2022		0,58%

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

## NN (L) US Credit

(ausgedrückt in USD)

### Statistische Angaben (Fortsetzung)

Capitalisation X (USD)	31.03.2022	1,20%
Capitalisation Y (USD)	31.03.2022	2,20%
Capitalisation Z (USD)	31.03.2022	0,13%
Capitalisation Z Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	0,15%
Distribution I (Q) (USD)	31.03.2022	0,49%
Distribution P (EUR)	31.03.2022	0,95%
Distribution P (USD)	31.03.2022	0,95%
Distribution P (M) (USD)	31.03.2022	0,95%
Distribution R (USD)	31.03.2022	0,56%
Distribution X (M) (USD)	31.03.2022	1,20%
Distribution X (M) Hedged (i) (AUD)	31.03.2022	1,22%
Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR)	31.03.2022	1,22%
Distribution Y (M) (USD)	31.03.2022	2,20%
Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD)	31.03.2022	2,22%
Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR)	31.03.2022	2,22%
<b>Portfolioumsatz in %*</b>	31.03.2022	461,74%

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

## NN (L) US Credit

(ausgedrückt in USD)

### Finanzabschlüsse

#### Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022

	Erläuterungen	
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	2	<b>2.385.786.973,89</b>
Aktien		6.239.873,22
Anleihen und andere Schuldtitel		2.379.547.100,67
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	2	<b>556.956,94</b>
Futures		556.956,94
<b>Bankguthaben</b>		<b>42.737.840,06</b>
<b>Hinterlegte Sicherheiten</b>		<b>3.530.473,98</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte</b>	4, 12	<b>89.056.794,34</b>
<b>Vermögenswerte Gesamt</b>		<b>2.521.669.039,21</b>
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>	4	<b>(67.630.833,00)</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	2	<b>(2.420.210,79)</b>
Devisentermingeschäfte		(2.420.210,79)
<b>Verbindlichkeiten Gesamt</b>		<b>(70.051.043,79)</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Berichtszeitraums</b>		<b>2.451.617.995,42</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) US Credit

(ausgedrückt in USD)

## Wertpapierbestand zum 31.03.2022

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW	Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW
<b>Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>									
<b>Aktien</b>									
<b>Vereinigte Staaten</b>									
258.594	SOUTHERN CO/THE	USD	6.239.873,22	0,25					
			<b>6.239.873,22</b>	<b>0,25</b>					
			<b>6.239.873,22</b>	<b>0,25</b>					
<b>Anleihen und andere Schuldtitel</b>									
<b>Vereinigte Staaten</b>									
1.681.000	ABBVIE INC 2.950% 21/11/2026	USD	1.667.472,99	0,07	2.542.000	AMGEN INC 2.450% 21/02/2030	USD	2.390.389,35	0,10
2.539.000	ABBVIE INC 3.200% 14/05/2026	USD	2.545.857,94	0,10	5.092.000	AMGEN INC 3.150% 21/02/2040	USD	4.649.370,16	0,19
4.626.000	ABBVIE INC 3.200% 21/11/2029	USD	4.571.011,02	0,19	1.438.000	AMGEN INC 4.200% 22/02/2052	USD	1.489.295,34	0,06
5.933.000	ABBVIE INC 4.050% 21/11/2039	USD	6.120.298,40	0,25	1.460.000	AMGEN INC 4.400% 22/02/2062	USD	1.515.780,73	0,06
2.219.000	ABBVIE INC 4.250% 21/11/2049	USD	2.315.370,99	0,09	8.562.000	ANHEUSER-BUSCH COS LLC / ANHEUSER-BUSCH INBEV WORLDWIDE INC 3.650% 01/02/2026	USD	8.757.009,74	0,36
4.288.000	ABBVIE INC 4.500% 14/05/2035	USD	4.610.963,16	0,19	13.000.000	ANHEUSER-BUSCH COS LLC / ANHEUSER-BUSCH INBEV WORLDWIDE INC 4.900% 01/02/2046	USD	14.444.038,83	0,59
3.191.000	ABBVIE INC 4.625% 01/10/2042	USD	3.411.277,70	0,14	4.744.000	ANHEUSER-BUSCH INBEV WORLDWIDE INC 4.375% 15/04/2038	USD	4.982.047,04	0,20
1.072.000	AEP TRANSMISSION CO LLC 2.750% 15/08/2051	USD	884.254,23	0,04	4.125.000	ANHEUSER-BUSCH INBEV WORLDWIDE INC 4.439% 06/10/2048	USD	4.318.069,18	0,18
2.176.000	ALABAMA POWER CO 2.800% 01/04/2025	USD	2.162.606,07	0,09	3.158.000	ANHEUSER-BUSCH INBEV WORLDWIDE INC 4.750% 23/01/2029	USD	3.424.194,20	0,14
5.730.000	ALABAMA POWER CO 3.000% 15/03/2052	USD	4.910.400,40	0,20	1.849.000	ANHEUSER-BUSCH INBEV WORLDWIDE INC 5.550% 23/01/2049	USD	2.245.376,42	0,09
1.689.000	ALABAMA POWER CO 3.450% 01/10/2049	USD	1.560.769,41	0,06	550.000	ANTARES HOLDINGS LP 3.750% 15/07/2027	USD	507.454,32	0,02
1.565.000	ALABAMA POWER CO 3.750% 01/03/2045	USD	1.506.661,15	0,06	3.195.000	ANTHEM INC 2.875% 15/09/2029	USD	3.090.468,93	0,13
370.000	ALABAMA POWER CO 3.850% 01/12/2042	USD	361.177,10	0,01	893.000	ANTHEM INC 4.550% 01/03/2048	USD	986.029,83	0,04
2.036.000	ALABAMA POWER CO 4.300% 15/07/2048	USD	2.135.487,82	0,09	2.530.000	ANTHEM INC 4.625% 15/05/2042	USD	2.771.973,22	0,11
3.894.109	ALASKA AIRLINES 2020-1 CLASS A PASS THROUGH TRUST 4.800% 15/08/2027	USD	3.970.026,12	0,16	1.341.000	ANTHEM INC 5.100% 15/01/2044	USD	1.547.206,50	0,06
1.517.000	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC 3.550% 15/03/2052	USD	1.411.118,98	0,06	2.272.000	APPALACHIAN POWER CO 3.400% 01/06/2025	USD	2.294.421,12	0,09
4.608.000	ALLEGHANY CORP 3.625% 15/05/2030	USD	4.638.208,53	0,19	1.132.000	APPALACHIAN POWER CO 4.500% 01/03/2049	USD	1.186.766,34	0,05
2.550.000	ALLIANT ENERGY FINANCE LLC 3.600% 01/03/2032	USD	2.481.114,71	0,10	3.242.000	APPLE INC 2.700% 05/08/2051	USD	2.820.927,58	0,12
5.611.000	AMAZON.COM INC 3.100% 12/05/2051	USD	5.270.531,93	0,21	6.538.000	APPLE INC 2.850% 05/08/2061	USD	3.981.123,58	0,16
4.182.000	AMAZON.COM INC 3.250% 12/05/2061	USD	3.922.051,35	0,16	3.287.000	APPLE INC 3.850% 04/05/2043	USD	3.455.979,61	0,14
2.634.825	AMERICAN AIRLINES 2015-2 CLASS A PASS THROUGH TRUST 4.000% 22/09/2027	USD	2.391.945,04	0,10	2.000.000	APPLE INC 4.250% 09/02/2047	USD	7.329.259,68	0,30
153.527	AMERICAN AIRLINES 2016- CLASS AA PASS THROUGH TRUST 4.100% 15/01/2028	USD	141.086,11	0,01	1.183.000	APPLE INC 4.375% 13/05/2045	USD	1.336.983,35	0,05
3.135.176	AMERICAN AIRLINES 2016-3 CLASS AA PASS THROUGH TRUST 3.000% 15/10/2028	USD	2.933.364,82	0,12	1.500.000	APPLE INC 4.500% 23/02/2036	USD	1.714.218,17	0,07
2.008.133	AMERICAN AIRLINES 2017-1 CLASS A PASS THROUGH TRUST 4.000% 15/02/2029	USD	1.850.169,77	0,08	923.000	APPLE INC 4.650% 23/02/2046	USD	1.088.109,81	0,04
3.117.113	AMERICAN AIRLINES 2017-1 CLASS AA PASS THROUGH TRUST 3.650% 15/02/2029	USD	3.012.031,77	0,12	1.853.000	ARES FINANCE CO IV LLC 3.650% 01/02/2052	USD	1.578.555,88	0,06
4.515.000	AMERICAN AIRLINES 2021-1 CLASS B PASS THROUGH TRUST 3.950% 11/07/2030	USD	4.069.533,03	0,17	2.109.000	ASSURANT INC 2.650% 15/01/2032	USD	1.840.540,29	0,08
1.894.000	AMERICAN ELECTRIC POWER CO INC 15/02/2062 FRN	USD	1.751.478,11	0,07	3.665.000	ASSURANT INC 3.700% 22/02/2030	USD	3.535.277,11	0,14
14.076.000	AMERICAN HOMES 4 RENT LP 4.250% 15/02/2028	USD	14.296.430,30	0,58	6.198.000	AT&T INC 3.500% 01/06/2041	USD	5.707.289,03	0,23
2.181.000	AMERICAN INTERNATIONAL GROUP INC 3.400% 30/06/2030	USD	2.178.079,71	0,09	12.206.000	AT&T INC 3.550% 15/09/2055	USD	10.707.403,59	0,44
4.500.000	AMERICAN INTERNATIONAL GROUP INC 3.875% 15/01/2035	USD	4.580.577,45	0,19	9.735.000	AT&T INC 3.650% 15/09/2059	USD	8.553.820,52	0,35
11.846.000	AMERICAN INTERNATIONAL GROUP INC 3.900% 01/04/2026	USD	12.146.301,90	0,50	3.542.000	AT&T INC 3.800% 01/12/2057	USD	3.234.412,37	0,13
2.601.000	AMERICAN INTERNATIONAL GROUP INC 4.200% 01/04/2028	USD	2.706.273,19	0,11	3.346.000	AUTODESK INC 2.400% 15/12/2031	USD	3.005.348,52	0,12
3.431.000	AMERICAN INTERNATIONAL GROUP INC 4.250% 15/03/2029	USD	3.600.032,61	0,15	2.746.000	AVIATION CAPITAL GROUP LLC 1.950% 20/09/2026	USD	2.487.640,39	0,10
2.770.000	AMERICAN TOWER CORP 3.600% 15/01/2028	USD	2.741.916,19	0,11	2.514.000	AVIATION CAPITAL GROUP LLC 3.875% 01/05/2023	USD	2.525.288,82	0,10
1.775.000	AMERICAN TOWER CORP 3.650% 15/03/2027	USD	1.773.270,00	0,07	2.382.000	AVIATION CAPITAL GROUP LLC 4.375% 30/01/2024	USD	2.397.046,62	0,10
2.841.000	AMERICAN TOWER CORP 4.050% 15/03/2032	USD	2.851.031,49	0,12	7.439.000	BANK OF AMERICA CORP 04/02/2033 FRN	USD	6.977.351,36	0,28
855.000	AMERICAN TOWER CORP 4.400% 15/02/2026	USD	878.773,97	0,04	5.982.000	BANK OF AMERICA CORP 08/03/2037 FRN	USD	5.735.458,15	0,23
3.114.000	AMGEN INC 2.200% 21/02/2027	USD	2.993.207,10	0,12	5.364.000	BANK OF AMERICA CORP 11/03/2027 FRN	USD	5.010.069,76	0,20
1.724.000	AMGEN INC 2.300% 25/02/2031	USD	1.586.162,20	0,06	9.692.000	BANK OF AMERICA CORP 13/02/2026 FRN	USD	9.330.994,03	0,38
					834.000	BANK OF AMERICA CORP 19/06/2041 FRN	USD	706.839,76	0,03
					2.008.000	BANK OF AMERICA CORP 20/03/2051 FRN	USD	2.073.290,02	0,08
					2.680.000	BANK OF AMERICA CORP 20/12/2028 FRN	USD	2.656.049,64	0,11
					3.889.000	BANK OF AMERICA CORP 21/07/2032 FRN	USD	3.461.015,39	0,14
					6.976.000	BANK OF AMERICA CORP 22/04/2025 FRN	USD	6.684.054,89	0,27
					8.766.000	BANK OF AMERICA CORP 22/04/2032 FRN	USD	8.057.158,89	0,33
					3.478.000	BANK OF AMERICA CORP 23/04/2040 FRN	USD	3.569.259,73	0,15
					4.815.000	BANK OF AMERICA CORP 23/07/2029 FRN	USD	4.972.681,96	0,20
					4.195.000	BANK OF AMERICA CORP 23/07/2030 FRN	USD	4.061.750,36	0,17
					12.000.000	BANK OF AMERICA CORP 23/07/2031 FRN	USD	10.479.890,16	0,43
					3.794.000	BANK OF AMERICA CORP 24/04/2028 FRN	USD	3.824.215,76	0,16
					3.052.000	BANK OF AMERICA CORP 25/09/2025 FRN	USD	2.895.899,51	0,12
					1.324.000	BANK OF AMERICA CORP 29/04/2031 FRN	USD	1.223.061,02	0,05
					4.778.000	BANK OF AMERICA CORP 4.250% 22/10/2026	USD	4.923.499,23	0,20
					4.481.000	BANK OF AMERICA CORP 6.110% 29/01/2037	USD	5.353.230,32	0,22
					1.865.000	BAXTER INTERNATIONAL INC 1.915% 01/02/2027	USD	1.744.086,70	0,07
					2.480.000	BERKSHIRE HATHAWAY FINANCE CORP 3.850% 15/03/2052	USD	2.540.117,93	0,10

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) US Credit

(ausgedrückt in USD)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW	Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW
4.056.000	BLACKROCK INC 2.100% 25/02/2032	USD	3.674.667,62	0,15	1.511.000	CITIGROUP INC 03/11/2042 FRN	USD	1.297.156,90	0,05
3.750.000	BLACKSTONE HOLDINGS FINANCE CO LLC 2.000% 30/01/2032	USD	3.262.179,04	0,13	1.723.000	CITIGROUP INC 08/04/2026 FRN	USD	1.708.503,80	0,07
5.033.000	BLACKSTONE HOLDINGS FINANCE CO LLC 2.850% 05/08/2051	USD	4.064.919,51	0,17	1.834.000	CITIGROUP INC 24/02/2028 FRN	USD	1.789.646,34	0,07
2.972.000	BLACKSTONE HOLDINGS FINANCE CO LLC 3.200% 30/01/2052	USD	2.558.720,90	0,10	1.923.000	CITIGROUP INC 30/10/2024 FRN	USD	1.858.123,94	0,08
3.267.000	BLACKSTONE PRIVATE CREDIT FUND 4.000% 15/01/2029	USD	3.024.366,64	0,12	1.719.000	CITIGROUP INC 31/03/2031 FRN	USD	1.789.956,99	0,07
5.828.000	BOEING CO/THE 3.250% 01/02/2028	USD	5.628.772,21	0,23	8.446.000	CITIGROUP INC 4.450% 29/09/2027	USD	8.707.290,02	0,36
1.134.000	BOEING CO/THE 3.850% 01/11/2048	USD	995.068,90	0,04	10.391.000	CMS ENERGY CORP 01/06/2050 FRN	USD	10.247.872,50	0,42
5.819.000	BOEING CO/THE 4.508% 01/05/2023	USD	5.918.449,44	0,24	2.773.000	CNO GLOBAL FUNDING 2.650% 06/01/2029	USD	2.562.578,69	0,10
3.667.000	BOEING CO/THE 4.875% 01/05/2025	USD	3.786.831,55	0,15	5.365.000	COMCAST CORP 2.887% 01/11/2051	USD	4.554.765,20	0,19
6.626.000	BOEING CO/THE 5.705% 01/05/2040	USD	7.421.846,01	0,30	7.244.000	COMCAST CORP 2.937% 01/11/2056	USD	6.041.380,68	0,25
2.419.000	BOEING CO/THE 5.805% 01/05/2050	USD	2.791.490,49	0,11	1.030.000	COMCAST CORP 3.200% 15/07/2036	USD	985.671,51	0,04
927.000	BOEING CO/THE 5.930% 01/05/2060	USD	1.073.067,33	0,04	4.245.000	COMCAST CORP 3.250% 01/11/2039	USD	4.017.726,31	0,16
1.053.000	BOSTON SCIENTIFIC CORP 4.700% 01/03/2049	USD	1.174.009,99	0,05	2.552.000	COMCAST CORP 3.900% 01/03/2038	USD	2.619.511,76	0,11
1.120.000	BP CAPITAL MARKETS AMERICA INC 3.000% 24/02/2050	USD	1.079.006,87	0,04	2.801.000	COMCAST CORP 4.000% 15/08/2047	USD	2.873.668,61	0,12
2.328.000	BP CAPITAL MARKETS AMERICA INC 3.379% 08/02/2061	USD	2.071.382,95	0,08	3.641.000	COMCAST CORP 5.650% 15/06/2035	USD	4.363.926,85	0,18
5.201.000	BP CAPITAL MARKETS AMERICA INC 3.410% 11/02/2026	USD	5.262.715,59	0,21	1.046.000	COMCAST CORP 6.500% 15/11/2035	USD	1.354.495,72	0,06
4.238.000	BP CAPITAL MARKETS AMERICA INC 3.937% 21/09/2028	USD	4.384.216,21	0,18	2.387.000	COMMONWEALTH EDISON CO 3.800% 01/10/2042	USD	2.381.165,93	0,10
2.964.000	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO 3.200% 15/06/2026	USD	3.008.529,65	0,12	2.264.000	CONSOLIDATED EDISON CO OF NEW YORK INC 4.625% 01/12/2054	USD	2.455.510,31	0,10
5.476.000	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO 3.700% 15/03/2052	USD	5.509.562,40	0,22	5.526.771	CONTINENTAL AIRLINES 2012-2 CLASS A PASS THROUGH TRUST 4.000% 29/10/2024	USD	5.517.673,82	0,23
1.283.000	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO 3.900% 15/03/2062	USD	1.296.080,85	0,05	7.991.000	COTERRA ENERGY INC 3.900% 15/05/2027	USD	8.070.423,19	0,33
1.768.000	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO 4.250% 26/10/2049	USD	1.935.311,94	0,08	622.000	COTERRA ENERGY INC 4.375% 15/03/2029	USD	648.182,96	0,03
2.195.000	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO 4.550% 20/02/2048	USD	2.495.752,42	0,10	4.761.000	CSX CORP 4.650% 01/03/2068	USD	5.259.420,52	0,21
7.422.000	BROADCOM INC 3.187% 15/11/2036	USD	6.521.916,25	0,27	3.639.000	CUBESMART LP 2.500% 15/02/2032	USD	3.258.919,37	0,13
2.628.000	BROADCOM INC 3.419% 15/04/2033	USD	2.452.488,49	0,10	4.174.000	CVS HEALTH CORP 1.300% 21/08/2027	USD	3.796.560,21	0,15
4.296.000	BROADCOM INC 4.150% 15/11/2030	USD	4.351.979,07	0,18	2.136.000	CVS HEALTH CORP 2.700% 21/08/2040	USD	1.813.625,37	0,07
2.541.000	BURLINGTON NORTHERN SANTA FE LLC 4.375% 01/09/2042	USD	2.753.288,68	0,11	10.177.000	CVS HEALTH CORP 4.780% 25/03/2038	USD	11.109.865,24	0,45
1.530.000	BURLINGTON NORTHERN SANTA FE LLC 4.400% 15/03/2042	USD	1.659.366,96	0,07	3.670.000	CVS HEALTH CORP 5.050% 25/03/2048	USD	4.158.226,71	0,17
1.629.000	BURLINGTON NORTHERN SANTA FE LLC 4.900% 01/04/2044	USD	1.881.417,83	0,08	530.016	DELTA AIR LINES 2015-1 CLASS AA PASS THROUGH TRUST 3.625% 30/07/2027	USD	520.569,37	0,02
2.162.000	BURLINGTON NORTHERN SANTA FE LLC 5.150% 01/09/2043	USD	2.564.134,83	0,10	2.714.410	DELTA AIR LINES 2020-1 CLASS A PASS THROUGH TRUST 2.500% 10/06/2028	USD	2.508.922,12	0,10
4.462.000	CAMERON LNG LLC 2.902% 15/07/2031	USD	4.253.849,17	0,17	1.795.000	DIAMONDBACK ENERGY INC 3.125% 24/03/2031	USD	1.714.749,43	0,07
2.729.000	CAPITAL ONE FINANCIAL CORP 01/03/2030 FRN	USD	2.644.795,83	0,11	2.281.000	DIAMONDBACK ENERGY INC 3.250% 01/12/2026	USD	2.278.486,54	0,09
2.546.000	CAPITAL ONE FINANCIAL CORP 03/03/2026 FRN	USD	2.498.563,87	0,10	5.422.000	DIAMONDBACK ENERGY INC 3.500% 01/12/2029	USD	5.369.673,85	0,22
10.403.000	CCO HOLDINGS LLC / CCO HOLDINGS CAPITAL CORP 4.250% 01/02/2031	USD	9.482.152,45	0,39	2.864.000	DIAMONDBACK ENERGY INC 4.400% 24/03/2051	USD	2.903.732,07	0,12
7.571.000	CCO HOLDINGS LLC / CCO HOLDINGS CAPITAL CORP 4.500% 01/05/2032	USD	6.928.357,39	0,28	1.349.000	DISCOVERY COMMUNICATIONS LLC 3.450% 15/03/2025	USD	1.339.077,36	0,05
2.170.000	CCO HOLDINGS LLC / CCO HOLDINGS CAPITAL CORP 4.500% 01/06/2033	USD	1.947.575,00	0,08	2.977.000	DISCOVERY COMMUNICATIONS LLC 4.875% 01/04/2043	USD	2.991.334,40	0,12
3.647.000	CCO HOLDINGS LLC / CCO HOLDINGS CAPITAL CORP 4.750% 01/02/2032	USD	3.398.725,73	0,14	3.558.000	DISCOVERY COMMUNICATIONS LLC 5.300% 15/05/2049	USD	3.746.896,25	0,15
4.184.000	CENTENE CORP 2.450% 15/07/2028	USD	3.822.512,69	0,16	3.179.000	DOW CHEMICAL CO/THE 2.100% 15/11/2030	USD	2.862.484,80	0,12
772.000	CHARLES SCHWAB CORP 2.300% 13/05/2031	USD	709.985,10	0,03	4.500.000	DOW CHEMICAL CO/THE 4.375% 15/11/2042	USD	4.677.252,66	0,19
1.449.000	CHARLES SCHWAB CORP 2.450% 03/03/2027	USD	1.408.209,53	0,06	3.264.000	DOW CHEMICAL CO/THE 5.550% 30/11/2048	USD	3.982.547,93	0,16
2.976.000	CHARLES SCHWAB CORP 2.900% 03/03/2032	USD	2.867.362,13	0,12	111.000	DUKE ENERGY CAROLINAS LLC 3.700% 01/12/2047	USD	109.922,95	0,00
4.250.000	CHARTER COMMUNICATIONS OPERATING LLC / CHARTER COMMUNICATIONS OPERATING CAPITAL 3.950% 30/06/2062	USD	3.450.530,46	0,14	358.000	DUKE ENERGY CAROLINAS LLC 3.750% 01/06/2045	USD	351.145,35	0,01
876.000	CHARTER COMMUNICATIONS OPERATING LLC / CHARTER COMMUNICATIONS OPERATING CAPITAL 6.484% 23/10/2045	USD	998.410,92	0,04	1.611.000	DUKE ENERGY CAROLINAS LLC 3.875% 15/03/2046	USD	1.637.357,23	0,07
1.638.000	CHENIERE CORPUS CHRISTI HOLDINGS LLC 3.700% 15/11/2029	USD	1.632.808,51	0,07	113.000	DUKE ENERGY CAROLINAS LLC 3.950% 15/03/2048	USD	116.728,19	0,00
437.000	CHENIERE CORPUS CHRISTI HOLDINGS LLC 5.125% 30/06/2027	USD	465.963,35	0,02	4.875.000	DUKE ENERGY CAROLINAS LLC 4.000% 30/09/2042	USD	5.007.158,03	0,20
809.000	CHEVRON USA INC 3.250% 15/10/2029	USD	822.052,34	0,03	2.879.000	DUKE ENERGY CAROLINAS LLC 4.250% 15/12/2041	USD	3.015.340,95	0,12
2.414.000	CHUBB INA HOLDINGS INC 2.850% 15/12/2051	USD	2.095.957,96	0,09	1.912.000	DUKE ENERGY CAROLINAS LLC 6.450% 15/10/2032	USD	2.327.289,06	0,09
4.189.000	CIGNA CORP 3.200% 15/03/2040	USD	3.810.253,07	0,16	8.580.000	DUKE ENERGY CORP 2.550% 15/06/2031	USD	7.866.896,72	0,32
1.656.000	CIGNA CORP 3.400% 15/03/2050	USD	1.495.035,19	0,06	812.000	DUKE ENERGY CORP 3.150% 15/08/2027	USD	803.833,49	0,03
1.263.000	CIGNA CORP 4.125% 15/11/2025	USD	1.302.651,04	0,05	1.942.000	DUKE ENERGY FLORIDA LLC 2.400% 15/12/2031	USD	1.793.584,79	0,07
6.229.000	CIGNA CORP 4.800% 15/08/2038	USD	6.848.698,36	0,28	438.000	DUKE ENERGY FLORIDA LLC 4.200% 15/07/2048	USD	464.070,38	0,02
2.186.000	CIGNA CORP 4.900% 15/12/2048	USD	2.461.000,37	0,10	3.499.000	DUKE ENERGY INDIANA LLC 3.250% 01/10/2049	USD	3.182.841,31	0,13
					2.492.000	DUKE ENERGY OHIO INC 3.700% 15/06/2046	USD	2.431.626,02	0,10
					1.723.000	DUKE ENERGY OHIO INC 4.300% 01/02/2049	USD	1.840.005,95	0,08
					4.191.000	DUKE ENERGY PROGRESS LLC 4.100% 15/03/2043	USD	4.303.995,65	0,18

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) US Credit

(ausgedrückt in USD)

## Wertpapierbestand zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl/ Nominal	Bezeich- nung	Währung	Marktwert in USD	% NIW	Stückzahl/ Nominal	Bezeich- nung	Währung	Marktwert in USD	% NIW
4.482.000	DUKE ENERGY PROGRESS LLC 4.100% 15/05/2042	USD	4.614.857,10	0,19	1.654.000	GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE 28/10/2027 FRN GMTN	USD	1.707.136,98	0,07
2.818.000	DUKE ENERGY PROGRESS LLC 4.150% 01/12/2044	USD	2.915.105,69	0,12	2.614.000	GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE 3.500% 01/04/2025	USD	2.635.202,26	0,11
3.176.000	DUKE ENERGY PROGRESS LLC 4.200% 15/08/2045	USD	3.344.397,43	0,14	485.000	GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE 6.250% 01/02/2041	USD	626.214,60	0,03
5.326.000	EMPOWER FINANCE 2020 LP 1.357% 17/09/2027	USD	4.807.685,50	0,20	1.684.000	GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE 6.450% 01/05/2036	USD	2.057.814,37	0,08
4.919.000	ENSTAR FINANCE LLC 15/01/2042 FRN	USD	4.678.893,77	0,19	5.752.000	GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE 6.750% 01/10/2037	USD	7.266.117,25	0,30
456.000	ENERGY ARKANSAS LLC 2.650% 15/06/2051	USD	374.419,52	0,02	1.077.000	GSK CONSUMER HEALTHCARE CAPITAL US LLC 3.375% 24/03/2029	USD	1.067.282,83	0,04
1.481.000	ENERGY ARKANSAS LLC 3.350% 15/06/2052	USD	1.378.972,87	0,06	7.111.000	HARLEY-DAVIDSON FINANCIAL SERVICES INC 3.050% 14/02/2027	USD	6.775.966,02	0,28
521.000	ENERGY ARKANSAS LLC 4.000% 01/06/2028	USD	533.414,08	0,02	5.375.000	HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP INC/THE 12/02/2047 FRN	USD	4.730.890,32	0,19
2.471.000	ENERGY ARKANSAS LLC 4.200% 01/04/2049	USD	2.632.711,11	0,11	2.040.000	HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP INC/THE 5.950% 15/10/2036	USD	2.410.141,21	0,10
696.000	ENERGY LOUISIANA LLC 0.620% 17/11/2023	USD	675.624,47	0,03	3.905.000	HASBRO INC 3.000% 19/11/2024	USD	3.887.561,17	0,16
425.000	ENERGY LOUISIANA LLC 3.250% 01/04/2028	USD	420.924,40	0,02	1.776.000	HCA INC 3.375% 15/03/2029	USD	1.729.384,92	0,07
1.618.000	ENERGY LOUISIANA LLC 4.000% 15/03/2033	USD	1.687.298,79	0,07	2.500.000	HCA INC 3.625% 15/03/2032	USD	2.452.731,98	0,10
402.000	ENERGY LOUISIANA LLC 4.050% 01/09/2023	USD	408.614,81	0,02	4.037.000	HCA INC 4.125% 15/06/2029	USD	4.111.251,53	0,17
1.841.000	ENERGY LOUISIANA LLC 4.200% 01/09/2048	USD	1.947.946,75	0,08	1.776.000	HCA INC 4.625% 15/03/2052	USD	1.802.185,97	0,07
12.645.000	ENERGY LOUISIANA LLC 4.950% 15/01/2045	USD	13.114.673,36	0,53	5.319.000	HCA INC 5.250% 15/06/2049	USD	5.849.216,11	0,24
2.508.000	ENERGY LOUISIANA LLC 5.400% 01/11/2024	USD	2.649.418,87	0,11	3.149.000	HCA INC 5.875% 01/02/2029	USD	3.452.811,87	0,14
1.504.000	ENERGY LOUISIANA LLC 5.590% 01/10/2024	USD	1.584.932,07	0,06	3.411.000	HERSHEY COMPANY 3.125% 15/11/2049	USD	3.162.698,47	0,13
892.000	ENERGY MISSISSIPPI LLC 3.500% 01/06/2051	USD	844.318,65	0,03	3.288.000	HESS CORP 4.300% 01/04/2027	USD	3.377.658,47	0,14
1.426.000	ENERGY MISSISSIPPI LLC 3.850% 01/06/2049	USD	1.429.841,34	0,06	6.987.000	HESS CORP 5.600% 15/02/2041	USD	7.862.890,25	0,32
4.139.000	ENTERPRISE PRODUCTS OPERATING LLC 3.950% 31/01/2060	USD	3.859.692,75	0,16	3.475.000	HOME DEPOT INC 3.250% 15/04/2032	USD	3.479.440,22	0,14
2.995.000	ERP OPERATING LP 2.850% 01/11/2026	USD	2.944.797,36	0,12	2.120.000	HOME DEPOT INC 3.625% 15/04/2052	USD	2.116.535,90	0,09
1.572.000	ERP OPERATING LP 3.000% 01/07/2029	USD	1.543.050,35	0,06	5.529.000	HOME DEPOT INC/THE 2.750% 15/09/2051	USD	4.557.403,86	0,19
2.406.000	ERP OPERATING LP 3.250% 01/08/2027	USD	2.392.410,60	0,10	3.290.000	HOME DEPOT INC/THE 3.300% 15/04/2040	USD	3.173.207,40	0,13
2.726.000	ERP OPERATING LP 4.000% 01/08/2047	USD	2.800.664,02	0,11	2.588.000	HORMEL FOODS CORP 1.700% 03/06/2028	USD	2.386.320,58	0,10
1.065.000	ERP OPERATING LP 4.500% 01/07/2044	USD	1.167.443,40	0,05	1.685.000	HORMEL FOODS CORP 3.050% 03/06/2051	USD	1.519.119,38	0,06
9.556.000	EVERSOURCE ENERGY 1.400% 15/08/2026	USD	8.809.184,74	0,36	699.000	HP INC 4.200% 15/04/2032	USD	696.858,01	0,03
3.641.000	EVERSOURCE ENERGY 2.900% 01/03/2027	USD	3.571.002,61	0,15	2.429.000	HUMANA INC 3.700% 23/03/2029	USD	2.438.544,08	0,10
5.660.000	EXELON CORP 4.950% 15/06/2035	USD	6.080.881,51	0,25	3.240.000	HUMANA INC 4.625% 01/12/2042	USD	3.460.847,83	0,14
2.250.000	EXTRA SPACE STORAGE LP 3.900% 01/04/2029	USD	2.259.515,48	0,09	1.125.000	INDIANA MICHIGAN POWER CO 3.850% 15/05/2028	USD	1.145.330,99	0,05
1.547.000	EXXON MOBIL CORP 2.019% 16/08/2024	USD	1.531.322,55	0,06	1.240.000	INDIANA MICHIGAN POWER CO 6.050% 15/03/2037	USD	1.503.349,17	0,06
4.530.000	EXXON MOBIL CORP 2.275% 16/08/2026	USD	4.439.259,34	0,18	3.442.000	INGERSOLL-RAND GLOBAL HOLDING CO LTD 4.250% 15/06/2023	USD	3.505.829,34	0,14
1.633.000	EXXON MOBIL CORP 2.440% 16/08/2029	USD	1.565.160,82	0,06	6.198.000	INTEL CORP 2.800% 12/08/2041	USD	5.506.017,72	0,22
2.170.000	EXXON MOBIL CORP 2.995% 16/08/2039	USD	2.007.769,52	0,08	2.490.000	INTEL CORP 3.200% 12/08/2061	USD	2.202.109,51	0,09
6.637.000	EXXON MOBIL CORP 4.227% 19/03/2040	USD	7.165.024,39	0,29	1.935.000	INTEL CORP 3.700% 29/07/2025	USD	1.981.819,20	0,08
6.196.000	FEDEX CORP 3.875% 01/08/2042	USD	5.966.599,85	0,24	1.264.000	INTEL CORP 4.750% 25/03/2050	USD	1.472.695,63	0,06
1.113.000	FEDEX CORP 3.900% 01/02/2035	USD	1.106.379,12	0,05	6.120.000	INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP 3.500% 15/05/2029	USD	6.241.295,10	0,25
858.000	FEDEX CORP 4.100% 15/04/2043	USD	844.110,61	0,03	1.489.000	INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCES INC 3.468% 01/12/2050	USD	1.317.824,37	0,05
13.645.000	FIRSTENERGY CORP 4.400% 15/07/2027	USD	13.735.481,91	0,56	2.699.000	INVITATION HOMES OPERATING PARTNERSHIP LP 2.000% 15/08/2031	USD	2.308.398,61	0,09
6.380.000	FISERV INC 3.500% 01/07/2029	USD	6.278.350,46	0,26	4.813.000	INVITATION HOMES OPERATING PARTNERSHIP LP 2.300% 15/11/2028	USD	4.374.601,35	0,18
963.000	FLORIDA POWER & LIGHT CO 2.875% 04/12/2051	USD	863.363,10	0,04	1.485.000	INVITATION HOMES OPERATING PARTNERSHIP LP 2.700% 15/01/2034	USD	1.299.549,61	0,05
1.705.000	FLORIDA POWER & LIGHT CO 5.400% 01/09/2035	USD	2.017.410,82	0,08	3.535.000	INVITATION HOMES OPERATING PARTNERSHIP LP 4.150% 15/04/2032	USD	3.617.021,79	0,15
988.000	FLORIDA POWER & LIGHT CO 5.650% 01/02/2037	USD	1.192.373,52	0,05	3.245.000	IPALCO ENTERPRISES INC 3.700% 01/09/2024	USD	3.248.830,66	0,13
2.665.000	FORD MOTOR CREDIT CO LLC 3.375% 13/11/2025	USD	2.605.816,29	0,11	3.617.000	IPALCO ENTERPRISES INC 4.250% 01/05/2030	USD	3.620.418,43	0,15
455.000	FORD MOTOR CREDIT CO LLC 4.125% 17/08/2027	USD	444.916,84	0,02	3.811.000	J M SMUCKER CO/THE 2.750% 15/09/2041	USD	3.117.305,05	0,13
3.220.000	FORD MOTOR CREDIT CO LLC 5.125% 16/06/2025	USD	3.300.616,82	0,13	2.024.000	JOHNSON & JOHNSON 2.100% 01/09/2040	USD	1.698.387,32	0,07
3.657.000	FORD MOTOR CREDIT CO LLC 5.584% 18/03/2024	USD	3.765.051,48	0,15	3.378.000	JOHNSON & JOHNSON 3.625% 03/03/2037	USD	3.500.896,34	0,14
4.426.000	FORTINET INC 1.000% 15/03/2026	USD	4.028.362,49	0,16	1.106.000	JOHNSON & JOHNSON 3.700% 01/03/2046	USD	1.162.325,12	0,05
1.230.000	FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC 4.500% 25/03/2052	USD	1.211.422,70	0,05	2.615.000	JPMORGAN CHASE & CO 01/06/2028 FRN	USD	2.454.788,34	0,10
2.563.000	GATX CORP 3.500% 01/06/2032	USD	2.474.433,25	0,10	3.509.000	JPMORGAN CHASE & CO 01/06/2029 FRN	USD	3.225.710,99	0,13
2.388.000	GENERAL MOTORS CO 5.950% 01/04/2049	USD	2.665.836,56	0,11	8.791.000	JPMORGAN CHASE & CO 04/02/2027 FRN	USD	8.051.467,59	0,33
6.778.000	GENERAL MOTORS CO 6.750% 01/04/2046	USD	8.196.687,79	0,33	8.500.000	JPMORGAN CHASE & CO 04/02/2032 FRN	USD	7.426.554,30	0,30
1.731.000	GEORGIA POWER CO 4.300% 15/03/2043	USD	1.736.167,21	0,07	5.862.000	JPMORGAN CHASE & CO 05/12/2029 FRN	USD	6.127.333,76	0,25
2.093.000	GEORGIA-PACIFIC LLC 0.625% 15/05/2024	USD	1.998.895,54	0,08	1.851.000	JPMORGAN CHASE & CO 08/11/2032 FRN	USD	1.689.496,94	0,07
2.409.000	GEORGIA-PACIFIC LLC 2.100% 30/04/2027	USD	2.273.934,57	0,09					
2.630.000	GILEAD SCIENCES INC 0.750% 29/09/2023	USD	2.566.930,60	0,10					
5.680.000	GILEAD SCIENCES INC 3.500% 01/02/2025	USD	5.758.973,70	0,23					
7.059.000	GLOBAL PAYMENTS INC 4.450% 01/06/2028	USD	7.272.079,37	0,30					
3.875.000	GOLDMAN SACHS CAPITAL I 6.345% 15/02/2034	USD	4.568.569,05	0,19					
430.000	GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE 21/07/2032 FRN	USD	382.109,22	0,02					

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.



## NN (L) US Credit

(ausgedrückt in USD)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW	Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW
19.131.000	JPMORGAN CHASE & CO 15/10/2025 FRN	USD	18.692.410,92	0,77	2.571.000	MORGAN STANLEY 10/12/2026 FRN	USD	2.364.440,62	0,10
1.627.000	JPMORGAN CHASE & CO 15/11/2048 FRN	USD	1.663.668,30	0,07	5.470.000	MORGAN STANLEY 18/02/2026 FRN	USD	5.369.522,28	0,22
863.000	JPMORGAN CHASE & CO 19/11/2041 FRN	USD	714.471,24	0,03	14.400.000	MORGAN STANLEY 20/07/2027 FRN GMTN	USD	13.270.886,06	0,54
2.895.000	JPMORGAN CHASE & CO 22/04/2041 FRN	USD	2.615.626,16	0,11	2.722.000	MORGAN STANLEY 20/10/2032 FRN	USD	2.464.827,84	0,10
2.482.000	JPMORGAN CHASE & CO 22/04/2042 FRN	USD	2.249.581,03	0,09	1.492.000	MORGAN STANLEY 21/01/2028 FRN	USD	1.422.843,98	0,06
3.993.000	JPMORGAN CHASE & CO 22/04/2051 FRN	USD	3.551.136,70	0,14	5.000.000	MORGAN STANLEY 21/01/2033 FRN	USD	4.685.094,55	0,19
4.215.000	JPMORGAN CHASE & CO 22/04/2052 FRN	USD	3.899.797,28	0,16	9.092.000	MORGAN STANLEY 21/07/2032 FRN GMTN	USD	8.061.506,81	0,33
7.990.000	JPMORGAN CHASE & CO 22/09/2027 FRN	USD	7.386.673,10	0,30	2.680.000	MORGAN STANLEY 22/01/2025 FRN GMTN	USD	2.572.966,94	0,10
16.548.000	JPMORGAN CHASE & CO 23/06/2025 FRN	USD	15.803.811,95	0,65	5.286.000	MORGAN STANLEY 22/07/2025 FRN	USD	5.229.944,08	0,21
3.834.000	JPMORGAN CHASE & CO 24/02/2026 FRN	USD	3.765.910,88	0,15	3.799.000	MORGAN STANLEY 24/04/2024 FRN	USD	3.836.789,91	0,16
5.620.000	JPMORGAN CHASE & CO 24/02/2028 FRN	USD	5.484.259,92	0,22	6.600.000	MORGAN STANLEY 28/04/2026 FRN	USD	6.384.837,82	0,26
1.117.000	JPMORGAN CHASE & CO 25/01/2033 FRN	USD	1.054.180,17	0,04	4.555.000	MORGAN STANLEY 28/04/2032 FRN	USD	3.936.596,57	0,16
1.459.000	KILROY REALTY LP 3.450% 15/12/2024	USD	1.463.481,55	0,06	1.662.000	MORGAN STANLEY 3.625% 20/01/2027	USD	1.677.813,10	0,07
5.695.000	KIMCO REALTY CORP 3.800% 01/04/2027	USD	5.760.519,78	0,23	6.625.000	MOSAIC CO 5.450% 15/11/2033	USD	7.620.560,94	0,31
3.679.000	KROGER CO/THE 2.200% 01/05/2030	USD	3.366.008,89	0,14	1.045.000	MOSAIC CO 5.625% 15/11/2043	USD	1.257.679,36	0,05
1.321.000	KYNDRYL HOLDINGS INC 2.050% 15/10/2026	USD	1.186.956,37	0,05	1.098.000	MOSAIC CO/THE 4.875% 15/11/2041	USD	1.172.076,38	0,05
5.341.000	KYNDRYL HOLDINGS INC 2.700% 15/10/2028	USD	4.643.439,12	0,19	2.854.000	MPLX LP 1.750% 01/03/2026	USD	2.678.342,04	0,11
3.506.000	KYNDRYL HOLDINGS INC 3.150% 15/10/2031	USD	2.960.352,21	0,12	2.439.000	MPLX LP 2.650% 15/08/2030	USD	2.239.890,58	0,09
6.776.000	LIBERTY MUTUAL GROUP INC 4.300% 01/02/2061	USD	5.351.394,85	0,22	2.590.000	MPLX LP 4.000% 15/02/2025	USD	2.623.461,79	0,11
3.786.000	LIFE STORAGE LP 2.400% 15/10/2031	USD	3.342.899,47	0,14	1.558.000	MPLX LP 4.700% 15/04/2048	USD	1.570.632,47	0,06
1.733.000	LOWE'S COS INC 3.750% 01/04/2032	USD	1.754.305,33	0,07	7.429.000	MPLX LP 5.200% 01/03/2047	USD	8.008.593,72	0,33
1.058.000	LOWE'S COS INC 4.250% 01/04/2052	USD	1.097.818,45	0,04	2.350.000	MPLX LP 5.200% 01/12/2047	USD	2.500.916,25	0,10
1.411.000	LOWE'S COS INC 4.450% 01/04/2062	USD	1.467.172,64	0,06	2.180.000	MPLX LP 5.500% 15/02/2049	USD	2.420.990,13	0,10
1.723.000	LOWE'S COS INC 4.650% 15/04/2042	USD	1.855.773,81	0,08	3.873.000	MYLAN INC 5.200% 15/04/2048	USD	3.810.527,00	0,16
1.483.000	LYB INTERNATIONAL FINANCE III LLC 4.200% 15/10/2049	USD	1.470.218,57	0,06	1.811.000	NASDAQ INC 3.950% 07/03/2052	USD	1.763.029,38	0,07
5.390.000	MAGALLANES INC 3.755% 15/03/2027	USD	5.383.863,54	0,22	5.010.000	NATIONAL RURAL UTILITIES COOPERATIVE FINANCE CORP 20/04/2046 FRN	USD	5.037.765,92	0,21
4.901.000	MAGALLANES INC 4.279% 15/03/2032	USD	4.934.722,07	0,20	1.854.000	NATIONAL RURAL UTILITIES COOPERATIVE FINANCE CORP 2.750% 15/04/2032	USD	1.750.925,29	0,07
7.282.000	MAGALLANES INC 5.050% 15/03/2042	USD	7.436.876,63	0,30	2.285.000	NATIONAL RURAL UTILITIES COOPERATIVE FINANCE CORP 3.050% 25/04/2027	USD	2.260.753,80	0,09
6.971.000	MAGALLANES INC 5.141% 15/03/2052	USD	7.145.428,08	0,29	2.557.000	NATIONAL RURAL UTILITIES COOPERATIVE FINANCE CORP 4.023% 01/11/2032	USD	2.628.607,15	0,11
1.781.000	MAGALLANES INC 5.391% 15/03/2062	USD	1.842.481,58	0,08	2.267.000	NESTLE HOLDINGS INC 2.625% 14/09/2051	USD	1.946.647,65	0,08
7.215.000	MAIN STREET CAPITAL CORP 3.000% 14/07/2026	USD	6.717.113,27	0,27	5.801.000	NEW YORK STATE ELECTRIC & GAS CORP 3.250% 01/12/2026	USD	5.757.655,45	0,23
2.352.000	MARATHON PETROLEUM CORP 4.750% 15/09/2044	USD	2.393.678,17	0,10	7.802.000	NEXTERA ENERGY CAPITAL HOLDINGS INC 03/11/2023 FRN	USD	7.770.952,57	0,32
3.123.000	MARATHON PETROLEUM CORP 5.000% 15/09/2054	USD	3.242.731,23	0,13	7.492.000	NEXTERA ENERGY CAPITAL HOLDINGS INC 1.875% 15/01/2027	USD	7.032.993,55	0,29
6.500.000	MARS INC 2.375% 16/07/2040	USD	5.379.998,46	0,22	4.223.000	NORFOLK SOUTHERN CORP 3.000% 15/03/2032	USD	4.120.853,23	0,17
1.215.000	MCDONALD'S CORP 4.200% 01/04/2050	USD	1.271.512,72	0,05	3.164.000	NORFOLK SOUTHERN CORP 3.950% 01/10/2042	USD	3.194.422,43	0,13
1.517.000	MCDONALD'S CORP 5.700% 01/02/2039	USD	1.826.008,12	0,07	8.810.000	NVIDIA CORP 1.550% 15/06/2028	USD	8.093.313,20	0,33
1.480.000	MERCK & CO INC 2.750% 10/12/2051	USD	1.289.921,91	0,05	9.491.000	NVIDIA CORP 2.000% 15/06/2031	USD	8.676.976,01	0,35
2.410.000	MERCK & CO INC 2.900% 10/12/2061	USD	2.063.003,69	0,08	3.500.000	NVIDIA CORP 3.500% 01/04/2040	USD	3.531.986,54	0,14
3.321.000	METROPOLITAN EDISON CO 4.000% 15/04/2025	USD	3.336.351,02	0,14	1.234.000	NVIDIA CORP 3.700% 01/04/2060	USD	1.246.405,50	0,05
49.000	MICROSOFT CORP 2.525% 01/06/2050	USD	42.489,59	0,00	3.081.000	OLD REPUBLIC INTERNATIONAL CORP 3.850% 11/06/2051	USD	2.864.397,38	0,12
2.207.000	MICROSOFT CORP 2.675% 01/06/2060	USD	1.906.548,18	0,08	2.268.000	ONEOK PARTNERS LP 6.125% 01/02/2041	USD	2.494.642,53	0,10
7.332.000	MICROSOFT CORP 2.921% 17/03/2052	USD	6.850.599,50	0,28	3.532.000	ORACLE CORP 2.300% 25/03/2028	USD	3.234.130,40	0,13
1.459.000	MICROSOFT CORP 3.450% 08/08/2036	USD	1.514.455,73	0,06	2.696.000	ORACLE CORP 2.800% 01/04/2027	USD	2.583.437,74	0,11
2.198.000	MID-AMERICA APARTMENTS LP 2.875% 15/09/2051	USD	1.851.889,12	0,08	2.320.000	ORACLE CORP 2.950% 15/05/2025	USD	2.289.235,92	0,09
5.805.000	MID-AMERICA APARTMENTS LP 4.200% 15/06/2028	USD	6.004.696,35	0,24	5.737.000	ORACLE CORP 3.250% 15/11/2027	USD	5.582.900,91	0,23
1.596.000	MID-AMERICA APARTMENTS LP 4.300% 15/10/2023	USD	1.622.929,05	0,07	3.712.000	ORACLE CORP 3.600% 01/04/2050	USD	3.076.389,75	0,13
3.018.000	MIDAMERICAN ENERGY CO 4.250% 01/05/2046	USD	3.246.664,90	0,13	3.500.000	ORACLE CORP 3.850% 01/04/2060	USD	2.869.942,78	0,12
6.652.000	MIDAMERICAN ENERGY CO 4.400% 15/10/2044	USD	7.184.785,22	0,29	928.000	ORACLE CORP 3.950% 25/03/2051	USD	812.220,97	0,03
1.077.000	MILEAGE PLUS HOLDINGS LLC 6.500% 20/06/2027	USD	1.121.305,83	0,05	3.208.000	ORACLE CORP 4.000% 15/11/2047	USD	2.837.194,53	0,12
1.752.000	MISSISSIPPI POWER CO 4.250% 15/03/2042	USD	1.745.469,12	0,07	6.662.000	ORACLE CORP 4.125% 15/05/2045	USD	5.991.661,77	0,24
714.000	MISSISSIPPI POWER CO 4.750% 15/10/2041	USD	716.584,99	0,03	2.983.000	ORACLE CORP 4.300% 08/07/2034	USD	2.942.293,74	0,12
3.763.000	MONDELEZ INTERNATIONAL INC 2.625% 17/03/2027	USD	3.676.143,79	0,15	2.346.000	OWL ROCK CAPITAL CORP 2.875% 11/06/2028	USD	2.052.788,73	0,08
2.700.000	MONONGAHELA POWER CO 3.550% 15/05/2027	USD	2.694.490,87	0,11	4.012.000	OWL ROCK CORE INCOME CORP 4.700% 08/02/2027	USD	3.860.352,98	0,16
1.745.000	MOODY'S CORP 3.100% 29/11/2061	USD	1.460.318,73	0,06	895.000	OWL ROCK TECHNOLOGY FINANCE CORP 6.750% 30/06/2025	USD	940.352,68	0,04
14.861.000	MORGAN STANLEY 01/04/2031 FRN	USD	14.817.839,94	0,61	5.724.000	PACIFICORP 4.100% 01/02/2042	USD	5.778.474,56	0,24
4.190.000	MORGAN STANLEY 04/05/2027 FRN	USD	3.895.158,16	0,16	4.007.000	PACIFICORP 4.150% 15/02/2050	USD	4.192.481,51	0,17
1.745.000	MORGAN STANLEY 05/04/2024 FRN	USD	1.709.276,43	0,07					

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.



# NN (L) US Credit

(ausgedrückt in USD)

## Wertpapierbestand zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW	Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW
3.422.000	PARAMOUNT GLOBAL 30/03/2062 FRN	USD	3.457.149,11	0,14	3.588.000	S&P GLOBAL INC 2.450% 01/03/2027	USD	3.492.842,11	0,14
876.000	PARAMOUNT GLOBAL 4.200% 15/09/2032	USD	877.074,21	0,04	1.883.000	S&P GLOBAL INC 2.700% 01/03/2029	USD	1.825.675,04	0,07
3.803.000	PARAMOUNT GLOBAL 4.375% 15/03/2043	USD	3.616.174,20	0,15	4.300.000	S&P GLOBAL INC 2.900% 01/03/2032	USD	4.172.858,85	0,17
1.167.000	PARAMOUNT GLOBAL 5.500% 15/05/2033	USD	1.286.206,68	0,05	792.000	S&P GLOBAL INC 3.900% 01/03/2062	USD	816.340,81	0,03
4.181.000	PARAMOUNT GLOBAL 5.850% 01/09/2043	USD	4.793.749,30	0,20	4.930.000	TARGA RESOURCES PARTNERS LP / TARGA RESOURCES PARTNERS FINANCE CORP 4.000% 15/01/2032	USD	4.731.871,88	0,19
8.239.000	PARTNERRE FINANCE B LLC 01/10/2050 FRN	USD	7.922.591,83	0,32	3.009.000	TEACHERS INSURANCE & ANNUITY ASSOCIATION OF AMERICA 3.300% 15/05/2050	USD	2.666.895,48	0,11
4.406.000	PAYPAL HOLDINGS INC 3.250% 01/06/2050	USD	4.047.761,71	0,17	3.680.000	TELEDYNE TECHNOLOGIES INC 1.600% 01/04/2026	USD	3.433.319,63	0,14
3.068.000	PECO ENERGY CO 2.850% 15/09/2051	USD	2.667.128,49	0,11	2.540.000	TIME WARNER ENTERTAINMENT CO LP 8.375% 15/07/2033	USD	3.313.559,84	0,14
2.701.000	PEPSICO INC 2.625% 21/10/2041	USD	2.439.406,69	0,10	7.612.000	T-MOBILE USA INC 2.250% 15/02/2026	USD	7.174.717,62	0,29
2.522.000	PEPSICO INC 2.750% 21/10/2051	USD	2.255.370,33	0,09	8.541.000	T-MOBILE USA INC 2.625% 15/04/2026	USD	8.170.848,52	0,33
5.571.000	PERKINELMER INC 3.300% 15/09/2029	USD	5.438.910,81	0,22	6.681.000	T-MOBILE USA INC 2.875% 15/02/2031	USD	6.025.256,58	0,25
1.765.000	PFIZER INC 3.900% 15/03/2039	USD	1.877.748,84	0,08	5.584.000	T-MOBILE USA INC 3.375% 15/04/2029	USD	5.322.025,08	0,22
4.394.000	PHILLIPS 66 2.150% 15/12/2030	USD	3.912.977,57	0,16	1.759.000	T-MOBILE USA INC 3.400% 15/10/2052	USD	1.502.552,66	0,06
1.639.000	PIEDMONT NATURAL GAS CO INC 3.350% 01/06/2050	USD	1.459.862,00	0,06	1.770.000	T-MOBILE USA INC 3.500% 15/04/2031	USD	1.668.018,09	0,07
1.605.000	PIEDMONT NATURAL GAS CO INC 3.600% 01/09/2025	USD	1.610.440,48	0,07	7.344.000	T-MOBILE USA INC 3.500% 15/04/2031	USD	6.914.926,29	0,28
4.635.000	PLAINS ALL AMERICAN PIPELINE LP / PAA FINANCE CORP 3.550% 15/12/2029	USD	4.481.067,15	0,18	4.915.000	TRANE TECHNOLOGIES CO LLC 6.480% 01/06/2025	USD	5.369.536,55	0,22
1.662.000	PLAINS ALL AMERICAN PIPELINE LP / PAA FINANCE CORP 4.300% 31/01/2043	USD	1.483.375,54	0,06	1.130.000	TRANE TECHNOLOGIES GLOBAL HOLDING CO LTD 3.750% 21/08/2028	USD	1.137.167,45	0,05
855.000	PLAINS ALL AMERICAN PIPELINE LP / PAA FINANCE CORP 4.500% 15/12/2026	USD	877.839,87	0,04	2.515.000	TRANSCONTINENTAL GAS PIPE LINE CO LLC 3.250% 15/05/2030	USD	2.454.603,81	0,10
985.000	PLAINS ALL AMERICAN PIPELINE LP / PAA FINANCE CORP 5.150% 01/06/2042	USD	960.548,41	0,04	6.937.000	TRUIST FINANCIAL CORP 15/03/2028 FRN	USD	6.530.634,29	0,27
1.705.000	PUBLIC SERVICE CO OF NEW HAMPSHIRE 3.600% 01/07/2049	USD	1.647.382,24	0,07	1.425.000	TUCSON ELECTRIC POWER CO 4.000% 15/06/2050	USD	1.422.754,37	0,06
3.293.000	PUBLIC SERVICE CO OF OKLAHOMA 2.200% 15/08/2031	USD	2.943.018,21	0,12	1.654.000	TWDC ENTERPRISES 18 CORP 3.151% 7/09/2025 GMTN	USD	1.663.775,17	0,07
2.900.000	PUBLIC SERVICE CO OF OKLAHOMA 3.150% 15/08/2051	USD	2.538.121,59	0,10	1.853.000	TWDC ENTERPRISES 18 CORP 4.125% 01/06/2044 GMTN	USD	1.951.260,74	0,08
1.280.000	PUBLIC SERVICE ELECTRIC & GAS CO 3.000% 15/05/2027	USD	1.271.844,24	0,05	2.435.000	UNILEVER CAPITAL CORP 2.625% 12/08/2051	USD	2.039.313,33	0,08
2.671.000	PUBLIC SERVICE ELECTRIC AND GAS CO 3.100% 15/03/2032	USD	2.645.415,53	0,11	3.171.000	UNION ELECTRIC CO 2.150% 15/03/2032	USD	2.886.181,57	0,12
10.000.000	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GROUP INC 2.450% 15/11/2031	USD	9.076.167,40	0,37	2.800.000	UNION PACIFIC CORP 2.800% 14/02/2032	USD	2.691.867,98	0,11
2.748.000	QUANTA SERVICES INC 0.950% 01/10/2024	USD	2.607.171,73	0,11	1.108.000	UNION PACIFIC CORP 3.375% 14/02/2042	USD	1.070.567,63	0,04
2.755.000	QUANTA SERVICES INC 2.350% 15/01/2032	USD	2.396.258,01	0,10	2.233.000	UNION PACIFIC CORP 3.550% 15/08/2039	USD	2.209.581,39	0,09
5.271.000	RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP 3.200% 15/03/2024	USD	5.329.615,42	0,22	743.000	UNION PACIFIC CORP 3.600% 15/09/2037	USD	745.020,17	0,03
28.000	RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP 3.650% 16/08/2023	USD	28.360,77	0,00	1.058.000	UNION PACIFIC CORP 3.799% 06/04/2071	USD	1.048.810,96	0,04
2.381.000	RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP 4.350% 15/04/2047	USD	2.558.781,63	0,10	2.966.000	UNION PACIFIC CORP 3.839% 20/03/2060	USD	2.998.867,82	0,12
2.569.000	RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP 4.500% 01/06/2042	USD	2.827.984,26	0,12	1.845.000	UNION PACIFIC CORP 3.850% 14/02/2072	USD	1.830.406,70	0,07
369.000	RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP 4.800% 15/12/2043	USD	412.412,69	0,02	1.191.000	UNION PACIFIC CORP 4.100% 15/09/2067	USD	1.240.078,94	0,05
3.304.000	REALTY INCOME CORP 3.950% 15/08/2027	USD	3.397.885,27	0,14	1.144.000	UNITED AIRLINES INC 4.375% 15/04/2026	USD	1.126.382,86	0,05
1.778.000	REALTY INCOME CORP 4.875% 01/06/2026	USD	1.875.975,50	0,08	763.000	UNITED AIRLINES INC 4.625% 15/04/2029	USD	726.375,14	0,03
1.791.000	REPUBLIC SERVICES INC 2.900% 01/07/2026	USD	1.770.158,13	0,07	857.918	UNITED AIRLINES 2012-1 CLASS A PASS THROUGH TRUST 4.150% 11/04/2024	USD	856.941,41	0,03
4.660.000	ROCHE HOLDINGS INC 2.076% 13/12/2031	USD	4.290.638,38	0,18	1.830.090	UNITED AIRLINES 2013-1 CLASS A PASS THROUGH TRUST 4.300% 15/08/2025	USD	1.837.832,38	0,07
2.352.000	ROCHE HOLDINGS INC 2.607% 13/12/2051	USD	2.033.250,70	0,08	2.860.400	UNITED AIRLINES 2014-2 CLASS A PASS THROUGH TRUST 3.750% 03/09/2026	USD	2.807.578,00	0,11
4.685.000	RPM INTERNATIONAL INC 2.950% 15/01/2032	USD	4.294.158,79	0,18	439.993	UNITED AIRLINES 2016-1 CLASS AA PASS THROUGH TRUST 3.100% 07/07/2028	USD	424.865,40	0,02
7.601.000	SABINE PASS LIQUEFACTION LLC 4.200% 15/03/2028	USD	7.820.657,57	0,32	883.178	UNITED AIRLINES 2016-2 CLASS A PASS THROUGH TRUST 3.100% 07/10/2028	USD	797.630,07	0,03
1.610.000	SABINE PASS LIQUEFACTION LLC 5.875% 30/06/2026	USD	1.741.979,98	0,07	406.104	UNITED AIRLINES 2016-2 CLASS AA PASS THROUGH TRUST 2.875% 07/10/2028	USD	382.244,69	0,02
3.141.000	SALESFORCE.COM INC 2.700% 15/07/2041	USD	2.783.870,53	0,11	763.015	UNITED AIRLINES 2018-1 CLASS A PASS THROUGH TRUST 3.700% 01/03/2030	USD	702.967,44	0,03
1.479.000	SALESFORCE.COM INC 2.900% 15/07/2051	USD	1.320.404,91	0,05	271.041	UNITED AIRLINES 2019-1 CLASS A PASS THROUGH TRUST 4.550% 25/08/2031	USD	270.220,71	0,01
8.275.000	SEMPRA ENERGY 01/04/2052 FRN	USD	7.706.129,50	0,31	5.608.329	UNITED AIRLINES 2020-1 CLASS A PASS THROUGH TRUST 5.875% 15/10/2027	USD	5.741.305,81	0,23
1.407.000	SEMPRA ENERGY 3.700% 01/04/2029	USD	1.416.894,39	0,06	1.188.864	UNITED AIRLINES 2020-1 CLASS B PASS THROUGH TRUST 4.875% 15/01/2026	USD	1.166.751,69	0,05
2.974.000	SONOCO PRODUCTS CO 2.850% 01/02/2032	USD	2.779.049,01	0,11	2.684.000	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 1.500% 29/02/2024	USD	2.645.102,96	0,11
11.814.000	SOUTH JERSEY INDUSTRIES INC 5.020% 15/04/2031	USD	11.600.155,97	0,47	2.197.000	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 1.750% 15/03/2025	USD	2.150.657,03	0,09
3.010.000	SOUTHERN CALIFORNIA EDISON CO 4.050% 15/03/2042	USD	2.907.299,19	0,12	4.751.500	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 1.875% 15/02/2032	USD	4.563.667,27	0,19
2.279.000	SOUTHERN CALIFORNIA EDISON CO 4.125% 01/03/2048	USD	2.229.620,02	0,09	21.869.700	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 1.875% 15/11/2051	USD	19.149.656,06	0,79
1.930.000	SOUTHERN CO GAS CAPITAL CORP 4.400% 30/05/2047	USD	1.943.867,61	0,08	2.571.400	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 1.875% 28/02/2027	USD	2.502.896,31	0,10
1.348.000	SOUTHERN CO GAS CAPITAL CORP 5.875% 15/03/2041	USD	1.591.833,71	0,06					
6.579.000	SOUTHERN CO/THE 15/01/2051 FRN	USD	6.358.304,02	0,26					

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) US Credit

(ausgedrückt in USD)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW	Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW
2.700.000	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 1.875% 28/02/2029	USD	2.606.765,63	0,11	5.996.000	COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC 0.500% 05/05/2023	USD	5.864.825,93	0,24
9.530.900	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 2.375% 15/02/2042	USD	9.197.318,50	0,38	4.834.000	COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC 0.800% 03/05/2024	USD	4.618.507,63	0,19
2.606.000	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 2.500% 31/03/2027	USD	2.612.107,81	0,11	4.134.000	COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC 1.500% 15/01/2027	USD	3.784.347,77	0,15
2.500.000	UNITEDHEALTH GROUP INC 1.150% 15/05/2026	USD	2.333.523,40	0,10	2.990.000	DIAGEO CAPITAL PLC 2.125% 24/10/2024	USD	2.940.353,41	0,12
3.995.000	UNITEDHEALTH GROUP INC 2.750% 15/05/2040	USD	3.584.218,76	0,15	4.983.000	DIAGEO CAPITAL PLC 3.500% 18/09/2023	USD	5.055.681,64	0,21
612.000	UNITEDHEALTH GROUP INC 2.900% 15/05/2050	USD	544.279,84	0,02	2.544.000	HSBC HOLDINGS PLC 10/03/2026 FRN	USD	2.495.843,02	0,10
2.042.000	UNITEDHEALTH GROUP INC 3.050% 15/05/2041	USD	1.903.743,94	0,08	15.243.000	HSBC HOLDINGS PLC 22/09/2028 FRN	USD	13.835.212,77	0,56
2.168.000	UNITEDHEALTH GROUP INC 3.250% 15/05/2051	USD	2.048.297,31	0,08	1.812.000	HSBC HOLDINGS PLC 22/11/2032 FRN	USD	1.649.607,35	0,07
1.690.000	UNITEDHEALTH GROUP INC 3.500% 15/08/2039	USD	1.679.611,33	0,07	3.936.000	LLOYDS BANKING GROUP PLC 05/02/2026 FRN	USD	3.800.837,21	0,16
1.959.000	UNITEDHEALTH GROUP INC 3.700% 15/08/2049	USD	1.993.862,70	0,08	1.360.000	LLOYDS BANKING GROUP PLC 09/07/2025 FRN	USD	1.372.668,82	0,06
932.000	UNITEDHEALTH GROUP INC 4.450% 15/12/2048	USD	1.050.330,81	0,04	6.473.000	LSEGA FINANCING PLC 1.375% 06/04/2026	USD	5.959.979,99	0,24
3.481.245	US AIRWAYS 2010-1 CLASS A PASS THROUGH TRUST 6.250% 22/04/2023	USD	3.485.733,42	0,14	2.499.000	LSEGA FINANCING PLC 3.200% 06/04/2041	USD	2.256.422,17	0,09
8.332.839	US AIRWAYS 2012-1 CLASS A PASS THROUGH TRUST 5.900% 01/10/2024	USD	8.525.496,49	0,35	3.637.000	NATWEST GROUP PLC 22/03/2025 FRN	USD	3.680.598,06	0,15
10.240.574	US AIRWAYS 2012-2 CLASS A PASS THROUGH TRUST 4.625% 03/06/2025	USD	9.871.449,68	0,40	5.511.000	NATWEST GROUP PLC 28/11/2035 FRN	USD	4.895.220,86	0,20
6.206.555	US AIRWAYS 2013-1 CLASS A PASS THROUGH TRUST 3.950% 15/11/2025	USD	5.888.877,92	0,24	7.647.000	ROYALTY PHARMA PLC 1.750% 02/09/2027	USD	6.941.744,64	0,28
3.475.000	VALERO ENERGY CORP 3.650% 01/12/2051	USD	3.078.891,67	0,13	4.003.000	ROYALTY PHARMA PLC 3.550% 02/09/2050	USD	3.329.790,43	0,14
8.000.000	VERIZON COMMUNICATIONS INC 2.355% 15/03/2032	USD	7.232.912,96	0,30	4.405.000	STANDARD CHARTERED PLC 30/03/2026 FRN	USD	4.403.658,50	0,18
1.901.000	VERIZON COMMUNICATIONS INC 2.650% 20/11/2040	USD	1.616.618,33	0,07	6.982.000	VODAFONE GROUP PLC 04/06/2081 FRN	USD	6.199.388,39	0,25
977.000	VERIZON COMMUNICATIONS INC 3.550% 22/03/2051	USD	921.504,17	0,04	2.026.000	VODAFONE GROUP PLC 5.125% 19/06/2059	USD	2.261.831,91	0,09
10.947.000	VERIZON COMMUNICATIONS INC 3.700% 22/03/2061	USD	10.269.114,47	0,42				<b>91.231.411,30</b>	<b>3,72</b>
14.471.000	VERIZON COMMUNICATIONS INC 4.500% 10/08/2033	USD	15.530.941,71	0,64		<b>Niederlande</b>			
5.648.000	VERIZON COMMUNICATIONS INC 4.812% 15/03/2039	USD	6.381.856,90	0,26	832.000	ABN AMRO BANK NV 13/03/2037 FRN	USD	755.006,70	0,03
1.829.000	VIATRIS INC 3.850% 22/06/2040	USD	1.585.549,99	0,06	3.005.000	COOPERATIEVE RABOBANK UA 06/04/2033 FRN	USD	3.001.356,17	0,12
5.938.000	VIRGINIA ELECTRIC & POWER CO 3.800% 01/04/2028	USD	6.081.315,95	0,25	10.673.000	COOPERATIEVE RABOBANK UA 24/09/2026 FRN	USD	9.824.276,74	0,39
1.870.000	VISA INC 4.150% 14/12/2035	USD	2.040.476,59	0,08	5.327.000	COOPERATIEVE RABOBANK UA 4.375% 04/08/2025	USD	5.416.868,03	0,22
4.368.000	VISA INC 4.300% 14/12/2045	USD	4.875.902,48	0,20	5.738.000	ING GROEP NV 28/03/2028 FRN	USD	5.782.485,85	0,24
7.593.000	VMWARE INC 1.400% 15/08/2026	USD	6.979.762,59	0,28	1.289.000	ING GROEP NV 28/03/2033 FRN	USD	1.328.142,61	0,05
1.458.000	VMWARE INC 1.800% 15/08/2028	USD	1.299.369,48	0,05	1.520.000	SHELL INTERNATIONAL FINANCE BV 2.875% 26/11/2041	USD	1.366.735,65	0,06
2.329.000	WALT DISNEY CO/THE 2.000% 01/09/2029	USD	2.156.207,97	0,09	3.295.000	SHELL INTERNATIONAL FINANCE BV 3.000% 26/11/2051	USD	2.942.135,72	0,12
778.000	WALT DISNEY CO/THE 4.625% 23/03/2040	USD	864.306,45	0,04	5.323.000	SHELL INTERNATIONAL FINANCE BV 4.000% 10/05/2046	USD	5.542.902,29	0,23
3.001.000	WALT DISNEY CO/THE 4.750% 15/11/2046	USD	3.443.017,68	0,14	1.601.000	SHELL INTERNATIONAL FINANCE BV 4.125% 11/05/2035	USD	1.692.532,34	0,07
2.111.000	WALT DISNEY CO/THE 6.550% 15/03/2033	USD	2.670.016,19	0,11	7.000.000	SIEMENS FINANCIERINGSMAATSCHAPPIJ NV 2.875% 11/03/2041	USD	6.318.661,23	0,26
1.645.000	WALT DISNEY CO/THE 8.500% 23/02/2025	USD	1.888.805,71	0,08				<b>43.971.103,33</b>	<b>1,79</b>
1.879.000	WASTE MANAGEMENT INC 2.950% 01/06/2041	USD	1.699.472,50	0,07		<b>Australien</b>			
2.652.000	WELLS FARGO & CO 04/04/2051 FRN	USD	3.141.214,44	0,13	10.309.000	AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP LTD/UNITED KINGDOM FRN PERP	USD	11.065.012,78	0,44
1.748.000	WELLS FARGO & CO 30/04/2041 FRN	USD	1.575.430,95	0,06	2.450.000	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA 2.688% 11/03/2031	USD	2.183.761,02	0,09
105.000	WESTERN DIGITAL CORP 2.850% 01/02/2029	USD	96.259,00	0,00	6.650.000	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA 3.784% 14/03/2032	USD	6.441.985,74	0,26
1.457.000	WEYERHAEUSER CO 4.000% 09/03/2052	USD	1.450.464,09	0,06	3.102.000	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD 12/01/2037 FRN	USD	2.852.692,04	0,12
3.785.000	WILLIAMS COS INC 3.500% 15/10/2051	USD	3.312.363,76	0,14	4.031.000	NBN CO LTD 1.450% 05/05/2026	USD	3.728.879,49	0,15
5.351.000	WILLIAMS COS INC/THE 3.750% 15/06/2027	USD	5.418.530,85	0,22	2.735.000	NBN CO LTD 2.500% 08/01/2032	USD	2.454.174,22	0,10
2.436.000	WILLIAMS COS INC/THE 4.550% 24/06/2024	USD	2.503.628,94	0,10	2.268.000	NEWCREST FINANCE PTY LTD 3.250% 13/05/2030	USD	2.171.883,52	0,09
3.507.000	WILLIAMS COS INC/THE 5.100% 15/09/2045	USD	3.781.800,91	0,15	2.139.000	NEWCREST FINANCE PTY LTD 4.200% 13/05/2050	USD	2.088.631,32	0,09
1.864.000	WISCONSIN POWER AND LIGHT CO 3.000% 01/07/2029	USD	1.818.173,19	0,07	1.886.000	RIO TINTO FINANCE USA LTD 2.750% 02/11/2051	USD	1.633.562,77	0,07
2.095.000	WORKDAY INC 3.800% 01/04/2032	USD	2.098.207,74	0,09	3.765.000	WESTPAC BANKING CORP 18/11/2036 FRN	USD	3.336.964,76	0,14
4.241.000	WRKCO INC 3.000% 15/06/2033	USD	3.962.011,96	0,16	2.721.000	WESTPAC BANKING CORP 3.133% 18/11/2041	USD	2.323.452,70	0,09
1.685.000	WRKCO INC 4.650% 15/03/2026	USD	1.756.957,32	0,07				<b>40.281.000,36</b>	<b>1,64</b>
2.992.000	WW GRAINGER INC 3.750% 15/05/2046	USD	2.981.349,53	0,12		<b>Schweiz</b>			
6.336.000	XYLEM INC/NY 3.250% 01/11/2026	USD	6.339.354,60	0,26	5.464.000	CREDIT SUISSE GROUP AG FRN PERP	USD	5.045.913,24	0,21
			<b>1.973.861.376,60</b>	<b>80,51</b>	5.927.000	CREDIT SUISSE GROUP AG FRN PERP	USD	5.134.344,48	0,21
	<b>Vereinigtes Königreich</b>				8.200.000	UBS AG 5.125% 15/05/2024	USD	8.381.081,09	0,34
2.220.000	ANGLO AMERICAN CAPITAL PLC 2.625% 10/09/2030	USD	2.015.399,72	0,08	14.259.000	UBS GROUP AG FRN PERP	USD	14.329.181,09	0,58
3.510.000	ANGLO AMERICAN CAPITAL PLC 5.625% 01/04/2030	USD	3.869.491,08	0,16					

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) US Credit

(ausgedrückt in USD)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW
5.347.000	UBS GROUP AG 11/02/2033 FRN	USD	4.870.395,37	0,20
			<b>37.760.915,27</b>	<b>1,54</b>
<b>Frankreich</b>				
6.356.000	BPCE SA 19/10/2027 FRN	USD	5.857.089,91	0,24
3.408.000	BPCE SA 19/10/2032 FRN	USD	3.074.456,96	0,13
5.989.000	CREDIT AGRICOLE SA FRN PERP	USD	5.425.725,39	0,22
2.024.000	ORANGE SA 9.000% 01/03/2031	USD	2.811.823,74	0,11
13.164.000	SOCIETE GENERALE SA 21/01/2033 FRN	USD	12.118.949,01	0,50
2.840.000	TOTAL CAPITAL INTERNATIONAL SA 2.829% 10/01/2030	USD	2.772.044,31	0,11
2.023.000	TOTALENERGIES CAPITAL INTERNATIONAL SA 2.986% 29/06/2041	USD	1.848.813,77	0,08
1.441.000	TOTALENERGIES CAPITAL INTERNATIONAL SA 3.386% 29/06/2060	USD	1.333.096,65	0,05
			<b>35.241.999,74</b>	<b>1,44</b>
<b>Kaimaninseln</b>				
2.082.000	AVOLON HOLDINGS FUNDING LTD 2.125% 21/02/2026	USD	1.894.840,90	0,08
1.647.000	AVOLON HOLDINGS FUNDING LTD 2.528% 18/11/2027	USD	1.465.232,34	0,06
2.659.000	AVOLON HOLDINGS FUNDING LTD 2.875% 15/02/2025	USD	2.554.070,89	0,10
5.370.000	AVOLON HOLDINGS FUNDING LTD 4.250% 15/04/2026	USD	5.324.447,58	0,22
9.539.000	XLIT LTD 4.450% 31/03/2025	USD	9.792.865,22	0,40
5.003.000	XLIT LTD 5.500% 31/03/2045	USD	5.914.560,16	0,24
			<b>26.946.017,09</b>	<b>1,10</b>
<b>Kanada</b>				
4.307.000	ALGONQUIN POWER & UTILITIES CORP 18/01/2082 FRN	USD	4.029.460,75	0,16
1.855.000	BANK OF NOVA SCOTIA/THE FRN PERP	USD	1.875.131,35	0,08
4.085.000	BANK OF NOVA SCOTIA/THE 27/10/2081 FRN	USD	3.521.625,56	0,14
4.530.000	CANADIAN IMPERIAL BANK 3.600% 07/04/2032	USD	4.513.107,86	0,19
2.610.000	CANADIAN PACIFIC RAILWAY CO 3.100% 02/12/2051	USD	2.320.954,22	0,09
3.737.000	NUTRIEN LTD 2.950% 13/05/2030	USD	3.600.807,99	0,15
2.801.000	NUTRIEN LTD 3.950% 13/05/2050	USD	2.808.813,89	0,11
2.126.000	TORONTO-DOMINION BANK 2.800% 10/03/2027	USD	2.093.155,13	0,09
			<b>24.763.056,75</b>	<b>1,01</b>
<b>Italien</b>				
12.476.000	INTESA SANPAOLO SPA 01/06/2032 FRN	USD	11.041.467,60	0,44
3.505.000	UNICREDIT SPA 03/06/2032 FRN	USD	3.086.722,27	0,13
3.265.000	UNICREDIT SPA 30/06/2035 FRN	USD	3.123.945,57	0,13
			<b>17.252.135,44</b>	<b>0,70</b>
<b>Supranational-Multinational</b>				
803.000	AMERICAN AIRLINES INC/AADVANTAGE LOYALTY IP LTD 5.500% 20/04/2026	USD	802.400,22	0,03
803.000	AMERICAN AIRLINES INC/AADVANTAGE LOYALTY IP LTD 5.750% 20/04/2029	USD	800.250,15	0,03
3.418.064	DELTA AIR LINES INC / SKYMILES IP LTD 4.500% 20/10/2025	USD	3.442.369,72	0,15
6.108.282	DELTA AIR LINES INC / SKYMILES IP LTD 4.750% 20/10/2028	USD	6.162.827,55	0,26
1.240.000	NXP BV / NXP FUNDING LLC / NXP USA INC 3.125% 15/02/2042	USD	1.070.841,85	0,04
2.875.000	NXP BV / NXP FUNDING LLC / NXP USA INC 3.250% 30/11/2051	USD	2.432.678,17	0,10
			<b>14.711.367,66</b>	<b>0,61</b>
<b>Japan</b>				
1.775.000	HONDA MOTOR CO LTD 2.534% 10/03/2027	USD	1.722.537,07	0,07
2.901.000	HONDA MOTOR CO LTD 2.967% 10/03/2032	USD	2.809.469,91	0,11
4.137.000	TAKEDA PHARMACEUTICAL CO LTD 3.025% 09/07/2040	USD	3.698.253,57	0,15

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW
2.165.000	TAKEDA PHARMACEUTICAL CO LTD 3.375% 09/07/2060	USD	1.892.831,64	0,08
3.971.000	TAKEDA PHARMACEUTICAL CO LTD 5.000% 26/11/2028	USD	4.312.402,32	0,18
			<b>14.435.494,51</b>	<b>0,59</b>
<b>Spanien</b>				
4.000.000	BANCO SANTANDER SA FRN PERP	USD	4.182.572,28	0,17
4.800.000	BANCO SANTANDER SA FRN PERP	USD	4.460.074,66	0,18
6.363.000	CELLNEX FINANCE CO SA 3.875% 07/07/2041	USD	5.116.588,77	0,21
			<b>13.759.235,71</b>	<b>0,56</b>
<b>Irland</b>				
4.596.000	AERCAP IRELAND CAPITAL DAC / AERCAP GLOBAL AVIATION TRUST 3.400% 29/10/2033	USD	4.136.162,20	0,17
5.452.000	GE CAPITAL INTERNATIONAL FUNDING CO UNLIMITED CO 4.418% 15/11/2035	USD	5.878.580,84	0,24
2.390.000	SMBC AVIATION CAPITAL FINANCE DAC 1.900% 15/10/2026	USD	2.140.957,32	0,09
			<b>12.155.700,36</b>	<b>0,50</b>
<b>Jungferninseln</b>				
6.663.000	TSMC GLOBAL LTD 1.250% 23/04/2026	USD	6.168.117,20	0,25
4.668.000	TSMC GLOBAL LTD 2.250% 23/04/2031	USD	4.245.721,28	0,17
			<b>10.413.838,48</b>	<b>0,42</b>
<b>Luxemburg</b>				
4.205.000	TRANE TECHNOLOGIES LUXEMBOURG FINANCE SA 3.500% 21/03/2026	USD	4.225.232,90	0,17
4.295.000	TRANE TECHNOLOGIES LUXEMBOURG FINANCE SA 3.550% 01/11/2024	USD	4.341.591,56	0,18
			<b>8.566.824,46</b>	<b>0,35</b>
<b>Bermuda</b>				
8.260.000	TRITON CONTAINER INTERNATIONAL LTD 0.800% 01/08/2023	USD	7.992.590,51	0,33
			<b>7.992.590,51</b>	<b>0,33</b>
<b>Dänemark</b>				
3.927.000	DANSKE BANK AS 4.375% 12/06/2028	USD	3.971.593,24	0,16
			<b>3.971.593,24</b>	<b>0,16</b>
<b>Deutschland</b>				
2.526.000	DEUTSCHE BANK AG/NEW YORK NY 07/01/2033 FRN	USD	2.231.439,86	0,09
			<b>2.231.439,86</b>	<b>0,09</b>
			<b>2.379.547.100,67</b>	<b>97,06</b>

**Wertpapierbestand Gesamt 2.385.786.973,89 97,31**

### Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022

Zu erhalten	Zu zahlen	Fälligkeits- datum	Engagement in USD	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in USD

### Devisentermingeschäfte

47.580.784,42	AUD	34.583.391,73	USD	19/04/2022	34.583.391,73	1.153.586,36
250.638.762,63	ZAR	16.243.797,82	USD	19/04/2022	16.243.797,82	875.939,82
8.367.323,03	SEK	879.550,29	USD	19/04/2022	879.550,29	18.523,51

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) US Credit

(ausgedrückt in USD)

### Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Zu erhalten	Zu zahlen	Fälligkeits- datum	Engagement in USD	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in USD
231.409,89 USD	207.272,95 EUR	04/04/2022	231.409,89	787,58
167.077,65 EUR	185.497,96 USD	01/04/2022	185.497,96	401,03
5.865,13 USD	85.235,05 ZAR	01/04/2022	5.865,13	32,11
34.100,07 AUD	25.586,99 USD	01/04/2022	25.586,99	20,45
1.461,69 USD	1.942,31 AUD	04/04/2022	1.461,69	3,11
103,58 USD	1.497,01 ZAR	04/04/2022	103,58	1,13
68,91 USD	52,22 GBP	19/04/2022	68,91	0,16
8.966,34 USD	11.949,55 AUD	01/04/2022	8.966,34	(7,17)
954,59 GBP	1.274,74 USD	19/04/2022	1.274,74	(18,01)
7.814,34 EUR	8.724,32 USD	04/04/2022	8.724,32	(29,69)
88.849,19 ZAR	6.113,83 USD	01/04/2022	6.113,83	(33,47)
23.246,61 AUD	17.494,24 USD	04/04/2022	17.494,24	(37,20)
48.297,27 USD	43.501,25 EUR	01/04/2022	48.297,27	(104,41)
262.797,74 ZAR	18.183,55 USD	04/04/2022	18.183,55	(199,10)
46.536,95 USD	447.585,61 SEK	19/04/2022	46.536,95	(1.502,90)
262.412,16 USD	243.991,10 CHF	19/04/2022	262.412,16	(2.854,95)
4.704.326,79 CHF	5.126.465,60 USD	19/04/2022	5.126.465,60	(11.921,70)
1.272.616,45 USD	19.253.464,24 ZAR	19/04/2022	1.272.616,45	(42.480,44)
2.539.025,44 USD	3.484.368,88 AUD	19/04/2022	2.539.025,44	(78.014,52)
143.353.709,09 USD	130.113.571,12 EUR	19/04/2022	143.353.709,09	(1.480.040,13)
1.094.042.896,06 EUR	1.220.667.845,17 USD	19/04/2022	1.220.667.845,17	(2.852.262,36)
			<b>1.425.534.399,14</b>	<b>(2.420.210,79)</b>

### Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick

		% NIW
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	<b>2.385.786.973,89</b>	<b>97,31</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	<b>(1.863.253,85)</b>	<b>(0,08)</b>
<b>Bankguthaben</b>	<b>42.737.840,06</b>	<b>1,74</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>	<b>24.956.435,32</b>	<b>1,03</b>
<b>Nettovermögen Gesamt</b>	<b>2.451.617.995,42</b>	<b>100,00</b>

Stückzahl	Bezeich- nung	Währung	Engagement in USD	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in USD
<b>Zins-Futures</b>				
(157)	US LONG BOND (CBT) 21/06/2022	USD	23.559.812,50	187.812,50
(21)	US ULTRA BOND (CBT) 21/06/2022	USD	3.719.625,00	16.500,00
145	US 10YR NOTE (CBT) 21/06/2022	USD	17.816.875,00	(488.296,88)
(809)	US 10YR ULTRA FUTURE 21/06/2022	USD	109.594.218,75	3.402.023,66
764	US 2YR NOTE (CBT) 30/06/2022	USD	161.908.313,26	(2.072.590,81)
278	US 5YR NOTE (CBT) 30/06/2022	USD	31.883.125,00	(488.491,53)
			<b>348.481.969,51</b>	<b>556.956,94</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>				<b>(1.863.253,85)</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) US Enhanced Core Concentrated Equity

(ausgedrückt in USD)

### Statistische Angaben

<b>Nettovermögen</b>	31.03.2022	USD	376.020.001,15	<b>Anzahl der Anteile</b>		
	30.09.2021	USD	389.125.911,31			
	30.09.2020	USD	508.797.428,20			
<b>Nettoinventarwert pro Anteil**</b>				Capitalisation I (USD)	31.03.2022	847.196
					30.09.2021	876.633
					30.09.2020	942.088
Capitalisation I (EUR)	31.03.2022	EUR	20.706,27	Capitalisation I Hedged (i) (CZK)	31.03.2022	3.768
	30.09.2021	EUR	19.163,50		30.09.2021	3.908
	30.09.2020	EUR	14.628,78		30.09.2020	4.545
Capitalisation I (USD)	31.03.2022	USD	251,40	Capitalisation I Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	55
	30.09.2021	USD	242,35		30.09.2021	1.708
	30.09.2020	USD	187,20		30.09.2020	1.912
Capitalisation I Hedged (i) (CZK)	31.03.2022	CZK	232.979,50	Capitalisation P (EUR)	31.03.2022	22
	30.09.2021	CZK	222.983,68		30.09.2021	9
	30.09.2020	CZK	173.847,89		30.09.2020	10
Capitalisation I Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	EUR	8.509,37	Capitalisation P (USD)	31.03.2022	267.968
	30.09.2021	EUR	8.275,40		30.09.2021	282.478
	30.09.2020	EUR	6.471,61		30.09.2020	319.092
Capitalisation P (EUR)	31.03.2022	EUR	871,90	Capitalisation R (USD)	31.03.2022	1.711
	30.09.2021	EUR	810,51		30.09.2021	1.915
	30.09.2020	EUR	624,14		30.09.2020	1.915
Capitalisation P (USD)	31.03.2022	USD	213,96	Capitalisation V (EUR)	31.03.2022	3.249
	30.09.2021	USD	207,20		30.09.2021	4.448
	30.09.2020	USD	161,50		30.09.2020	8.569
Capitalisation R (USD)	31.03.2022	USD	388,14	Capitalisation X (USD)	31.03.2022	37.966
	30.09.2021	USD	374,65		30.09.2021	33.706
	30.09.2020	USD	290,14		30.09.2020	28.675
Capitalisation V (EUR)	31.03.2022	EUR	484,23	Capitalisation X Hedged (i) (CZK)	31.03.2022	10.418
	30.09.2021	EUR	449,98		30.09.2021	9.747
	30.09.2020	EUR	346,33		30.09.2020	5.853
Capitalisation X (USD)	31.03.2022	USD	192,14	Distribution P (USD)	31.03.2022	8.975
	30.09.2021	USD	186,53		30.09.2021	8.449
	30.09.2020	USD	146,13		30.09.2020	11.898
Capitalisation X Hedged (i) (CZK)	31.03.2022	CZK	24.322,94			
	30.09.2021	CZK	23.563,75			
	30.09.2020	CZK	18.618,47			
Distribution P (USD)	31.03.2022	USD	176,07	<b>Laufende Kosten in %*</b>		
	30.09.2021	USD	170,50	Capitalisation I (EUR)	31.03.2022	0,69%
	30.09.2020	USD	132,90	Capitalisation I (USD)	31.03.2022	0,69%
<b>Anzahl der Anteile</b>				Capitalisation I Hedged (i) (CZK)	31.03.2022	0,71%
	31.03.2022		1.838	Capitalisation I Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	0,71%
	30.09.2021		1.829	Capitalisation P (EUR)	31.03.2022	1,60%
			12.688			

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

## NN (L) US Enhanced Core Concentrated Equity

(ausgedrückt in USD)

### Statistische Angaben (Fortsetzung)

Capitalisation P (USD)	31.03.2022	1,60%
Capitalisation R (USD)	31.03.2022	0,95%
Capitalisation V (EUR)	31.03.2022	1,51%
Capitalisation X (USD)	31.03.2022	2,10%
Capitalisation X Hedged (i) (CZK)	31.03.2022	2,12%
Distribution P (USD)	31.03.2022	1,60%
<b>Portfolioumsatz in %*</b>	31.03.2022	108,74%

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

## NN (L) US Enhanced Core Concentrated Equity

(ausgedrückt in USD)

### Finanzabschlüsse

#### Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022

	Erläuterungen	
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	2	<b>366.391.528,15</b>
Aktien		366.391.528,15
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	2	<b>1.878.314,97</b>
Devisentermingeschäfte		1.649.328,86
Futures		228.986,11
<b>Bankguthaben</b>		<b>9.069.253,99</b>
<b>Hinterlegte Sicherheiten</b>		<b>184.492,46</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte</b>	4	<b>2.788.318,71</b>
<b>Vermögenswerte Gesamt</b>		<b>380.311.908,28</b>
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>	4, 12	<b>(4.291.907,13)</b>
<b>Verbindlichkeiten Gesamt</b>		<b>(4.291.907,13)</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Berichtszeitraums</b>		<b>376.020.001,15</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) US Enhanced Core Concentrated Equity

(ausgedrückt in USD)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW	Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW
<b>Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>									
<b>Aktien</b>									
<b>Vereinigte Staaten</b>									
2.316	ACUITY BRANDS INC	USD	438.418,80	0,12	22.153	LENNAR CORP - A	USD	1.798.159,01	0,48
11.115	ADOBE INC	USD	5.064.216,30	1,35	56.847	LOEWS CORP	USD	3.684.822,54	0,98
9.123	ADVANCED MICRO DEVICES INC	USD	997.508,82	0,27	7.835	LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	USD	1.431.297,80	0,38
29.455	AGILENT TECHNOLOGIES INC	USD	3.897.780,15	1,04	25.341	MARATHON PETROLEUM CORP	USD	2.166.655,50	0,58
3.032	ALIGN TECHNOLOGY INC	USD	1.321.952,00	0,35	2.637	MCKESSON CORP	USD	807.264,81	0,21
6.494	ALPHABET INC - A	USD	18.062.086,90	4,80	67.855	MERCK & CO INC	USD	5.567.502,75	1,48
3.071	AMAZON.COM INC	USD	10.011.306,45	2,66	4.031	META PLATFORMS INC - A	USD	896.333,16	0,24
1.424	AMERIPRISE FINANCIAL INC	USD	427.712,64	0,11	84.315	MICROSOFT CORP	USD	25.995.157,65	6,91
28.441	AMETEK INC	USD	3.787.772,38	1,01	32.794	MINERALS TECHNOLOGIES INC	USD	2.169.323,10	0,58
9.728	ANTHEM INC	USD	4.778.588,16	1,27	3.670	MOLINA HEALTHCARE INC	USD	1.224.275,30	0,33
125.739	APPLE INC	USD	21.955.286,79	5,84	61.039	MONDELEZ INTERNATIONAL INC - A	USD	3.832.028,42	1,02
29.069	APPLIED MATERIALS INC	USD	3.831.294,20	1,02	6.416	MSCI INC - A	USD	3.226.478,08	0,86
21.467	AUTONATION INC	USD	2.137.683,86	0,57	52.340	NATIONAL FUEL GAS CO	USD	3.595.758,00	0,96
78.122	AVNET INC	USD	3.170.971,98	0,84	35.587	NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	USD	1.599.279,78	0,43
69.539	BAKER HUGHES CO - A	USD	2.531.914,99	0,67	167.499	NEW YORK COMMUNITY Bancorp INC	USD	1.795.589,28	0,48
77.706	BANK OF AMERICA CORP	USD	3.203.041,32	0,85	41.096	NIKE INC - B	USD	5.529.877,76	1,47
27.030	BELLRING BRANDS INC	USD	623.852,40	0,17	33.130	NVIDIA CORP	USD	9.039.851,80	2,40
7.330	BERKSHIRE HATHAWAY INC - B	USD	2.586.830,30	0,69	7.886	OLD DOMINION FREIGHT LINE INC	USD	2.355.390,48	0,63
8.317	BOYD GAMING CORP	USD	547.092,26	0,15	21.417	OLD REPUBLIC INTERNATIONAL CORP	USD	554.057,79	0,15
69.903	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	USD	5.105.016,09	1,36	5.436	O'REILLY AUTOMOTIVE INC	USD	3.723.442,56	0,99
16.229	CBRE GROUP INC - A	USD	1.485.278,08	0,39	5.328	PALO ALTO NETWORKS INC	USD	3.316.733,28	0,88
2.382	CHARTER COMMUNICATIONS INC - A	USD	1.299.428,64	0,35	34.238	PARAMOUNT GLOBAL - B	USD	1.294.538,78	0,34
37.644	CHEVRON CORP	USD	6.129.572,52	1,63	35.040	PEPSICO INC	USD	5.864.995,20	1,56
106.870	CISCO SYSTEMS INC/DELAWARE	USD	5.959.071,20	1,58	29.835	PROLOGIS INC	USD	4.817.755,80	1,28
60.159	CITIGROUP INC	USD	3.212.490,60	0,85	68.055	PURE STORAGE INC - A	USD	2.403.022,05	0,64
71.806	COCA-COLA CO	USD	4.451.972,00	1,18	8.804	ROPER TECHNOLOGIES INC	USD	4.157.512,92	1,11
118.852	COMCAST CORP - A	USD	5.564.650,64	1,48	4.028	SBA COMMUNICATIONS CORP - A	USD	1.386.034,80	0,37
47.622	CONOCOPHILLIPS	USD	4.762.200,00	1,27	3.037	SERVICENOW INC	USD	1.691.274,93	0,45
18.494	CORTEVA INC	USD	1.063.035,12	0,28	12.395	S&P GLOBAL INC	USD	5.084.181,10	1,35
28.394	COSTAR GROUP INC	USD	1.891.324,34	0,50	27.428	STARWOOD PROPERTY TRUST INC	USD	662.934,76	0,18
54.487	CSX CORP	USD	2.040.538,15	0,54	26.955	T ROWE PRICE GROUP INC	USD	4.075.326,45	1,08
74.470	DANA INC	USD	1.308.437,90	0,35	19.304	TD SYNNEX CORP	USD	1.992.365,84	0,53
110.737	DROPBOX INC - A	USD	2.574.635,25	0,68	3.745	TESLA INC	USD	4.035.612,00	1,07
13.455	EDWARDS LIFESCIENCES CORP	USD	1.583.922,60	0,42	10.335	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	USD	6.104.367,75	1,62
9.372	EMCOR GROUP INC	USD	1.055.568,36	0,28	106.057	TRI POINTE HOMES INC	USD	2.129.624,56	0,57
27.410	EMERSON ELECTRIC CO	USD	2.687.550,50	0,71	96.348	UGI CORP	USD	3.489.724,56	0,93
32.670	ENERGY CORP	USD	3.814.222,50	1,01	15.999	UNITEDHEALTH GROUP INC	USD	8.159.010,03	2,17
5.111	EPAM SYSTEMS INC	USD	1.515.973,71	0,40	9.790	VALERO ENERGY CORP	USD	994.076,60	0,26
5.288	ESTEE LAUDER COS INC/THE - A	USD	1.440.028,16	0,38	34.178	VISA INC - A	USD	7.579.655,06	2,02
197.998	FORD MOTOR CO	USD	3.348.146,18	0,90	27.362	VMWARE INC - A	USD	3.115.710,94	0,83
62.953	FORTIVE CORP	USD	3.835.726,29	1,02	23.624	WALMART INC	USD	3.518.086,08	0,94
53.434	HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP INC/THE	USD	3.837.095,54	1,02	105.328	WELLS FARGO & CO	USD	5.104.194,88	1,36
28.820	HOLOGIC INC	USD	2.213.952,40	0,59	5.839	ZOETIS INC - A	USD	1.101.177,01	0,29
25.049	INCYTE CORP	USD	1.989.391,58	0,53	<b>352.939.399,61 93,86</b>				
44.137	INGEVITY CORP	USD	2.827.857,59	0,75	<b>Irland</b>				
8.007	INTUIT INC	USD	3.850.085,88	1,02	27.837	ALLEGION PLC	USD	3.055.945,86	0,81
60.468	IRIDIUM COMMUNICATIONS INC	USD	2.438.069,76	0,65	62.713	JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	USD	4.112.091,41	1,10
73.354	IRON MOUNTAIN INC	USD	4.064.545,14	1,08	23.699	MEDTRONIC PLC	USD	2.629.404,05	0,70
45.044	JOHNSON & JOHNSON	USD	7.983.148,12	2,12	<b>9.797.441,32 2,61</b>				
2.604	JPMORGAN CHASE & CO	USD	354.977,28	0,09	<b>Bermuda</b>				
26.599	KEYCORP	USD	595.285,62	0,16	74.146	GENPACT LTD	USD	3.226.092,46	0,86
5.492	KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	USD	867.571,24	0,23	<b>3.226.092,46 0,86</b>				
6.218	LAM RESEARCH CORP	USD	3.342.858,98	0,89	<b>Luxemburg</b>				
					2.838	SPOTIFY TECHNOLOGY SA	USD	428.594,76	0,11
								<b>428.594,76</b>	<b>0,11</b>
								<b>366.391.528,15</b>	<b>97,44</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.



## NN (L) US Enhanced Core Concentrated Equity

(ausgedrückt in USD)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>			<b>366.391.528,15</b>	<b>97,44</b>

### Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022

Zu erhalten	Zu zahlen	Fälligkeits- datum	Engagement in USD	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in USD	
<b>Devisentermingeschäfte</b>					
1.213.937.418,98	CZK	53.402.660,10	USD 19/04/2022	53.402.660,10	1.798.705,17
72.782,67	USD	66.290,89	EUR 19/04/2022	72.782,67	(1.007,93)
522.733,56	EUR	583.203,36	USD 19/04/2022	583.203,36	(1.331,23)
3.271.778,46	USD	75.183.434,08	CZK 19/04/2022	3.271.778,46	(147.037,15)
			<b>57.330.424,59</b>	<b>1.649.328,86</b>	

Stückzahl	Bezeichnung	Währung	Engagement in USD	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in USD	
<b>Future auf Aktienindizes</b>					
38	S&P500 EMINI FUTURE	17/06/2022	USD	8.608.425,00	228.986,11
			<b>8.608.425,00</b>	<b>228.986,11</b>	

**Derivative Finanzinstrumente Gesamt 1.878.314,97**

### Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick

		% NIW
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	<b>366.391.528,15</b>	<b>97,44</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	<b>1.878.314,97</b>	<b>0,50</b>
<b>Bankguthaben</b>	<b>9.069.253,99</b>	<b>2,41</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>	<b>(1.319.095,96)</b>	<b>(0,35)</b>
<b>Nettovermögen Gesamt</b>	<b>376.020.001,15</b>	<b>100,00</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) US Factor Credit

(ausgedrückt in USD)

### Statistische Angaben

				Laufende Kosten in %*		
<b>Nettovermögen</b>	31.03.2022	USD	33.166.608,27	Capitalisation I (USD)	31.03.2022	0,49%
	30.09.2021	USD	39.885.314,01	Capitalisation N (EUR)	31.03.2022	0,56%
	30.09.2020	USD	46.251.284,79	Capitalisation P (USD)	31.03.2022	0,85%
<b>Nettoinventarwert pro Anteil**</b>				Capitalisation X (USD)	31.03.2022	0,95%
	31.03.2022	USD	27.600,38	Distribution P (USD)	31.03.2022	0,85%
	30.09.2021	USD	29.710,12			
Capitalisation I (USD)	30.09.2020	USD	28.977,93	<b>Portfolioumsatz in %*</b>	31.03.2022	0,15%
Capitalisation N (EUR)	31.03.2022	EUR	12,55			
	30.09.2021	EUR	12,97			
	30.09.2020	EUR	12,51			
Capitalisation P (USD)	31.03.2022	USD	1.317,15			
	30.09.2021	USD	1.420,36			
	30.09.2020	USD	1.390,35			
Capitalisation X (USD)	31.03.2022	USD	1.292,77			
	30.09.2021	USD	1.394,78			
	30.09.2020	USD	1.366,64			
Distribution P (USD)	31.03.2022	USD	356,07			
	30.09.2021	USD	387,11			
	30.09.2020	USD	386,38			
<b>Anzahl der Anteile</b>						
Capitalisation I (USD)	31.03.2022		76			
	30.09.2021		81			
	30.09.2020		86			
Capitalisation N (EUR)	31.03.2022		355.804			
	30.09.2021		414.329			
	30.09.2020		552.043			
Capitalisation P (USD)	31.03.2022		12.992			
	30.09.2021		14.865			
	30.09.2020		16.172			
Capitalisation X (USD)	31.03.2022		3.736			
	30.09.2021		3.887			
	30.09.2020		5.689			
Distribution P (USD)	31.03.2022		11.657			
	30.09.2021		12.153			
	30.09.2020		13.953			
<b>Dividende</b>						
Distribution P (USD)	14.12.2021	USD	3,15			

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

## NN (L) US Factor Credit

(ausgedrückt in USD)

### Finanzabschlüsse

#### Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022

	Erläuterungen	
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	2	<b>32.293.428,43</b>
Anleihen und andere Schuldtitel		32.293.428,43
<b>Bankguthaben</b>		<b>49.077,63</b>
<b>Hinterlegte Sicherheiten</b>		<b>851.781,28</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte</b>	4	<b>360.403,42</b>
<b>Vermögenswerte Gesamt</b>		<b>33.554.690,76</b>
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>	4	<b>(47.088,29)</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	2	<b>(340.994,20)</b>
Credit Default Swaps		(45.712,95)
Futures		(295.281,25)
<b>Verbindlichkeiten Gesamt</b>		<b>(388.082,49)</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Berichtszeitraums</b>		<b>33.166.608,27</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) US Factor Credit

(ausgedrückt in USD)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW	Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW
<b>Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>									
<b>Anleihen und andere Schuldtitel</b>									
<b>Vereinigte Staaten</b>									
200.000	ABB FINANCE USA INC 2.875% 08/05/2022	USD	200.352,91	0,60	230.000	FS KKR CAPITAL CORP 4.750% 15/05/2022	USD	230.153,12	0,69
200.000	ADVANCED MICRO DEVICES INC 2.950% 01/06/2024	USD	200.377,43	0,60	200.000	GENERAL MOTORS CO 6.250% 02/10/2043	USD	228.236,77	0,69
200.000	ALLY FINANCIAL INC 8.000% 01/11/2031	USD	249.184,15	0,75	200.000	GLP CAPITAL LP / GLP FINANCING II INC 5.375% 15/04/2026	USD	208.807,17	0,63
143.157	AMERICAN AIRLINES 2015-2 CLASS AA PASS THROUGH TRUST 3.600% 22/09/2027	USD	137.986,61	0,42	200.000	GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE 21/07/2032 FRN	USD	177.725,22	0,54
200.000	AMERICAN HONDA FINANCE CORP 2.900% 16/02/2024	USD	200.656,85	0,60	200.000	GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE 24/07/2023 FRN	USD	200.271,94	0,60
150.000	ANHEUSER-BUSCH INBEV WORLDWIDE INC 8.000% 15/11/2039	USD	218.862,38	0,66	250.000	GOLUB CAPITAL BDC INC 3.375% 15/04/2024	USD	247.688,11	0,75
250.000	ANTARES HOLDINGS LP 6.000% 15/08/2023	USD	256.293,62	0,77	200.000	HALLIBURTON CO 7.450% 15/09/2039	USD	268.763,29	0,81
230.000	APPALACHIAN POWER CO 3.400% 01/06/2025	USD	232.269,74	0,70	200.000	HCA INC 5.000% 15/03/2024	USD	207.316,45	0,63
170.000	APPALACHIAN POWER CO 7.000% 01/04/2038	USD	218.897,40	0,66	240.000	HESS CORP 4.300% 01/04/2027	USD	246.544,41	0,74
200.000	APPLE INC 2.400% 13/01/2023	USD	201.421,25	0,61	200.000	HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO 6.350% 15/10/2045	USD	234.375,94	0,71
200.000	APPLE INC 3.350% 09/02/2027	USD	204.271,61	0,62	212.000	HOLLYFRONTIER CORP 5.875% 01/04/2026	USD	221.968,00	0,67
200.000	APPLE INC 4.650% 23/02/2046	USD	235.776,77	0,71	210.000	JABIL INC 4.700% 15/09/2022	USD	212.333,27	0,64
240.000	ARES CAPITAL CORP 4.250% 01/03/2025	USD	239.817,20	0,72	15.000	JEFFERIES FINANCIAL GROUP INC 6.625% 23/10/2043	USD	17.618,80	0,05
63.000	ARIZONA PUBLIC SERVICE CO 2.550% 15/09/2026	USD	60.787,47	0,18	200.000	JEFFERIES GROUP LLC 6.250% 15/01/2036	USD	234.490,66	0,71
66.000	ARROW ELECTRONICS INC 3.875% 12/01/2028	USD	66.633,04	0,20	400.000	JOHN DEERE CAPITAL CORP 3.050% 06/01/2028	USD	400.488,37	1,21
243.000	AUTONATION INC 4.500% 01/10/2025	USD	249.310,83	0,75	230.000	JPMORGAN CHASE & CO 23/04/2029 FRN	USD	234.835,16	0,71
63.000	AVNET INC 4.625% 15/04/2026	USD	64.896,95	0,20	200.000	JPMORGAN CHASE & CO 24/03/2031 FRN	USD	212.269,60	0,64
170.000	BANK OF AMERICA CORP 05/03/2024 FRN	USD	171.156,32	0,52	200.000	JPMORGAN CHASE & CO 5.500% 15/10/2040	USD	240.186,27	0,72
400.000	BANK OF AMERICA CORP 23/07/2024 FRN	USD	404.766,21	1,23	200.000	JPMORGAN CHASE & CO 6.400% 15/05/2038	USD	261.356,94	0,79
250.000	BLACKSTONE SECURED LENDING FUND 3.650% 14/07/2023	USD	251.418,17	0,76	230.000	KITE REALTY GROUP TRUST 4.000% 15/03/2025	USD	231.274,90	0,70
153.000	BLOCK FINANCIAL LLC 5.250% 01/10/2025	USD	160.687,67	0,48	233.000	KKR GROUP FINANCE CO III LLC 5.125% 01/06/2044	USD	259.272,62	0,78
213.000	BLUE CROSS AND BLUE SHIELD OF MINNESOTA 3.790% 01/05/2025	USD	211.054,42	0,64	200.000	MAIN STREET CAPITAL CORP 5.200% 01/05/2024	USD	204.079,87	0,62
280.000	BNSF FUNDING TRUST I 15/12/2055 FRN	USD	296.818,99	0,89	200.000	MARATHON PETROLEUM CORP 6.500% 01/03/2041	USD	246.278,22	0,74
93.000	BOARDWALK PIPELINES LP 5.950% 01/06/2026	USD	100.447,36	0,30	200.000	MARVELL TECHNOLOGY INC 4.200% 22/06/2023	USD	203.275,20	0,61
272.000	BROADCOM INC 3.137% 15/11/2035	USD	239.805,90	0,72	240.000	MERCURY GENERAL CORP 4.400% 15/03/2027	USD	246.606,99	0,74
200.000	BROADCOM INC 3.187% 15/11/2036	USD	175.745,52	0,53	150.000	METLIFE INC 10.750% 01/08/2039	USD	217.938,17	0,66
33.000	BROADCOM INC 3.469% 15/04/2034	USD	30.563,37	0,09	600.000	MORGAN STANLEY 24/01/2029 FRN GMTN	USD	604.755,37	1,83
243.000	CABOT CORP 3.400% 15/09/2026	USD	242.856,41	0,73	200.000	MORGAN STANLEY 3.125% 23/01/2023 GMTN	USD	201.793,59	0,61
230.000	CADENCE DESIGN SYSTEMS INC 4.375% 15/10/2024	USD	236.085,46	0,71	200.000	NATIONAL FUEL GAS CO 5.500% 15/01/2026	USD	210.989,15	0,64
200.000	CENTERPOINT ENERGY RESOURCES CORP 0.700% 02/03/2023	USD	197.166,45	0,59	250.000	NSTAR ELECTRIC CO 2.375% 15/10/2022	USD	250.625,70	0,76
200.000	CHARTER COMMUNICATIONS OPERATING LLC / CHARTER COMMUNICATIONS OPERATING CAPITAL 5.050% 30/03/2029	USD	211.797,01	0,64	63.000	OCHSNER CLINIC FOUNDATION 5.897% 15/05/2045	USD	79.158,79	0,24
115.000	CINCINNATI FINANCIAL CORP 6.920% 15/05/2028	USD	136.911,20	0,41	230.000	OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST 4.000% 15/07/2022	USD	230.440,15	0,69
200.000	CISCO SYSTEMS INC 5.900% 15/02/2039	USD	261.527,00	0,79	236.000	OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST 4.250% 15/05/2024	USD	236.711,23	0,71
200.000	CITADEL LP 5.375% 17/01/2023	USD	202.082,52	0,61	240.000	OMEGA HEALTHCARE INVESTORS INC 4.750% 15/01/2028	USD	243.322,22	0,73
500.000	CITIGROUP INC 24/07/2023 FRN	USD	500.730,79	1,52	200.000	ONEOK PARTNERS LP 6.850% 15/10/2037	USD	232.663,06	0,70
230.000	COMMONSPIRIT HEALTH 4.200% 01/08/2023	USD	233.632,62	0,70	400.000	ORACLE CORP 6.125% 08/07/2039	USD	457.707,07	1,38
150.000	CONOCOPHILLIPS CO 4.025% 15/03/2062	USD	152.214,98	0,46	200.000	OWL ROCK CAPITAL CORP 5.250% 15/04/2024	USD	204.582,37	0,62
191.000	CONSTELLATION ENERGY GENERATION LLC 6.250% 01/10/2039	USD	216.345,79	0,65	200.000	PARAMOUNT GLOBAL 6.875% 30/04/2036	USD	243.984,45	0,74
150.298	CONTINENTAL AIRLINES 2012-2 CLASS A PASS THROUGH TRUST 4.000% 29/10/2024	USD	150.050,96	0,45	160.000	PROVIDENCE ST JOSEPH HEALTH OBLIGATED GROUP 3.744% 01/10/2047	USD	154.450,10	0,47
230.000	DELL INTERNATIONAL LLC / EMC CORP 6.020% 15/06/2026	USD	249.555,00	0,75	400.000	PRUDENTIAL FINANCIAL INC 15/09/2042 FRN	USD	402.000,53	1,21
200.000	DEVON ENERGY CORP 7.875% 30/09/2031	USD	259.686,11	0,78	220.000	RELIANCE STEEL & ALUMINUM CO 4.500% 15/04/2023	USD	223.416,89	0,67
200.000	DIAGEO INVESTMENT CORP 8.000% 15/09/2022	USD	205.828,21	0,62	240.000	SABRA HEALTH CARE LP 5.125% 15/08/2026	USD	245.607,08	0,74
250.000	DISCOVER BANK 09/08/2028 FRN	USD	253.412,31	0,76	350.000	SAMMONS FINANCIAL GROUP INC 4.450% 12/05/2027	USD	359.848,35	1,08
200.000	EDG RESOURCES INC 2.625% 15/03/2023	USD	200.550,58	0,60	203.000	SANTANDER HOLDINGS USA INC 4.500% 17/07/2025	USD	207.630,58	0,63
250.000	EXPEDIA GROUP INC 3.600% 15/12/2023	USD	251.652,11	0,76	400.000	SIMON PROPERTY GROUP LP 2.200% 01/02/2031	USD	360.665,58	1,09
180.000	FLORIDA POWER & LIGHT CO 5.690% 01/03/2040	USD	225.662,40	0,68	200.000	SIXTH STREET SPECIALTY LENDING INC 3.875% 01/11/2024	USD	199.610,01	0,60
170.000	FLORIDA POWER & LIGHT CO 5.950% 01/02/2038	USD	214.216,18	0,65	200.000	SL GREEN REALTY CORP 4.500% 01/12/2022	USD	201.250,44	0,61
					250.000	SOUTHERN CO/THE 15/03/2057 FRN	USD	248.664,06	0,75
					240.000	TANGER PROPERTIES LP 3.875% 15/07/2027	USD	239.256,41	0,72
					56.000	TAPESTRY INC 4.125% 15/07/2027	USD	56.826,28	0,17
					50.000	TIME WARNER CABLE LLC 7.300% 01/07/2038	USD	60.783,01	0,18
					230.000	TIMKEN CO/THE 3.875% 01/09/2024	USD	231.308,25	0,70
					200.000	TOYOTA MOTOR CREDIT CORP 2.625% 10/01/2023	USD	200.942,81	0,61

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) US Factor Credit

(ausgedrückt in USD)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW
200.000	TOYOTA MOTOR CREDIT CORP 3.450% 20/09/2023 GMTN	USD	202.643,72	0,61
200.000	TRUIST BANK 02/08/2024 FRN	USD	202.744,83	0,61
200.000	VALERO ENERGY CORP 6.625% 15/06/2037	USD	247.953,50	0,75
200.000	VERISK ANALYTICS INC 4.125% 12/09/2022	USD	201.578,87	0,61
200.000	VOYA FINANCIAL INC 15/05/2053 FRN	USD	201.059,10	0,61
250.000	WABTEC CORP 3.450% 15/11/2026	USD	246.275,62	0,74
40.000	WHIRLPOOL CORP 4.700% 01/06/2022	USD	40.214,49	0,12
			<b>23.707.843,35</b>	<b>71,48</b>
<b>Vereinigtes Königreich</b>				
400.000	BARCLAYS PLC 16/05/2024 FRN	USD	406.417,54	1,23
600.000	HSBC HOLDINGS PLC 13/03/2028 FRN	USD	602.418,02	1,81
400.000	LLOYDS BANKING GROUP PLC 07/11/2028 FRN	USD	391.166,72	1,18
200.000	ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP PLC 01/11/2029 FRN	USD	198.234,13	0,60
			<b>1.598.236,41</b>	<b>4,82</b>
<b>Japan</b>				
200.000	MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP INC 2.757% 13/09/2026	USD	194.215,86	0,59
230.000	MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP INC 3.455% 02/03/2023	USD	232.611,87	0,70
400.000	MIZUHO FINANCIAL GROUP INC 11/09/2024 FRN	USD	404.589,98	1,22
200.000	ORIX CORP 2.900% 18/07/2022	USD	200.772,67	0,61
400.000	SUMITOMO MITSUI FINANCIAL GROUP INC 3.202% 17/09/2029	USD	382.942,50	1,15
			<b>1.415.132,88</b>	<b>4,27</b>
<b>Kaimaninseln</b>				
240.000	ALIBABA GROUP HOLDING LTD 2.800% 06/06/2023	USD	239.109,53	0,72
220.000	AZURE ORBIT IV INTERNATIONAL FINANCE LTD 3.750% 25/01/2023 EMTN	USD	220.822,62	0,67
200.000	FIBRIA OVERSEAS FINANCE LTD 5.500% 17/01/2027 GMTN	USD	211.875,02	0,64
250.000	TENCENT MUSIC ENTERTAINMENT GROUP 1.375% 03/09/2025	USD	229.964,23	0,69
200.000	WEIBO CORP 3.500% 05/07/2024	USD	195.502,92	0,59
			<b>1.097.274,32</b>	<b>3,31</b>
<b>Australien</b>				
250.000	NEWCASTLE COAL INFRASTRUCTURE GROUP PTY LTD 4.400% 29/09/2027	USD	231.328,85	0,70
210.000	QBE INSURANCE GROUP LTD 24/11/2043 FRN	USD	220.273,12	0,66
200.000	RIO TINTO FINANCE USA LTD 7.125% 15/07/2028	USD	241.722,58	0,73
200.000	WESTPAC BANKING CORP 3.400% 25/01/2028	USD	201.216,86	0,61
			<b>894.541,41</b>	<b>2,70</b>
<b>Jungferninseln</b>				
220.000	CNPC GENERAL CAPITAL LTD 3.950% 19/04/2022	USD	220.116,50	0,66
220.000	SF HOLDING INVESTMENT LTD 4.125% 26/07/2023	USD	222.528,00	0,67
220.000	STATE GRID OVERSEAS INVESTMENT BVI LTD 2.750% 04/05/2022	USD	220.023,89	0,66
230.000	YUNNAN ENERGY INVESTMENT OVERSEAS FINANCE CO LTD 4.250% 14/11/2022	USD	224.365,90	0,68
			<b>887.034,29</b>	<b>2,67</b>
<b>Bermuda</b>				
50.000	AIRCASTLE LTD 4.400% 25/09/2023	USD	50.135,69	0,15
205.000	ALLIED WORLD ASSURANCE CO HOLDINGS LTD 4.350% 29/10/2025	USD	208.876,92	0,63
230.000	ASPEN INSURANCE HOLDINGS LTD 4.650% 15/11/2023	USD	235.521,37	0,71
240.000	ATHENE HOLDING LTD 4.125% 12/01/2028	USD	241.641,31	0,73
			<b>736.175,29</b>	<b>2,22</b>

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW
<b>Kanada</b>				
200.000	BANK OF MONTREAL 05/10/2028 FRN	USD	203.177,20	0,61
200.000	NUTRIEN LTD 3.000% 01/04/2025	USD	198.853,55	0,60
			<b>402.030,75</b>	<b>1,21</b>
<b>Spanien</b>				
400.000	BANCO SANTANDER SA 2.958% 25/03/2031	USD	369.306,69	1,11
			<b>369.306,69</b>	<b>1,11</b>
<b>Frankreich</b>				
121.000	LEGRAND FRANCE SA 8.500% 15/02/2025	USD	138.618,32	0,42
200.000	TOTAL CAPITAL 3.883% 11/10/2028	USD	206.956,12	0,62
			<b>345.574,44</b>	<b>1,04</b>
<b>Chile</b>				
240.000	ENEL GENERACION CHILE SA 4.250% 15/04/2024	USD	242.904,80	0,73
			<b>242.904,80</b>	<b>0,73</b>
<b>Luxemburg</b>				
200.000	TYCO ELECTRONICS GROUP SA 3.450% 01/08/2024	USD	201.968,73	0,61
			<b>201.968,73</b>	<b>0,61</b>
<b>Mexiko</b>				
200.000	FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB DE CV 2.875% 10/05/2023	USD	200.942,64	0,61
			<b>200.942,64</b>	<b>0,61</b>
<b>Irland</b>				
200.000	AERCAP IRELAND CAPITAL DAC / AERCAP GLOBAL AVIATION TRUST 3.875% 23/01/2028	USD	194.462,43	0,59
			<b>194.462,43</b>	<b>0,59</b>
			<b>32.293.428,43</b>	<b>97,37</b>
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>			<b>32.293.428,43</b>	<b>97,37</b>

### Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022

Bezeichnung	Verkauf / Kauf	Zinssatz (%)	Fälligkeits- datum	Währung	Nennwert	Swap-Wert in USD
<b>Credit Default Swap</b>						
CDX NORTH AMERICA INVESTMENT GRADE SERIES 38 VERSION 1	Verkauf	1,000	20/06/2032	USD	15.000.000,00	(45.712,95)
						<b>(45.712,95)</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) US Factor Credit

(ausgedrückt in USD)

### Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl	Bezeichnung	Währung	Engagement in USD	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in USD
<b>Zins-Futures</b>				
32	US LONG BOND (CBT) 21/06/2022	USD	4.802.000,00	(150.750,00)
20	US ULTRA BOND (CBT) 21/06/2022	USD	3.542.500,00	(144.531,25)
			<b>8.344.500,00</b>	<b>(295.281,25)</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>				<b>(340.994,20)</b>

### Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick

		%
		NIW
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	<b>32.293.428,43</b>	<b>97,37</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	<b>(340.994,20)</b>	<b>(1,03)</b>
<b>Bankguthaben</b>	<b>49.077,63</b>	<b>0,15</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>	<b>1.165.096,41</b>	<b>3,51</b>
<b>Nettovermögen Gesamt</b>	<b>33.166.608,27</b>	<b>100,00</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) US High Dividend

(ausgedrückt in USD)

### Statistische Angaben

<b>Nettovermögen</b>	31.03.2022	USD	395.000.437,02	Distribution N (USD)	31.03.2022	USD	2.287,95
	30.09.2021	USD	309.957.646,98		30.09.2021	USD	2.089,75
	30.09.2020	USD	212.225.814,35		30.09.2020	USD	1.661,28
<b>Nettoinventarwert pro Anteil**</b>				Distribution P (EUR)	31.03.2022	EUR	637,88
					30.09.2021	EUR	562,98
					30.09.2020	EUR	448,64
Capitalisation I (EUR)	31.03.2022	EUR	16.986,17	Distribution P (USD)	31.03.2022	USD	2.060,75
	30.09.2021	EUR	14.696,66		30.09.2021	USD	1.895,16
	30.09.2020	EUR	11.376,79		30.09.2020	USD	1.527,28
Capitalisation I (USD)	31.03.2022	USD	911,09	Distribution R (USD)	31.03.2022	USD	334,99
	30.09.2021	USD	821,09		30.09.2021	USD	306,92
	30.09.2020	USD	643,14		30.09.2020	USD	245,47
Capitalisation I Hedged (i) (PLN)	31.03.2022	PLN	73.955,17	Distribution X (M) (USD)	31.03.2022	USD	378,21
	30.09.2021	PLN	66.348,46		30.09.2021	USD	345,95
	30.09.2020	PLN	52.272,56		30.09.2020	USD	279,61
Capitalisation N (EUR)	31.03.2022	EUR	775,71	Distribution X (M) Hedged (i) (AUD)	31.03.2022	AUD	353,66
	30.09.2021	EUR	669,95		30.09.2021	AUD	324,58
	30.09.2020	EUR	516,77		30.09.2020	AUD	264,84
Capitalisation P (EUR)	31.03.2022	EUR	697,57	Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR)	31.03.2022	ZAR	4.783,78
	30.09.2021	EUR	606,55		30.09.2021	ZAR	4.349,46
	30.09.2020	EUR	474,21		30.09.2020	ZAR	3.503,32
Capitalisation P (USD)	31.03.2022	USD	770,22	Distribution X (Q) Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	EUR	384,96
	30.09.2021	USD	697,57		30.09.2021	EUR	354,75
	30.09.2020	USD	551,82		30.09.2020	EUR	290,09
Capitalisation P Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	EUR	654,68	Distribution Y (M) (USD)	31.03.2022	USD	344,27
	30.09.2021	EUR	596,76		30.09.2021	USD	316,71
	30.09.2020	EUR	477,30		30.09.2020	USD	258,96
Capitalisation R (USD)	31.03.2022	USD	362,53	Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD)	31.03.2022	AUD	322,52
	30.09.2021	USD	327,11		30.09.2021	AUD	298,04
	30.09.2020	USD	256,84		30.09.2020	AUD	245,66
Capitalisation X (USD)	31.03.2022	USD	708,48	Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR)	31.03.2022	ZAR	4.329,49
	30.09.2021	USD	643,26		30.09.2021	ZAR	3.965,95
	30.09.2020	USD	511,39		30.09.2020	ZAR	3.238,68
Capitalisation X Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	EUR	561,71	<b>Anzahl der Anteile</b>			
	30.09.2021	EUR	513,45		Capitalisation I (EUR)	31.03.2022	181
	30.09.2020	EUR	413,11		30.09.2021	340	
Capitalisation Y (USD)	31.03.2022	USD	442,64	30.09.2020	619		
	30.09.2021	USD	403,91	Capitalisation I (USD)	31.03.2022	8.298	
	30.09.2020	USD	324,35	30.09.2021	9.400		
Distribution I (USD)	31.03.2022	USD	-	30.09.2020	12.597		
	30.09.2021	USD	6.505,36	Capitalisation I Hedged (i) (PLN)	31.03.2022	2.061	
	30.09.2020	USD	5.189,85	30.09.2021	1.644		
Distribution N (EUR)	31.03.2022	EUR	707,87	30.09.2020	1.469		
	30.09.2021	EUR	620,46				
	30.09.2020	EUR	487,78				

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

## NN (L) US High Dividend

(ausgedrückt in USD)

### Statistische Angaben (Fortsetzung)

Anzahl der Anteile			Anzahl der Anteile				
Capitalisation N (EUR)	31.03.2022	67.219	Distribution X (M) (USD)	31.03.2022	32.671		
	30.09.2021	82.506		30.09.2021	24.434		
	30.09.2020	92.633		30.09.2020	22.739		
Capitalisation P (EUR)	31.03.2022	15.203	Distribution X (M) Hedged (i) (AUD)	31.03.2022	20.917		
	30.09.2021	16.411		30.09.2021	18.034		
	30.09.2020	19.496		30.09.2020	15.325		
Capitalisation P (USD)	31.03.2022	59.478	Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR)	31.03.2022	27.753		
	30.09.2021	63.813		30.09.2021	27.162		
	30.09.2020	79.547		30.09.2020	26.677		
Capitalisation P Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	50	Distribution X (Q) Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	994		
	30.09.2021	56		30.09.2021	754		
	30.09.2020	56		30.09.2020	1.153		
Capitalisation R (USD)	31.03.2022	659	Distribution Y (M) (USD)	31.03.2022	154.608		
	30.09.2021	903		30.09.2021	91.546		
	30.09.2020	813		30.09.2020	18.684		
Capitalisation X (USD)	31.03.2022	43.707	Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD)	31.03.2022	47.217		
	30.09.2021	30.630		30.09.2021	34.450		
	30.09.2020	21.689		30.09.2020	13.096		
Capitalisation X Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	2.057	Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR)	31.03.2022	58.043		
	30.09.2021	31		30.09.2021	44.233		
	30.09.2020	114		30.09.2020	21.867		
Capitalisation Y (USD)	31.03.2022	152.187	<b>Dividende</b>				
	30.09.2021	96.558		Distribution I (USD)	14.12.2021	USD	104,40
	30.09.2020	17.816		Distribution N (EUR)	14.12.2021	EUR	9,95
Distribution I (USD)	31.03.2022	-	Distribution N (USD)	14.12.2021	USD	33,50	
	30.09.2021	47	Distribution P (EUR)	14.12.2021	EUR	9,10	
	30.09.2020	363	Distribution P (USD)	14.12.2021	USD	30,55	
Distribution N (EUR)	31.03.2022	16.444	Distribution R (USD)	14.12.2021	USD	4,95	
	30.09.2021	15.843	Distribution X (M) (USD)	02.03.2022	USD	0,45	
	30.09.2020	19.392	Distribution X (M) (USD)	07.02.2022	USD	0,45	
Distribution N (USD)	31.03.2022	225	Distribution X (M) (USD)	04.01.2022	USD	0,45	
	30.09.2021	202	Distribution X (M) (USD)	02.12.2021	USD	0,45	
	30.09.2020	324	Distribution X (M) (USD)	02.11.2021	USD	0,45	
Distribution P (EUR)	31.03.2022	101	Distribution X (M) (USD)	04.10.2021	USD	0,45	
	30.09.2021	101					
	30.09.2020	186					
Distribution P (USD)	31.03.2022	4.272					
	30.09.2021	4.395					
	30.09.2020	4.820					
Distribution R (USD)	31.03.2022	910					
	30.09.2021	1.240					
	30.09.2020	1.392					

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.



## NN (L) US High Dividend

(ausgedrückt in USD)

### Statistische Angaben (Fortsetzung)

Distribution X (M) Hedged (i) (AUD)	02.03.2022	AUD	0,45	Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR)	04.01.2022	ZAR	16,90
Distribution X (M) Hedged (i) (AUD)	07.02.2022	AUD	0,45	Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR)	02.12.2021	ZAR	16,90
Distribution X (M) Hedged (i) (AUD)	04.01.2022	AUD	0,45	Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR)	02.11.2021	ZAR	16,90
Distribution X (M) Hedged (i) (AUD)	02.12.2021	AUD	0,45	Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR)	04.10.2021	ZAR	16,90
Distribution X (M) Hedged (i) (AUD)	02.11.2021	AUD	0,45				
Distribution X (M) Hedged (i) (AUD)	04.10.2021	AUD	0,45				
Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR)	02.03.2022	ZAR	17,20				
Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR)	07.02.2022	ZAR	17,20				
Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR)	04.01.2022	ZAR	17,20				
Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR)	02.12.2021	ZAR	17,20				
Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR)	02.11.2021	ZAR	17,20				
Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR)	04.10.2021	ZAR	17,20				
Distribution X (Q) Hedged (i) (EUR)	11.02.2022	EUR	1,59				
Distribution X (Q) Hedged (i) (EUR)	11.11.2021	EUR	1,60				
Distribution Y (M) (USD)	02.03.2022	USD	0,45				
Distribution Y (M) (USD)	07.02.2022	USD	0,45				
Distribution Y (M) (USD)	04.01.2022	USD	0,45				
Distribution Y (M) (USD)	02.12.2021	USD	0,45				
Distribution Y (M) (USD)	02.11.2021	USD	0,45				
Distribution Y (M) (USD)	04.10.2021	USD	0,45				
Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD)	02.03.2022	AUD	0,44				
Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD)	07.02.2022	AUD	0,44				
Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD)	04.01.2022	AUD	0,44				
Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD)	02.12.2021	AUD	0,44				
Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD)	02.11.2021	AUD	0,44				
Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD)	04.10.2021	AUD	0,44				
Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR)	02.03.2022	ZAR	16,90				
Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR)	07.02.2022	ZAR	16,90				

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

## NN (L) US High Dividend

(ausgedrückt in USD)

### Statistische Angaben (Fortsetzung)

#### Laufende Kosten in %\*

Capitalisation I (EUR)	31.03.2022	0,81%
Capitalisation I (USD)	31.03.2022	0,81%
Capitalisation I Hedged (i) (PLN)	31.03.2022	0,83%
Capitalisation N (EUR)	31.03.2022	0,45%
Capitalisation P (EUR)	31.03.2022	1,80%
Capitalisation P (USD)	31.03.2022	1,80%
Capitalisation P Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	1,82%
Capitalisation R (USD)	31.03.2022	1,05%
Capitalisation X (USD)	31.03.2022	2,30%
Capitalisation X Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	2,32%
Capitalisation Y (USD)	31.03.2022	3,30%
Distribution N (EUR)	31.03.2022	0,45%
Distribution N (USD)	31.03.2022	0,45%
Distribution P (EUR)	31.03.2022	1,80%
Distribution P (USD)	31.03.2022	1,80%
Distribution R (USD)	31.03.2022	1,05%
Distribution X (M) (USD)	31.03.2022	2,30%
Distribution X (M) Hedged (i) (AUD)	31.03.2022	2,32%
Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR)	31.03.2022	2,32%
Distribution X (Q) Hedged (i) (EUR)	31.03.2022	2,32%
Distribution Y (M) (USD)	31.03.2022	3,30%
Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD)	31.03.2022	3,32%
Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR)	31.03.2022	3,32%
<b>Portfolioumsatz in %*</b>	31.03.2022	(76,48%)

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

## NN (L) US High Dividend

(ausgedrückt in USD)

### Finanzabschlüsse

#### Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022

	Erläuterungen	
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	2	<b>381.344.027,20</b>
Aktien		381.344.027,20
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	2	<b>2.453.358,81</b>
Devisentermingeschäfte		2.453.358,81
<b>Bankguthaben</b>		<b>12.283.687,58</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte</b>	4	<b>9.304.786,72</b>
<b>Vermögenswerte Gesamt</b>		<b>405.385.860,31</b>
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>	4, 12	<b>(10.385.423,29)</b>
<b>Verbindlichkeiten Gesamt</b>		<b>(10.385.423,29)</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Berichtszeitraums</b>		<b>395.000.437,02</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) US High Dividend

(ausgedrückt in USD)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW
<b>Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>				
<b>Aktien</b>				
<b>Vereinigte Staaten</b>				
13.894	ADVANCE AUTO PARTS INC	USD	2.875.502,24	0,73
46.203	AFLAC INC	USD	2.975.011,17	0,75
23.727	ALLSTATE CORP/THE	USD	3.286.426,77	0,83
7.125	AMERICAN TOWER CORP	USD	1.789.942,50	0,45
9.310	AMERIPRISE FINANCIAL INC	USD	2.796.351,60	0,71
7.162	AMGEN INC	USD	1.731.914,84	0,44
49.210	APPLE INC	USD	8.592.558,10	2,18
23.896	APPLIED MATERIALS INC	USD	3.149.492,80	0,80
38.725	ATMOS ENERGY CORP	USD	4.627.250,25	1,17
33.126	AUTOMATIC DATA PROCESSING INC	USD	7.537.490,04	1,91
95.610	BAKER HUGHES CO - A	USD	3.481.160,10	0,88
99.326	BANK OF NEW YORK MELLON CORP/THE	USD	4.929.549,38	1,25
35.897	BECTON DICKINSON AND CO	USD	9.548.602,00	2,42
3.322	BLACKROCK INC - A	USD	2.538.572,74	0,64
299.626	CAPITOL FEDERAL FINANCIAL INC	USD	3.259.930,88	0,82
23.571	CARDINAL HEALTH INC	USD	1.336.475,70	0,34
32.741	CHEVRON CORP	USD	5.331.217,03	1,35
172.847	CISCO SYSTEMS INC/DELAWARE	USD	9.637.948,72	2,44
73.031	COLGATE-PALMOLIVE CO	USD	5.537.940,73	1,40
54.781	COMCAST CORP - A	USD	2.564.846,42	0,65
35.101	COMMERCE BANCSHARES INC/MO	USD	2.512.880,59	0,64
228.086	CORNING INC	USD	8.418.654,26	2,12
9.456	DEERE & CO	USD	3.928.589,76	0,99
36.700	DUKE ENERGY HOLDING CORP COM	USD	4.097.922,00	1,04
83.255	EMERSON ELECTRIC CO	USD	8.163.152,75	2,07
1.177	EQUINIX INC	USD	872.886,74	0,22
36.285	EVERSOURCE ENERGY	USD	3.199.974,15	0,81
192.644	EXXON MOBIL CORP	USD	15.910.467,96	4,02
11.615	FREEPORT-MCMORAN INC	USD	577.730,10	0,15
21.564	HERSHEY CO/THE	USD	4.671.409,32	1,18
40.350	HUBBELL INC - B	USD	7.415.119,50	1,88
7.669	INTEL CORP	USD	380.075,64	0,10
102.800	JOHNSON & JOHNSON	USD	18.219.244,00	4,61
57.418	JPMORGAN CHASE & CO	USD	7.827.221,76	1,98
43.816	KIMBERLY-CLARK CORP	USD	5.396.378,56	1,37
52.701	MARSH & MCLENNAN COS INC	USD	8.981.304,42	2,27
48.558	MERCK & CO INC	USD	3.984.183,90	1,01
32.417	METLIFE INC	USD	2.278.266,76	0,58
12.711	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	USD	955.104,54	0,24
62.939	MICROSOFT CORP	USD	19.404.723,09	4,91
73.953	MONDELEZ INTERNATIONAL INC - A	USD	4.642.769,34	1,18
22.950	NORFOLK SOUTHERN CORP	USD	6.545.799,00	1,66
31.438	NORTHERN TRUST CORP	USD	3.660.955,10	0,93
91.649	ONE GAS INC	USD	8.087.107,76	2,05
65.155	ORACLE CORP	USD	5.390.273,15	1,36
31.363	PACKAGING CORP OF AMERICA	USD	4.896.077,93	1,24
47.397	PEPSICO INC	USD	7.933.309,86	2,01
5.028	PNC FINANCIAL SERVICES GROUP INC/THE	USD	927.414,60	0,23
24.981	PROCTER & GAMBLE CO/THE	USD	3.817.096,80	0,97
11.495	QUEST DIAGNOSTICS INC	USD	1.573.205,70	0,40
83.793	RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	USD	8.301.372,51	2,10
43.256	REINSURANCE GROUP OF AMERICA INC - A	USD	4.734.801,76	1,20
37.945	REPUBLIC SERVICES INC - A	USD	5.027.712,50	1,27

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW
82.871	SPIRE INC	USD	5.946.822,96	1,51
7.165	STANLEY BLACK & DECKER INC	USD	1.001.595,35	0,25
29.357	T ROWE PRICE GROUP INC	USD	4.438.484,83	1,12
46.962	TEXAS INSTRUMENTS INC	USD	8.616.587,76	2,18
42.635	TRUIST FINANCIAL CORP	USD	2.417.404,50	0,61
6.598	UNITED PARCEL SERVICE INC - B	USD	1.415.007,08	0,36
4.615	UNITEDHEALTH GROUP INC	USD	2.353.511,55	0,60
63.541	US BANCORP	USD	3.377.204,15	0,85
219.183	VERIZON COMMUNICATIONS INC	USD	11.165.182,02	2,82
54.889	WALMART INC	USD	8.174.069,88	2,07
19.483	WELLTOWER INC	USD	1.873.095,62	0,47
10.165	WW GRAINGER INC	USD	5.243.005,35	1,33
			<b>336.283.340,87</b>	<b>85,12</b>
<b>Irland</b>				
46.606	JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	USD	3.055.955,42	0,77
29.606	LINDE PLC	USD	9.457.044,58	2,39
161.565	MEDTRONIC PLC	USD	17.925.636,75	4,55
			<b>30.438.636,75</b>	<b>7,71</b>
<b>Schweiz</b>				
22.992	CHUBB LTD	USD	4.917.988,80	1,25
51.871	TE CONNECTIVITY LTD	USD	6.794.063,58	1,72
			<b>11.712.052,38</b>	<b>2,97</b>
<b>Jersey</b>				
256.840	AMCOR PLC	USD	2.909.997,20	0,74
			<b>2.909.997,20</b>	<b>0,74</b>
			<b>381.344.027,20</b>	<b>96,54</b>

### Wertpapierbestand Gesamt

**381.344.027,20 96,54**

### Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022

Zu erhalten	Zu zahlen	Fälligkeits- datum	Engagement in USD	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in USD	
<b>Devisentermingeschäfte</b>					
411.704.937,03	ZAR	26.780.218,85	USD 19/04/2022	26.780.218,85	1.341.051,91
157.146.681,00	PLN	37.014.607,17	USD 19/04/2022	37.014.607,17	643.329,09
23.366.597,21	AUD	17.009.915,77	USD 19/04/2022	17.009.915,77	540.269,30
1.553.738,53	EUR	1.719.012,86	USD 19/04/2022	1.719.012,86	10.505,24
212.279,63	USD	3.084.953,64	ZAR 01/04/2022	212.279,63	1.162,19
20.593,32	USD	18.453,62	EUR 19/04/2022	20.593,32	51,98
11.026,55	USD	9.876,44	EUR 04/04/2022	11.026,55	37,53
35.736,20	AUD	26.814,66	USD 01/04/2022	26.814,66	21,43
1.924,10	USD	27.808,12	ZAR 04/04/2022	1.924,10	21,06
2.215,84	USD	2.953,08	AUD 01/04/2022	2.215,84	(1,77)
13.195,03	USD	11.884,74	EUR 01/04/2022	13.195,03	(28,53)
92.526,07	AUD	69.630,50	USD 04/04/2022	69.630,50	(148,07)
1.145.888,95	ZAR	79.286,56	USD 04/04/2022	79.286,56	(868,15)

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) US High Dividend

(ausgedrückt in USD)

### Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Zu erhalten	Zu zahlen	Fälligkeits- datum	Engagement in USD	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in USD
531.342,29 USD	716.088,05 AUD	19/04/2022	531.342,29	(6.497,17)
2.017.274,04 USD	8.557.881,66 PLN	19/04/2022	2.017.274,04	(33.498,91)
1.785.729,49 USD	26.759.286,85 ZAR	19/04/2022	1.785.729,49	(42.048,32)
			<b>87.295.066,66</b>	<b>2.453.358,81</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>				<b>2.453.358,81</b>

### Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick

		% NIW
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	<b>381.344.027,20</b>	<b>96,54</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	<b>2.453.358,81</b>	<b>0,62</b>
<b>Bankguthaben</b>	<b>12.283.687,58</b>	<b>3,11</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>	<b>(1.080.636,57)</b>	<b>(0,27)</b>
<b>Nettovermögen Gesamt</b>	<b>395.000.437,02</b>	<b>100,00</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) US High Yield

(ausgedrückt in USD)

### Statistische Angaben

<b>Nettovermögen</b>	31.03.2022	USD	326.661.044,58
	30.09.2021	USD	282.153.556,75
	30.09.2020	USD	268.580.272,80
<b>Nettoinventarwert pro Anteil**</b>			
Capitalisation I (USD)	31.03.2022	USD	6.096,10
	30.09.2021	USD	6.314,56
	30.09.2020	USD	5.613,99
Capitalisation P (USD)	31.03.2022	USD	299,46
	30.09.2021	USD	310,86
	30.09.2020	USD	277,44
Capitalisation Z (USD)	31.03.2022	USD	6.287,58
	30.09.2021	USD	6.489,52
	30.09.2020	USD	5.728,17
Capitalisation Zz (USD)	31.03.2022	USD	308.602,49
	30.09.2021	USD	318.274,90
	30.09.2020	USD	280.513,90
<b>Anzahl der Anteile</b>			
Capitalisation I (USD)	31.03.2022		23.801
	30.09.2021		17.066
	30.09.2020		23.112
Capitalisation P (USD)	31.03.2022		9
	30.09.2021		9
	30.09.2020		32
Capitalisation Z (USD)	31.03.2022		28.091
	30.09.2021		25.940
	30.09.2020		23.304
Capitalisation Zz (USD)	31.03.2022		16
	30.09.2021		19
	30.09.2020		19
<b>Laufende Kosten in %*</b>			
Capitalisation I (USD)	31.03.2022		0,88%
Capitalisation P (USD)	31.03.2022		1,25%
Capitalisation Z (USD)	31.03.2022		0,16%
Capitalisation Zz (USD)	31.03.2022		0,01%
<b>Portfolioumsatz in %*</b>	31.03.2022		69,50%

\* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 14).

Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.

Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.

Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.

Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

\*\*Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

## NN (L) US High Yield

(ausgedrückt in USD)

### Finanzabschlüsse

#### Nettovermögensaufstellung zum 31.03.2022

	Erläuterungen	
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	2	<b>302.805.725,38</b>
Anleihen und andere Schuldtitel		302.805.725,38
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	2	<b>323.247,07</b>
Futures		323.247,07
<b>Bankguthaben</b>		<b>16.730.930,51</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte</b>	4	<b>8.705.127,48</b>
<b>Vermögenswerte Gesamt</b>		<b>328.565.030,44</b>
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>	4, 12	<b>(1.749.379,16)</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	2	<b>(154.606,70)</b>
Devisentermingeschäfte		(154.606,70)
<b>Verbindlichkeiten Gesamt</b>		<b>(1.903.985,86)</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Berichtszeitraums</b>		<b>326.661.044,58</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) US High Yield

(ausgedrückt in USD)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW	Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW
<b>Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>									
<b>Anleihen und andere Schuldtitel</b>									
<b>Vereinigte Staaten</b>									
2.025.000	ACRISURE LLC / ACRISURE FINANCE INC 7.000% 15/11/2025	USD	2.020.525,40	0,62	2.335.000	CHENIERE ENERGY PARTNERS LP 4.500% 01/10/2029	USD	2.346.394,29	0,72
467.000	AHERN RENTALS INC 7.375% 15/05/2023	USD	434.198,25	0,13	4.744.000	CHS/COMMUNITY HEALTH SYSTEMS INC 5.625% 15/03/2027	USD	4.833.836,04	1,49
730.000	ALBERTSONS COS INC / SAFEWAY INC / NEW ALBERTSONS LP / ALBERTSONS LLC 5.875% 15/02/2028	USD	728.857,51	0,22	143.000	CHS/COMMUNITY HEALTH SYSTEMS INC 6.000% 15/01/2029	USD	144.646,49	0,04
1.515.000	ALBERTSONS COS INC / SAFEWAY INC / NEW ALBERTSONS LP / ALBERTSONS LLC 6.000% 15/01/2027	USD	1.466.298,84	0,45	50.000	CHS/COMMUNITY HEALTH SYSTEMS INC 6.125% 01/04/2030	USD	46.651,37	0,01
200.000	ALLIED UNIVERSAL HOLDCO LLC / ALLIED UNIVERSAL FINANCE CORP 6.000% 01/06/2029	USD	176.604,93	0,05	1.557.000	CLARIVATE SCIENCE HOLDINGS CORP 3.875% 01/07/2028	USD	1.482.120,06	0,45
1.549.000	ALLIED UNIVERSAL HOLDCO LLC / ALLIED UNIVERSAL FINANCE CORP 6.625% 15/07/2026	USD	1.568.463,82	0,48	286.000	CLARIVATE SCIENCE HOLDINGS CORP 4.875% 01/07/2029	USD	269.780,25	0,08
2.688.000	AMERICAN AIRLINES INC 11.750% 15/07/2025	USD	3.139.714,34	0,96	75.000	CLEARWAY ENERGY OPERATING LLC 3.750% 15/01/2032	USD	69.233,51	0,02
2.075.000	AMERICAN AXLE & MANUFACTURING INC 5.000% 01/10/2029	USD	1.945.376,22	0,60	2.190.000	CLEARWAY ENERGY OPERATING LLC 4.750% 15/03/2028	USD	2.200.923,33	0,67
1.460.000	ANTERO MIDSTREAM PARTNERS LP / ANTERO MIDSTREAM FINANCE CORP 5.750% 01/03/2027	USD	1.488.506,43	0,46	1.654.000	CLEVELAND-CLIFFS INC 4.875% 01/03/2031	USD	1.635.259,06	0,50
2.087.000	ANTERO MIDSTREAM PARTNERS LP / ANTERO MIDSTREAM FINANCE CORP 5.750% 15/01/2028	USD	2.134.007,78	0,65	1.167.000	CLYDESDALE ACQUISITION HOLDINGS INC 8.750% 15/04/2030	USD	1.098.438,75	0,34
1.350.000	ANTERO RESOURCES CORP 5.375% 01/03/2030	USD	1.378.732,81	0,42	2.071.000	COBRA ACQUISITIONCO LLC 6.375% 01/11/2029	USD	1.772.623,80	0,54
431.000	ANTERO RESOURCES CORP 7.625% 01/02/2029	USD	466.609,99	0,14	1.936.000	COLGATE ENERGY PARTNERS III LLC 5.875% 01/07/2029	USD	1.997.174,39	0,61
1.500.000	ARCHES BUYER INC 4.250% 01/06/2028	USD	1.396.457,88	0,43	1.586.000	COLGATE ENERGY PARTNERS III LLC 7.750% 15/02/2026	USD	1.689.004,15	0,52
150.000	ARCHES BUYER INC 6.125% 01/12/2028	USD	138.368,82	0,04	205.000	COMMERCIAL METALS CO 4.375% 15/03/2032	USD	190.998,87	0,06
950.000	ARCHROCK PARTNERS LP / ARCHROCK PARTNERS FINANCE CORP 6.250% 01/04/2028	USD	937.150,21	0,29	500.000	COMSTOCK RESOURCES INC 5.875% 15/01/2030	USD	492.510,01	0,15
915.000	ARCHROCK PARTNERS LP / ARCHROCK PARTNERS FINANCE CORP 6.875% 01/04/2027	USD	925.187,09	0,28	1.257.000	COMSTOCK RESOURCES INC 6.750% 01/03/2029	USD	1.293.994,11	0,40
2.445.000	ARROW BIDCO LLC 9.500% 15/03/2024	USD	2.492.006,42	0,76	1.220.000	CONDOR MERGER SUB INC 7.375% 15/02/2030	USD	1.169.974,61	0,36
583.000	ASBURY AUTOMOTIVE GROUP INC 4.625% 15/11/2029	USD	542.992,46	0,17	875.000	CONSENSUS CLOUD SOLUTIONS INC 6.000% 15/10/2026	USD	871.077,51	0,27
583.000	ASBURY AUTOMOTIVE GROUP INC 5.000% 15/02/2032	USD	542.355,91	0,17	375.000	CONSENSUS CLOUD SOLUTIONS INC 6.500% 15/10/2028	USD	373.102,25	0,11
1.640.000	AUDACY CAPITAL CORP 6.750% 31/03/2029	USD	1.531.494,16	0,47	1.029.000	CONSOLIDATED COMMUNICATIONS INC 5.000% 01/10/2028	USD	885.189,15	0,27
2.000.000	BAUSCH HEALTH AMERICAS INC 8.500% 31/01/2027	USD	1.994.152,62	0,61	481.000	CONSOLIDATED COMMUNICATIONS INC 6.500% 01/10/2028	USD	443.741,93	0,14
2.018.000	BCPE ULYSSES INTERMEDIATE INC 7.750% 01/04/2027	USD	1.832.824,55	0,56	1.234.000	COOPER-STANDARD AUTOMOTIVE INC 13.000% 01/06/2024	USD	1.258.104,77	0,39
1.405.000	BLUE RACER MIDSTREAM LLC / BLUE RACER FINANCE CORP 6.625% 15/07/2026	USD	1.427.623,61	0,44	1.575.000	COTY INC 6.500% 15/04/2026	USD	1.575.979,16	0,48
500.000	BLUE RACER MIDSTREAM LLC / BLUE RACER FINANCE CORP 7.625% 15/12/2025	USD	523.775,47	0,16	1.165.000	CSC HOLDINGS LLC 4.125% 01/12/2030	USD	1.025.854,43	0,31
1.941.000	BROADSTREET PARTNERS INC 5.875% 15/04/2029	USD	1.810.436,11	0,55	700.000	CSC HOLDINGS LLC 4.625% 01/12/2030	USD	584.838,35	0,18
1.628.000	BUILDERS FIRSTSOURCE INC 4.250% 01/02/2032	USD	1.516.033,36	0,46	575.000	DIAMOND SPORTS GROUP LLC / DIAMOND SPORTS FINANCE CO 5.375% 15/08/2026	USD	220.333,32	0,07
1.000.000	CALLON PETROLEUM CO 6.375% 01/07/2026	USD	993.729,05	0,30	325.000	DIAMOND SPORTS GROUP LLC / DIAMOND SPORTS FINANCE CO 6.625% 15/08/2027	USD	67.200,53	0,02
1.707.000	CALLON PETROLEUM CO 8.000% 01/08/2028	USD	1.807.245,95	0,55	2.250.000	DIEBOLD NIXDORF INC 8.500% 15/04/2024	USD	2.170.741,59	0,66
1.686.000	CARGO AIRCRAFT MANAGEMENT INC 4.750% 01/02/2028	USD	1.643.701,23	0,50	775.000	DISH DBS CORP 5.125% 01/06/2029	USD	659.794,08	0,20
1.515.000	CARRIAGE SERVICES INC 4.250% 15/05/2029	USD	1.414.617,52	0,43	775.000	DISH DBS CORP 7.375% 01/07/2028	USD	735.365,94	0,23
652.000	CCO HOLDINGS LLC / CCO HOLDINGS CAPITAL CORP 4.250% 15/01/2034	USD	565.374,13	0,17	1.878.000	ENDEAVOR ENERGY RESOURCES LP / EER FINANCE INC 5.750% 30/01/2028	USD	1.937.705,13	0,59
130.000	CCO HOLDINGS LLC / CCO HOLDINGS CAPITAL CORP 4.500% 01/05/2032	USD	118.965,32	0,04	125.000	ENDEAVOR ENERGY RESOURCES LP / EER FINANCE INC 6.625% 15/07/2025	USD	130.130,83	0,04
755.000	CCO HOLDINGS LLC / CCO HOLDINGS CAPITAL CORP 4.500% 15/08/2030	USD	708.924,80	0,22	545.000	ENERGIZER HOLDINGS INC 6.500% 31/12/2027	USD	540.830,85	0,17
1.115.000	CCO HOLDINGS LLC / CCO HOLDINGS CAPITAL CORP 4.750% 01/03/2030	USD	1.071.736,47	0,33	1.185.000	ENLINK MIDSTREAM PARTNERS LP 4.150% 01/06/2025	USD	1.181.139,77	0,36
476.000	CENTENE CORP 2.450% 15/07/2028	USD	434.874,77	0,13	1.250.000	ENLINK MIDSTREAM PARTNERS LP 5.450% 01/06/2047	USD	1.062.463,68	0,33
1.547.000	CENTENE CORP 2.500% 01/03/2031	USD	1.369.855,24	0,42	150.000	EQM MIDSTREAM PARTNERS LP 4.500% 15/01/2029	USD	140.954,08	0,04
4.110.000	CENTENE CORP 3.375% 15/02/2030	USD	3.871.282,57	1,19	150.000	EQM MIDSTREAM PARTNERS LP 4.750% 15/01/2031	USD	140.644,49	0,04
1.250.000	CENTENE CORP 4.250% 15/12/2027	USD	1.254.812,40	0,38	2.102.000	EQM MIDSTREAM PARTNERS LP 5.500% 15/07/2028	USD	2.112.253,68	0,65
1.286.000	CENTENNIAL RESOURCE PRODUCTION LLC 6.875% 01/04/2027	USD	1.291.671,81	0,40	2.250.000	FIRSTCASH INC 5.625% 01/01/2030	USD	2.163.775,16	0,66
305.000	CHEMOURS CO/THE 4.000% 15/05/2026	EUR	326.626,19	0,10	1.200.000	FORD MOTOR CO 7.450% 16/07/2031	USD	1.419.405,82	0,43
1.545.000	CHEMOURS CO/THE 4.625% 15/11/2029	USD	1.417.278,33	0,43	160.000	FORD MOTOR CO 9.625% 22/04/2030	USD	208.617,84	0,06
117.000	CHENIERE ENERGY PARTNERS LP 3.250% 31/01/2032	USD	106.558,95	0,03	1.200.000	FORD MOTOR CREDIT CO LLC 1.355% 07/02/2025 EMTN	EUR	1.285.229,78	0,39
					5.280.000	FORD MOTOR CREDIT CO LLC 2.900% 10/02/2029	USD	4.704.101,05	1,45
					600.000	FORD MOTOR CREDIT CO LLC 2.900% 16/02/2028	USD	540.844,71	0,17
					339.000	FORD MOTOR CREDIT CO LLC 4.000% 13/11/2030	USD	319.009,33	0,10
					570.000	FORD MOTOR CREDIT CO LLC 4.125% 17/08/2027	USD	557.368,34	0,17
					1.050.000	FXI HOLDINGS INC 12.250% 15/11/2026	USD	1.136.331,70	0,35
					1.229.000	FXI HOLDINGS INC 7.875% 01/11/2024	USD	1.223.523,50	0,37
					1.200.000	HAT HOLDINGS I LLC / HAT HOLDINGS II LLC 3.375% 15/06/2026	USD	1.139.639,59	0,35

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.



## NN (L) US High Yield

(ausgedrückt in USD)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW	Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW
350.000	HAT HOLDINGS I LLC / HAT HOLDINGS II LLC 3.750% 15/09/2030	USD	318.462,83	0,10	1.795.000	OT MERGER CORP 7.875% 15/10/2029	USD	1.578.837,75	0,48
450.000	HAT HOLDINGS I LLC / HAT HOLDINGS II LLC 6.000% 15/04/2025	USD	463.611,30	0,14	543.000	PACTIV EVERGREEN GROUP ISSUER INC/PACTIV EVERGREEN GROUP ISSUER LLC 4.000% 15/10/2027	USD	504.619,82	0,15
5.075.000	HCA INC 3.500% 01/09/2030	USD	4.899.141,30	1,51	1.364.000	PARK RIVER HOLDINGS INC 5.625% 01/02/2029	USD	1.106.237,28	0,34
1.556.000	HOWARD MIDSTREAM ENERGY PARTNERS LLC 6.750% 15/01/2027	USD	1.527.010,55	0,47	1.677.000	PITNEY BOWES INC 6.875% 15/03/2027	USD	1.587.949,69	0,49
545.000	HUB INTERNATIONAL LTD 5.625% 01/12/2029	USD	531.216,07	0,16	393.000	PITNEY BOWES INC 7.250% 15/03/2029	USD	371.070,19	0,11
1.750.000	HUB INTERNATIONAL LTD 7.000% 01/05/2026	USD	1.771.479,06	0,54	1.375.000	PRA GROUP INC 5.000% 01/10/2029	USD	1.304.508,96	0,40
1.525.000	HUGHES SATELLITE SYSTEMS CORP 5.250% 01/08/2026	USD	1.557.248,40	0,48	960.000	PRA GROUP INC 7.375% 01/09/2025	USD	1.000.872,52	0,31
740.000	IHEARTCOMMUNICATIONS INC 5.250% 15/08/2027	USD	732.296,94	0,22	1.300.000	PRIMO WATER HOLDINGS INC 3.875% 31/10/2028	EUR	1.346.851,97	0,41
1.325.000	IHEARTCOMMUNICATIONS INC 8.375% 01/05/2027	USD	1.369.732,16	0,42	202.000	RANGE RESOURCES CORP 4.750% 15/02/2030	USD	200.705,55	0,06
2.083.000	IMOLA MERGER CORP 4.750% 15/05/2029	USD	2.005.833,70	0,61	1.265.000	RANGE RESOURCES CORP 8.250% 15/01/2029	USD	1.386.184,74	0,42
1.618.000	INGLES MARKETS INC 4.000% 15/06/2031	USD	1.531.661,30	0,47	1.717.000	ROBLOX CORP 3.875% 01/05/2030	USD	1.605.408,74	0,49
1.325.000	INNPHOS HOLDINGS INC 9.375% 15/02/2028	USD	1.417.286,48	0,43	1.831.000	ROCKET SOFTWARE INC 6.500% 15/02/2029	USD	1.659.625,80	0,51
1.773.000	IQVIA INC 2.250% 15/01/2028	EUR	1.872.938,93	0,57	1.700.000	SCIL IV LLC / SCIL USA HOLDINGS LLC 5.375% 01/11/2026	USD	1.563.438,01	0,48
1.542.000	JEFFERIES FINANCE LLC / JFIN CO-ISSUER CORP 5.000% 15/08/2028	USD	1.479.326,69	0,45	500.000	SCRIPPS ESCROW II INC 3.875% 15/01/2029	USD	464.917,01	0,14
1.835.000	LADDER CAPITAL FINANCE HOLDINGS LLLL / LADDER CAPITAL FINANCE CORP 4.250% 01/02/2027	USD	1.760.623,36	0,54	963.000	SCRIPPS ESCROW INC 5.875% 15/07/2027	USD	964.397,71	0,30
269.000	LADDER CAPITAL FINANCE HOLDINGS LLLL / LADDER CAPITAL FINANCE CORP 4.750% 15/06/2029	USD	253.804,81	0,08	310.000	SENSATA TECHNOLOGIES INC 3.750% 15/02/2031	USD	287.177,86	0,09
2.330.000	LAREDO PETROLEUM INC 7.750% 31/07/2029	USD	2.344.109,29	0,72	1.120.000	SENSATA TECHNOLOGIES INC 4.375% 15/02/2030	USD	1.072.370,15	0,33
1.705.000	LOGMEIN INC 5.500% 01/09/2027	USD	1.595.563,26	0,49	260.000	SERVICE CORP INTERNATIONAL/US 3.375% 15/08/2030	USD	234.865,31	0,07
1.912.000	LPL HOLDINGS INC 4.000% 15/03/2029	USD	1.814.201,64	0,56	1.000.000	SERVICE CORP INTERNATIONAL/US 4.000% 15/05/2031	USD	933.003,24	0,29
1.375.000	MATADOR RESOURCES CO 5.875% 15/09/2026	USD	1.400.976,20	0,43	620.000	SERVICE CORP INTERNATIONAL/US 5.125% 01/06/2029	USD	631.490,89	0,19
1.400.000	MATTEL INC 3.750% 01/04/2029	USD	1.346.281,68	0,41	1.795.000	SIGNAL PARENT INC 6.125% 01/04/2029	USD	1.467.398,70	0,45
750.000	MATTEL INC 6.200% 01/10/2040	USD	863.112,62	0,26	1.500.000	SINCLAIR TELEVISION GROUP INC 5.125% 15/02/2027	USD	1.363.486,37	0,42
1.011.000	MCGRAW-HILL EDUCATION INC 5.750% 01/08/2028	USD	961.111,23	0,29	288.000	SIRIUS XM RADIO INC 3.125% 01/09/2026	USD	272.396,85	0,08
1.000.000	MCGRAW-HILL EDUCATION INC 8.000% 01/08/2029	USD	949.879,07	0,29	767.000	SIRIUS XM RADIO INC 3.875% 01/09/2031	USD	698.024,95	0,21
1.750.000	MEDNAX INC 5.375% 15/02/2030	USD	1.692.562,48	0,52	840.000	SIRIUS XM RADIO INC 4.000% 15/07/2028	USD	798.907,28	0,24
2.675.000	MICHAELS COS INC/THE 7.875% 01/05/2029	USD	2.280.454,65	0,70	1.645.000	SIRIUS XM RADIO INC 4.125% 01/07/2030	USD	1.541.412,75	0,47
1.341.000	MIDCAP FINANCIAL ISSUER TRUST 5.625% 15/01/2030	USD	1.186.634,57	0,36	2.047.000	SIZZLING PLATTER LLC / SIZZLING PLATTER FINANCE CORP 8.500% 28/11/2025	USD	1.884.625,80	0,58
599.000	MIDCAP FINANCIAL ISSUER TRUST 6.500% 01/05/2028	USD	564.605,79	0,17	1.327.000	SONIC AUTOMOTIVE INC 4.625% 15/11/2029	USD	1.194.760,60	0,37
1.775.000	MILLENNIUM ESCROW CORP 6.625% 01/08/2026	USD	1.681.273,18	0,51	1.327.000	SONIC AUTOMOTIVE INC 4.875% 15/11/2031	USD	1.183.444,79	0,36
3.437.000	MOZART DEBT MERGER SUB INC 3.875% 01/04/2029	USD	3.179.064,90	0,97	1.465.000	SPRINT CAPITAL CORP 6.875% 15/11/2028	USD	1.696.373,22	0,52
117.000	MOZART DEBT MERGER SUB INC 5.250% 01/10/2029	USD	108.855,72	0,03	375.000	SPRINT CAPITAL CORP 8.750% 15/03/2032	USD	504.986,23	0,15
1.720.000	NATIONSTAR MORTGAGE HOLDINGS INC 5.500% 15/08/2028	USD	1.656.457,30	0,51	1.935.000	SRM ESCROW ISSUER LLC 6.000% 01/11/2028	USD	1.904.831,18	0,58
982.000	NATIONSTAR MORTGAGE HOLDINGS INC 5.750% 15/11/2031	USD	936.625,66	0,29	1.550.000	STANDARD INDUSTRIES INC/NJ 3.375% 15/01/2031	USD	1.361.132,19	0,42
1.094.000	NESCO HOLDINGS II INC 5.500% 15/04/2029	USD	1.078.347,56	0,33	167.000	STANDARD INDUSTRIES INC/NJ 4.375% 15/07/2030	USD	152.998,74	0,05
2.100.000	NETFLIX INC 3.625% 15/06/2030	EUR	2.471.251,55	0,76	724.000	STANDARD INDUSTRIES INC/NJ 4.750% 15/01/2028	USD	696.791,06	0,21
1.867.000	NEXSTAR MEDIA INC 5.625% 15/07/2027	USD	1.890.468,49	0,58	2.233.000	STAPLES INC 10.750% 15/04/2027	USD	1.987.699,95	0,61
2.339.000	NFP CORP 6.875% 15/08/2028	USD	2.233.439,74	0,68	2.043.000	STAPLES INC 7.500% 15/04/2026	USD	1.982.965,42	0,61
1.410.000	NMI HOLDINGS INC 7.375% 01/06/2025	USD	1.482.927,23	0,45	2.350.000	STARWOOD PROPERTY TRUST INC 3.750% 31/12/2024	USD	2.285.245,33	0,70
1.506.000	NOKIA OF AMERICA CORP 6.450% 15/03/2029	USD	1.579.220,18	0,48	2.392.000	STONEX GROUP INC 8.625% 15/06/2025	USD	2.498.634,93	0,76
2.463.000	NORTHERN OIL AND GAS INC 8.125% 01/03/2028	USD	2.568.800,09	0,79	1.718.000	SUNCOKE ENERGY INC 4.875% 30/06/2029	USD	1.620.973,89	0,50
1.586.000	NUSTAR LOGISTICS LP 6.000% 01/06/2026	USD	1.604.908,40	0,49	1.200.000	SWF ESCROW ISSUER CORP 6.500% 01/10/2029	USD	1.028.098,61	0,31
1.550.000	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 3.200% 15/08/2026	USD	1.521.406,69	0,47	1.000.000	TALLGRASS ENERGY PARTNERS LP / TALLGRASS ENERGY FINANCE CORP 6.000% 01/03/2027	USD	997.258,07	0,31
2.000.000	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 3.400% 15/04/2026	USD	1.987.893,44	0,61	860.000	TALLGRASS ENERGY PARTNERS LP / TALLGRASS ENERGY FINANCE CORP 6.000% 31/12/2030	USD	834.486,28	0,26
1.000.000	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 3.500% 15/08/2029	USD	985.138,84	0,30	1.230.000	TALLGRASS ENERGY PARTNERS LP / TALLGRASS ENERGY FINANCE CORP 7.500% 01/10/2025	USD	1.296.578,03	0,40
775.000	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 4.400% 15/04/2046	USD	736.167,24	0,23	1.666.000	TAP ROCK RESOURCES LLC 7.000% 01/10/2026	USD	1.724.226,98	0,53
2.625.000	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 6.125% 01/01/2031	USD	2.953.125,00	0,90	375.000	TARGA RESOURCES PARTNERS LP / TARGA RESOURCES PARTNERS FINANCE CORP 4.000% 15/01/2032	USD	359.929,40	0,11
415.000	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 8.875% 15/07/2030	USD	533.628,35	0,16	640.000	TARGA RESOURCES PARTNERS LP / TARGA RESOURCES PARTNERS FINANCE CORP 4.875% 01/02/2031	USD	644.956,80	0,20
1.130.000	OLIN CORP 5.625% 01/08/2029	USD	1.145.358,27	0,35	1.000.000	TARGA RESOURCES PARTNERS LP / TARGA RESOURCES PARTNERS FINANCE CORP 5.500% 01/03/2030	USD	1.039.039,16	0,32
1.582.000	OLYMPUS WATER US HOLDING CORP 3.875% 01/10/2028	EUR	1.604.204,74	0,49	65.000	TARGA RESOURCES PARTNERS LP / TARGA RESOURCES PARTNERS FINANCE CORP 6.500% 15/07/2027	USD	68.479,07	0,02

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) US High Yield

(ausgedrückt in USD)

### Wertpapierbestand zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW	Stückzahl/ Nominal	Bezeichnung	Währung	Marktwert in USD	% NIW	
5.672.000	TENET HEALTHCARE CORP 4.250% 01/06/2029	USD	5.455.125,29	1,68	563.000	ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD 5.375% 15/07/2027	USD	538.077,12	0,16	
310.000	TENET HEALTHCARE CORP 4.375% 15/01/2030	USD	297.837,23	0,09	866.000	ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD 5.500% 01/04/2028	USD	827.488,55	0,26	
175.000	TENET HEALTHCARE CORP 6.250% 01/02/2027	USD	179.736,15	0,06	800.000	ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD 9.125% 15/06/2023	USD	833.871,11	0,26	
310.000	T-MOBILE USA INC 2.550% 15/02/2031	USD	281.119,49	0,09				<b>2.699.817,78</b>	<b>0,83</b>	
724.000	T-MOBILE USA INC 2.625% 15/02/2029	USD	661.123,08	0,20		<b>Kaimaninseln</b>				
2.310.000	T-MOBILE USA INC 2.875% 15/02/2031	USD	2.083.272,37	0,64	1.784.399	GLOBAL AIRCRAFT LEASING CO LTD 6.500% 15/09/2024	USD	1.622.479,64	0,50	
1.000.000	T-MOBILE USA INC 3.500% 15/04/2031	USD	941.574,93	0,29	1.003.125	TRANSOCEAN POSEIDON LTD 6.875% 01/02/2027	USD	993.030,33	0,30	
1.150.000	T-MOBILE USA INC 4.750% 01/02/2028	USD	1.168.682,57	0,36				<b>2.615.509,97</b>	<b>0,80</b>	
1.532.000	TTM TECHNOLOGIES INC 4.000% 01/03/2029	USD	1.427.989,69	0,44		<b>Bermuda</b>				
4.044.000	UNITI GROUP LP / UNITI GROUP FINANCE INC / CSL CAPITAL LLC 6.500% 15/02/2029	USD	3.779.113,27	1,16	1.725.000	NCL CORP LTD 3.625% 15/12/2024	USD	1.625.720,57	0,49	
2.115.000	UNIVISION COMMUNICATIONS INC 4.500% 01/05/2029	USD	2.013.230,39	0,62	207.000	NCL CORP LTD 5.875% 15/02/2027	USD	204.417,92	0,06	
1.889.000	VICTORIA'S SECRET & CO 4.625% 15/07/2029	USD	1.701.907,38	0,52	265.000	NCL CORP LTD 5.875% 15/03/2026	USD	251.887,83	0,08	
1.536.000	WHITE CAP PARENT LLC 8.250% 15/03/2026	USD	1.513.691,00	0,46	245.000	NCL CORP LTD 7.750% 15/02/2029	USD	248.158,21	0,08	
1.165.000	WORLD ACCEPTANCE CORP 7.000% 01/11/2026	USD	1.027.022,30	0,31				<b>2.330.184,53</b>	<b>0,71</b>	
2.210.000	W&T OFFSHORE INC 9.750% 01/11/2023	USD	2.193.077,99	0,67		<b>Frankreich</b>				
			<b>262.553.773,03</b>	<b>80,37</b>	1.679.000	ALTICE FRANCE SA 3.375% 15/01/2028	EUR	1.696.732,34	0,52	
	<b>Kanada</b>					<b>Irland</b>				
194.000	BAUSCH HEALTH COS INC 4.875% 01/06/2028	USD	185.790,70	0,06	1.772.000	CASTLELAKE AVIATION FINANCE DAC 5.000% 15/04/2027	USD	1.582.116,08	0,48	
1.300.000	BAUSCH HEALTH COS INC 6.125% 15/04/2025	USD	1.310.158,10	0,40				<b>1.582.116,08</b>	<b>0,48</b>	
252.000	CLARIOS GLOBAL LP 6.750% 15/05/2025	USD	260.902,29	0,08		<b>Jersey</b>				
1.500.000	GARDA WORLD SECURITY CORP 9.500% 01/11/2027	USD	1.539.809,61	0,47	1.250.000	AVIS BUDGET FINANCE PLC 4.750% 30/01/2026	EUR	1.396.126,71	0,43	
2.430.000	HUSKY III HOLDING LTD 13.000% 15/02/2025	USD	2.527.203,30	0,77				<b>1.396.126,71</b>	<b>0,43</b>	
			<b>5.823.864,00</b>	<b>1,78</b>		<b>Vereinigtes Königreich</b>				
	<b>Panama</b>				913.000	INEOS QUATTRO FINANCE 1 PLC 3.750% 15/07/2026	EUR	954.898,47	0,29	
1.350.000	CARNIVAL CORP 1.875% 07/11/2022	EUR	1.487.524,30	0,46	348.000	INEOS QUATTRO FINANCE 2 PLC 3.375% 15/01/2026	USD	322.111,14	0,10	
2.750.000	CARNIVAL CORP 4.000% 01/08/2028	USD	2.563.323,46	0,78				<b>1.277.009,61</b>	<b>0,39</b>	
1.302.000	CARNIVAL CORP 7.625% 01/03/2026	USD	1.310.798,92	0,40				<b>302.805.725,38</b>	<b>92,70</b>	
			<b>5.361.646,68</b>	<b>1,64</b>						
	<b>Luxemburg</b>					<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>		<b>302.805.725,38</b>	<b>92,70</b>	
450.000	ALTICE FINANCING SA 2.250% 15/01/2025	EUR	477.563,92	0,15						
1.750.000	ALTICE FRANCE HOLDING SA 10.500% 15/05/2027	USD	1.833.192,97	0,56		<b>Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022</b>				
200.000	ALTICE FRANCE HOLDING SA 6.000% 15/02/2028	USD	172.501,23	0,05		Zu erhalten	Zu zahlen	Fälligkeits- datum	Engagement in USD	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in USD
2.027.880	ARD FINANCE SA 5.000% 30/06/2027	EUR	2.051.898,93	0,63						
750.000	GALAPAGOS HOLDING SA 7.000% 15/06/2022 - DEFAULTED	EUR	8,34	0,00						
			<b>4.535.165,39</b>	<b>1,39</b>						
	<b>Dänemark</b>									
4.100.000	DKT FINANCE APS 9.375% 17/06/2023	USD	4.097.937,82	1,25						
			<b>4.097.937,82</b>	<b>1,25</b>						
	<b>Supranational-Multinational</b>									
643.000	ALLIED UNIVERSAL HOLDCO LLC/ALLIED UNIVERSAL FINANCE CORP/ATLAS LUXCO 4 SARL 3.625% 01/06/2028	EUR	654.320,71	0,20						
3.010.000	CLARIOS GLOBAL LP / CLARIOS US FINANCE CO 8.500% 15/05/2027	USD	3.123.419,84	0,97						
			<b>3.777.740,55</b>	<b>1,17</b>						
	<b>Niederlande</b>									
1.500.000	DARLING GLOBAL FINANCE BV 3.625% 15/05/2026	EUR	1.678.967,86	0,52						
1.200.000	DIEBOLD NIXDORF DUTCH HOLDING BV 9.000% 15/07/2025	EUR	1.379.133,03	0,42						
			<b>3.058.100,89</b>	<b>0,94</b>						
	<b>Liberia</b>									
90.000	ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD 10.875% 01/06/2023	USD	95.867,72	0,03						
400.000	ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD 5.250% 15/11/2022	USD	404.513,28	0,12						

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## NN (L) US High Yield

(ausgedrückt in USD)

### Derivative Finanzinstrumente zum 31.03.2022 (Fortsetzung)

Stückzahl	Bezeichnung	Währung	Engagement in USD	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in USD
<b>Zins-Futures</b>				
(30)	EURO-BOBL FUTURE 08/06/2022	EUR	4.301.282,29	145.534,62
(22)	EURO-BUND FUTURE 08/06/2022	EUR	3.883.727,01	177.712,45
			<b>8.185.009,30</b>	<b>323.247,07</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>				<b>168.640,37</b>

### Nettovermögen zum 31.03.2022 im Überblick

		%
		NIW
<b>Wertpapierbestand Gesamt</b>	<b>302.805.725,38</b>	<b>92,70</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente Gesamt</b>	<b>168.640,37</b>	<b>0,05</b>
<b>Bankguthaben</b>	<b>16.730.930,51</b>	<b>5,12</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>	<b>6.955.748,32</b>	<b>2,13</b>
<b>Nettovermögen Gesamt</b>	<b>326.661.044,58</b>	<b>100,00</b>

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## Erläuterungen zu den Finanzabschlüssen

### 1- ALLGEMEINE INFORMATIONEN

NN (L) (die „Gesellschaft“ oder die „SICAV“ oder der „Fonds“) ist eine in Form einer Aktiengesellschaft (Société Anonyme) am 6. September 1993 auf unbestimmte Zeit gegründete „Société d'Investissement à Capital Variable“ (SICAV, Investmentgesellschaft mit variablem Kapital), die den Bestimmungen von Teil I des Luxemburger Gesetzes vom 17. Dezember 2010 über Organismen für gemeinsame Anlagen in geänderter Fassung unterliegt.

Die Gründungsurkunde und die Satzung der Gesellschaft wurden im „Mémorial C, Recueil Spécial des Sociétés et Associations“ (Amtsblatt) des Großherzogtums Luxemburg veröffentlicht und bei der Geschäftsstelle des „Tribunal d'Arrondissement“ (Bezirksgericht) in Luxemburg hinterlegt, wo sie eingesehen werden können und gegen Zahlung der Gerichtsgebühren Kopien erhältlich sind.

Die Gesellschaft ist im Registre de Commerce et des Sociétés (Handels- und Gesellschaftsregister) in Luxemburg unter der Nummer B 44 873 eingetragen.

Die Gesellschaft gibt derzeit folgende Anteilsklassen aus:

Bezeichnung der Anteilsklasse	Beschreibung
Capitalisation I	Thesaurierende Anteile für institutionelle Anleger.
Capitalisation I Hedged*	Für institutionelle Anleger bestimmte und auf eine andere Währung als die Referenzwährung des Teilfonds lautende thesaurierende Anteile. Diese Anteilsklasse verwendet Techniken zur Absicherung gegen die Referenzwährung des Teilfonds.
Capitalisation M	Institutionellen Anlegern vorbehaltene thesaurierende Anteile. Die Anteilsklasse unterscheidet sich von der Klasse „I“ durch ihre maximale Verwaltungsgebühr von 1,5% und ihre Zeichnungsgebühr von höchstens 5%. Sie wird durch verbundene Unternehmen der Verwaltungsgesellschaft oder nach Ermessen des Verwaltungsrats durch Vertriebsstellen und/oder in bestimmten Ländern, in denen die Marktbedingungen diese Gebührenstruktur erfordern, vertrieben.
Capitalisation N	Thesaurierende Anteile, die keine Rückvergütungen zahlen und für Privatanleger bestimmt sind, die ihr Wertpapierkonto in den Niederlanden bei einem regulierten niederländischen Finanzinstitut unterhalten. Die maximale Verwaltungsgebühr für die Anteilsklasse „N“ ist niedriger als die maximale Verwaltungsgebühr für die Anteilsklasse „P“. Die feste Servicegebühr für die Anteilsklasse „N“ entspricht derjenigen der Anteilsklasse „P“. Für diese Anteilsklassenart sind keine Zeichnungs- oder Umtauschgebühren zu zahlen.
Capitalisation N Hedged*	Für Privatanleger am niederländischen Markt bestimmte thesaurierende Anteile; diese Anteilsklasse zahlt keine Rückvergütungen und ist in einer anderen Währung als der Referenzwährung des Teilfonds denominiert. Die maximale Verwaltungsgebühr für die Anteilsklasse „N“ ist niedriger als die maximale Verwaltungsgebühr für die Anteilsklasse „P“. Die feste Servicegebühr für die Anteilsklasse „N“ entspricht derjenigen der Anteilsklasse „P“. Für diese Anteilsklassenart sind keine Zeichnungs- oder Umtauschgebühren zu zahlen. Diese Anteilsklasse verwendet Techniken zur Absicherung gegen die Referenzwährung des Teilfonds.
Capitalisation O	Thesaurierende Anteile für Privatanleger, die Kunden von Vertriebsstellen sind, die nach Ermessen der Verwaltungsgesellschaft eine Vereinbarung über die Anteilsklasse „O“ mit der Verwaltungsgesellschaft abgeschlossen haben, die Anlagen in die Gesellschaft seitens ihrer Kunden betrifft. Diese Anteilsklasse zahlt weder Retrozessionen noch Rückvergütungen. Die maximale Verwaltungsgebühr für die Anteilsklasse „O“ ist niedriger als die maximale Gebühr für die Anteilsklasse „P“. Die feste Servicegebühr für die Anteilsklasse „O“ entspricht derjenigen der Anteilsklasse „P“. Die maximale Zeichnungsgebühr und Umtauschgebühr der Anteilsklasse „O“ entspricht der maximalen Zeichnungsgebühr und Umtauschgebühr der Anteilsklasse „P“.
Capitalisation O Hedged*	Thesaurierende Anteile für Privatanleger, die Kunden von Vertriebsstellen sind, die nach Ermessen der Verwaltungsgesellschaft eine Vereinbarung über die Anteilsklasse „O“ mit der Verwaltungsgesellschaft abgeschlossen haben, die Anlagen in die Gesellschaft seitens ihrer Kunden betrifft. Diese Anteile lauten auf eine andere Währung als die Referenzwährung des Teilfonds. Diese Anteilsklasse zahlt weder Retrozessionen noch Rückvergütungen. Die maximale Verwaltungsgebühr für die Anteilsklasse „O“ ist niedriger als die maximale Gebühr für die Anteilsklasse „P“. Die feste Servicegebühr für die Anteilsklasse „O“ entspricht derjenigen der Anteilsklasse „P“. Die maximale Zeichnungsgebühr und Umtauschgebühr der Anteilsklasse „O“ entspricht der maximalen Zeichnungsgebühr und Umtauschgebühr der Anteilsklasse „P“. Diese Anteilsklasse verwendet Techniken zur Absicherung gegen die Referenzwährung des Teilfonds.
Capitalisation P	Thesaurierende Anteile für Privatanleger.
Capitalisation P Hedged*	Thesaurierende Anteile für Privatanleger, die auf eine andere Währung als die Referenzwährung des Teilfonds lauten. Diese Anteilsklasse verwendet Techniken zur Absicherung gegen die Referenzwährung des Teilfonds.

## Erläuterungen zu den Finanzabschlüssen (Fortsetzung)

Bezeichnung der Anteilsklasse	Beschreibung
Capitalisation Q	Institutionellen Anlegern vorbehaltene thesaurierende Anteile. Diese Anteilsklasse zahlt weder Retrozessionen noch Rückvergütungen. Die maximale Verwaltungsgebühr für die Anteilsklasse „Q“ ist niedriger als die maximale Gebühr für die Anteilsklasse „I“. Die feste Servicegebühr für die Anteilsklasse „Q“ entspricht derjenigen der Anteilsklasse „I“. Für diese Anteilsklassenart sind keine Zeichnungs- oder Umtauschgebühren zu zahlen.
Capitalisation R	Thesaurierende Anteile für Privatanleger, die sich an Kunden von Vertriebsstellen richten, die Anlageberatung auf Basis einer separaten Gebührenvereinbarung bieten. Diese Anteilsklasse zahlt keine Retrozessionen oder Rückvergütungen. Die maximale Verwaltungsgebühr für die Anteilsklasse „R“ ist niedriger als die maximale Verwaltungsgebühr für die Anteilsklasse „P“. Die feste Servicegebühr für die Anteilsklasse „R“ entspricht derjenigen der Anteilsklasse „P“. Die maximalen Zeichnungs- und Umtauschgebühren der Anteilsklasse „R“ entsprechen denjenigen der Anteilsklasse „P“.
Capitalisation R Hedged*	Thesaurierende Anteile für Privatanleger, die sich an Kunden von Vertriebsstellen richten, die Anlageberatung auf Basis einer separaten Gebührenvereinbarung bieten. Die Anteile lauten auf eine andere Währung als die Referenzwährung des Teilfonds. Diese Anteilsklasse zahlt keine Retrozessionen oder Rückvergütungen. Die maximale Verwaltungsgebühr für die Anteilsklasse „R“ ist niedriger als die maximale Verwaltungsgebühr für die Anteilsklasse „P“. Die feste Servicegebühr für die Anteilsklasse „R“ entspricht derjenigen der Anteilsklasse „P“. Die maximalen Zeichnungs- und Umtauschgebühren der Anteilsklasse „R“ entsprechen denjenigen der Anteilsklasse „P“. Diese Anteilsklasse verwendet Techniken zur Absicherung gegen die Referenzwährung des Teilfonds.
Capitalisation S	Thesaurierende Anteile für institutionelle wirtschaftliche Eigentümer mit einer Mindestzeichnung von EUR 1.000.000 oder dem Gegenwert; sie unterliegen einer Zeichnungssteuer auf das Nettovermögen von 0,05% pro Jahr.
Capitalisation T	Institutionellen Anlegern vorbehaltene thesaurierende Anteile. Die Anteilsklasse unterscheidet sich von der Klasse „I“ durch ihre niedrigere oder gleiche Verwaltungsgebühr und ihre Zeichnungsgebühr von höchstens 5%. Sie wird durch verbundene Unternehmen der Verwaltungsgesellschaft oder nach Ermessen des Verwaltungsrats durch Vertriebsstellen und/oder in bestimmten Ländern, in denen die Marktbedingungen diese Gebührenstruktur erfordern, vertrieben.
Capitalisation U	Thesaurierende Anteile, für die keine Rückvergütungen gezahlt werden und die ausgewählten institutionellen Anlegern mit Hauptsitz in der Schweiz im Rahmen einer Vermögensverwaltung vorbehalten sind, die eine spezielle U-Anteilsklassen-Vereinbarung mit der Verwaltungsgesellschaft nach deren Ermessen in Bezug auf ihre Anlagen in der Gesellschaft geschlossen haben. Die maximale Verwaltungsgebühr, das gegebenenfalls anfallende Erfolgshonorar und die feste Servicegebühr für die Anteilsklasse „U“ sind nicht höher als die maximale Verwaltungsgebühr, das gegebenenfalls anfallende Erfolgshonorar und die feste Servicegebühr für die Anteilsklasse „I“, die im jeweiligen Teilfonds-Factsheet näher beschrieben sind. Für diese Anteilsklassenart sind keine Zeichnungs- oder Umtauschgebühren zu zahlen.
Capitalisation U Hedged*	Thesaurierende Anteile, für die keine Rückvergütungen gezahlt werden und die ausgewählten institutionellen Anlegern mit Hauptsitz in der Schweiz im Rahmen einer Vermögensverwaltung vorbehalten sind, die eine spezielle U-Anteilsklassen-Vereinbarung mit der Verwaltungsgesellschaft nach deren Ermessen in Bezug auf ihre Anlagen in der Gesellschaft geschlossen haben. Die maximale Verwaltungsgebühr, das gegebenenfalls anfallende Erfolgshonorar und die feste Servicegebühr für die Anteilsklasse „U“ sind nicht höher als die maximale Verwaltungsgebühr, das gegebenenfalls anfallende Erfolgshonorar und die feste Servicegebühr für die Anteilsklasse „I“, die im jeweiligen Teilfonds-Factsheet näher beschrieben sind. Für diese Anteilsklassenart sind keine Zeichnungs- oder Umtauschgebühren zu zahlen. Die Anteilsklasse lautet auf eine andere Währung als die Referenzwährung des Teilfonds. Diese Anteilsklasse verwendet Techniken zur Absicherung gegen die Referenzwährung des Teilfonds.
Capitalisation V	Für institutionelle Anleger bestimmte thesaurierende Anteile. Die Anteilsklasse unterscheidet sich von der Anteilsklasse „I“ durch ihre höhere Verwaltungsgebühr.
Capitalisation X	Thesaurierende Anteile für Privatanleger. Diese Klasse unterscheidet sich von der Anteilsklasse „P“ dadurch, dass die Verwaltungsgebühr höher ist, weil die Anteile in Ländern vertrieben werden, in denen die Marktbedingungen eine höhere Gebühr erfordern.
Capitalisation X Hedged*	Thesaurierende Anteile für Privatanleger. Diese Klasse unterscheidet sich von der Anteilsklasse „P“ dadurch, dass die Verwaltungsgebühr höher ist, weil die Anteile in Ländern vertrieben werden, in denen die Marktbedingungen eine höhere Gebühr erfordern. Die Anteile lauten auf eine andere Währung als die Referenzwährung des Teilfonds. Diese Anteilsklasse verwendet Techniken zur Absicherung gegen die Referenzwährung des Teilfonds.

## Erläuterungen zu den Finanzabschlüssen (Fortsetzung)

Bezeichnung der Anteilsklasse	Beschreibung
Capitalisation Y	Für Privatanleger bestimmte thesaurierende Anteile, die sich an Kunden von Vertriebsstellen richten, die mit der Verwaltungsgesellschaft bestimmte Vertriebsvereinbarungen abgeschlossen haben; die Anteilsklasse unterliegt einer bedingt aufgeschobenen Verkaufsgebühr („Contingent Deferred Sales Charge“, CDSC). Die Anteilsklasse unterscheidet sich jedoch von der Anteilsklasse „X“ dahingehend, dass für sie eine zusätzliche Vertriebsgebühr von 1% erhoben wird. Für diese Anteile sind keine Zeichnungsgebühren zu zahlen.
Capitalisation Y Hedged*	Für Privatanleger bestimmte thesaurierende Anteile, die sich an Kunden von Vertriebsstellen richten, die mit der Verwaltungsgesellschaft bestimmte Vertriebsvereinbarungen abgeschlossen haben; die Anteilsklasse unterliegt einer bedingt aufgeschobenen Verkaufsgebühr („Contingent Deferred Sales Charge“, CDSC). Die Anteilsklasse unterscheidet sich jedoch von der Anteilsklasse „X“ dahingehend, dass für sie eine zusätzliche Vertriebsgebühr von 1% erhoben wird, und dass sie auf eine andere Währung als die Referenzwährung des Teilfonds lautet. Für diese Anteile sind keine Zeichnungsgebühren zu zahlen. Diese Anteilsklasse verwendet Techniken zur Absicherung gegen die Referenzwährung des Teilfonds.
Capitalisation Z	Für institutionelle Anleger bestimmte thesaurierende Anteile, die nach Ermessen der Verwaltungsgesellschaft neben der Zeichnungsvereinbarung in Verbindung mit ihrer Anlage in dem Fonds eine besondere Verwaltungsvereinbarung („Sondervereinbarung“) geschlossen haben. Für diese Anteilsklasse wird die Verwaltungsgebühr gemäß der Sondervereinbarung durch die Verwaltungsgesellschaft direkt beim Anteilsinhaber erhoben und eingezogen. Für Anlagen in diese Anteilsklasse gilt ein Mindestbestand von EUR 5.000.000 oder dem Gegenwert in einer anderen Währung.
Capitalisation Z Hedged*	Für institutionelle Anleger bestimmte thesaurierende Anteile, die nach Ermessen der Verwaltungsgesellschaft neben der Zeichnungsvereinbarung in Verbindung mit ihrer Anlage in dem Fonds eine besondere Verwaltungsvereinbarung („Sondervereinbarung“) geschlossen haben. Die Anteile lauten auf eine andere Währung als die Referenzwährung des Teilfonds. Für diese Anteilsklasse wird die Verwaltungsgebühr gemäß der Sondervereinbarung durch die Verwaltungsgesellschaft direkt beim Anteilsinhaber erhoben und eingezogen. Für Anlagen in diese Anteilsklasse gilt ein Mindestbestand von EUR 5.000.000 oder dem Gegenwert in einer anderen Währung. Diese Anteilsklasse verwendet Techniken zur Absicherung gegen die Referenzwährung des Teilfonds.
Capitalisation Zz	Institutionellen Anlegern vorbehaltene thesaurierende Anteile, die sich von Anteilen der Anteilsklasse „Z“ dadurch unterscheiden, dass die Verwaltungsgesellschaft eine die Verwaltungsgebühr abdeckende Servicegebühr für die Fondsverwaltung, die Servicegebühr und etwaige andere Gebühren direkt von den Anteilseignern gemäß den Bestimmungen der Vereinbarung zu den Fondsverwaltungsdienstleistungen („Vereinbarung zu den Fondsverwaltungsdienstleistungen“) erhebt und einzieht, die mit der Verwaltungsgesellschaft nach deren Ermessen abgeschlossen wurde.
Capitalisation Zz Hedged*	Institutionellen Anlegern vorbehaltene thesaurierende Anteile, die sich von Anteilen der Anteilsklasse „Z“ dadurch unterscheiden, dass die Verwaltungsgesellschaft eine die Verwaltungsgebühr abdeckende Servicegebühr für die Fondsverwaltung, die Servicegebühr und etwaige andere Gebühren direkt von den Anteilseignern gemäß den Bestimmungen der Vereinbarung zu den Fondsverwaltungsdienstleistungen („Vereinbarung zu den Fondsverwaltungsdienstleistungen“) erhebt und einzieht, die mit der Verwaltungsgesellschaft nach deren Ermessen abgeschlossen wurde, und dass diese auf eine andere Währung als die Referenzwährung des Teilfonds lauten. Diese Anteilsklasse verwendet Techniken zur Absicherung gegen die Referenzwährung des Teilfonds.
Distribution D (Q)	Für Privatanleger am niederländischen Markt bestimmte ausschüttende Anteilsklasse - vierteljährliche Ausschüttung. Für diese Anteile sind keine Zeichnungs- oder Umtauschgebühren zu zahlen.
Distribution I	Ausschüttende Anteile für institutionelle Anleger.
Distribution I Hedged*	Für institutionelle Anleger bestimmte und auf eine andere Währung als die Referenzwährung des Teilfonds lautende ausschüttende Anteile. Diese Anteilsklasse verwendet Techniken zur Absicherung gegen die Referenzwährung des Teilfonds.
Distribution I (HY) Hedged*	Für institutionelle Anleger bestimmte und auf eine andere Währung als die Referenzwährung des Teilfonds lautende ausschüttende Anteile – halbjährliche Ausschüttung. Diese Anteilsklasse verwendet Techniken zur Absicherung gegen die Referenzwährung des Teilfonds.
Distribution I (M)	Ausschüttende Anteile für institutionelle Anleger - monatliche Ausschüttung.
Distribution I (M) Hedged*	Für institutionelle Anleger bestimmte und auf eine andere Währung als die Referenzwährung des Teilfonds lautende ausschüttende Anteile – monatliche Ausschüttung. Diese Anteilsklasse verwendet Techniken zur Absicherung gegen die Referenzwährung des Teilfonds.



## Erläuterungen zu den Finanzabschlüssen (Fortsetzung)

Bezeichnung der Anteilsklasse	Beschreibung
Distribution I (Q)	Ausschüttende Anteile für institutionelle Anleger - vierteljährliche Ausschüttung.
Distribution I (Q) Hedged*	Für institutionelle Anleger bestimmte und auf eine andere Währung als die Referenzwährung des Teilfonds lautende ausschüttende Anteile – vierteljährliche Ausschüttung. Diese Anteilsklasse verwendet Techniken zur Absicherung gegen die Referenzwährung des Teilfonds.
Distribution N	Ausschüttende Anteile, die keine Rückvergütungen zahlen und für Privatanleger bestimmt sind, die ihr Wertpapierkonto in den Niederlanden bei einem regulierten niederländischen Finanzinstitut unterhalten. Die maximale Verwaltungsgebühr für die Anteilsklasse „N“ ist niedriger als die maximale Verwaltungsgebühr für die Anteilsklasse „P“. Die feste Servicegebühr für die Anteilsklasse „N“ entspricht derjenigen der Anteilsklasse „P“. Für diese Anteilsklassenart sind keine Zeichnungs- oder Umtauschgebühren zu zahlen.
Distribution N Hedged*	Für Privatanleger am niederländischen Markt bestimmte und auf eine andere Währung als die Referenzwährung des Teilfonds lautende ausschüttende Anteile; diese Anteilsklasse zahlt keine Rückvergütungen. Die maximale Verwaltungsgebühr für die Anteilsklasse „N“ ist niedriger als die maximale Verwaltungsgebühr für die Anteilsklasse „P“. Die feste Servicegebühr für die Anteilsklasse „N“ entspricht derjenigen der Anteilsklasse „P“. Für diese Anteilsklassenart sind keine Zeichnungs- oder Umtauschgebühren zu zahlen. Diese Anteilsklasse verwendet Techniken zur Absicherung gegen die Referenzwährung des Teilfonds.
Distribution N (Q)	Für Privatanleger am niederländischen Markt bestimmte ausschüttende Anteile; diese Anteilsklasse zahlt keine Rückvergütungen. Die maximale Verwaltungsgebühr für die Anteilsklasse „N“ ist niedriger als die maximale Verwaltungsgebühr für die Anteilsklasse „P“. Die feste Servicegebühr für die Anteilsklasse „N“ entspricht derjenigen der Anteilsklasse „P“ – vierteljährliche Ausschüttung. Für diese Anteilsklassenart sind keine Zeichnungs- oder Umtauschgebühren zu zahlen.
Distribution N (Q) Hedged*	Für Privatanleger am niederländischen Markt bestimmte und auf eine andere Währung als die Referenzwährung des Teilfonds lautende ausschüttende Anteile; diese Anteilsklasse zahlt keine Rückvergütungen. Die maximale Verwaltungsgebühr für die Anteilsklasse „N“ ist niedriger als die maximale Verwaltungsgebühr für die Anteilsklasse „P“. Die feste Servicegebühr für die Anteilsklasse „N“ entspricht derjenigen der Anteilsklasse „P“ – vierteljährliche Ausschüttung. Für diese Anteilsklassenart sind keine Zeichnungs- oder Umtauschgebühren zu zahlen. Diese Anteilsklasse verwendet Techniken zur Absicherung gegen die Referenzwährung des Teilfonds.
Distribution O	Ausschüttende Anteile für Privatanleger, die Kunden von Vertriebsstellen sind, die nach Ermessen der Verwaltungsgesellschaft eine Vereinbarung über die Anteilsklasse „O“ mit der Verwaltungsgesellschaft abgeschlossen haben, die Anlagen in die Gesellschaft seitens ihrer Kunden betrifft. Diese Anteilsklasse zahlt weder Retrozessionen noch Rückvergütungen. Die maximale Verwaltungsgebühr für die Anteilsklasse „O“ ist niedriger als die maximale Gebühr für die Anteilsklasse „P“. Die feste Servicegebühr für die Anteilsklasse „O“ entspricht derjenigen der Anteilsklasse „P“. Die maximale Zeichnungsgebühr und Umtauschgebühr der Anteilsklasse „O“ entspricht der maximalen Zeichnungsgebühr und Umtauschgebühr der Anteilsklasse „P“.
Distribution O Hedged*	Ausschüttende Anteile für Privatanleger, die Kunden von Vertriebsstellen sind, die nach Ermessen der Verwaltungsgesellschaft eine Vereinbarung über die Anteilsklasse „O“ mit der Verwaltungsgesellschaft abgeschlossen haben, die Anlagen in die Gesellschaft seitens ihrer Kunden betrifft. Diese Anteile lauten auf eine andere Währung als die Referenzwährung des Teilfonds. Diese Anteilsklasse zahlt weder Retrozessionen noch Rückvergütungen. Die maximale Verwaltungsgebühr für die Anteilsklasse „O“ ist niedriger als die maximale Gebühr für die Anteilsklasse „P“. Die feste Servicegebühr für die Anteilsklasse „O“ entspricht derjenigen der Anteilsklasse „P“. Die maximale Zeichnungsgebühr und Umtauschgebühr der Anteilsklasse „O“ entspricht der maximalen Zeichnungsgebühr und Umtauschgebühr der Anteilsklasse „P“. Diese Anteilsklasse verwendet Techniken zur Absicherung gegen die Referenzwährung des Teilfonds.
Distribution O (Q)	Ausschüttende Anteile für Privatanleger, die Kunden von Vertriebsstellen sind, die nach Ermessen der Verwaltungsgesellschaft eine Vereinbarung über die Anteilsklasse „O“ mit der Verwaltungsgesellschaft abgeschlossen haben, die Anlagen in die Gesellschaft seitens ihrer Kunden betrifft. Diese Anteilsklasse zahlt weder Retrozessionen noch Rückvergütungen. Die maximale Verwaltungsgebühr für die Anteilsklasse „O“ ist niedriger als die maximale Gebühr für die Anteilsklasse „P“. Die feste Servicegebühr für die Anteilsklasse „O“ entspricht derjenigen der Anteilsklasse „P“. Die maximale Zeichnungsgebühr und die Umtauschgebühr der Anteilsklasse „O“ entspricht der maximalen Zeichnungsgebühr und der Umtauschgebühr der Anteilsklasse „P“ - vierteljährliche Ausschüttung.
Distribution P	Ausschüttende Anteile für Privatanleger.
Distribution P Hedged*	Für Privatanleger bestimmte und auf eine andere Währung als die Referenzwährung des Teilfonds lautende ausschüttende Anteile. Diese Anteilsklasse verwendet Techniken zur Absicherung gegen die Referenzwährung des Teilfonds.
Distribution P (M)	Ausschüttende Anteile für Privatanleger - monatliche Ausschüttung.

## Erläuterungen zu den Finanzabschlüssen (Fortsetzung)

Bezeichnung der Anteilsklasse	Beschreibung
Distribution P (M) Hedged*	Für Privatanleger bestimmte und auf eine andere Währung als die Referenzwährung des Teilfonds lautende ausschüttende Anteile - monatliche Ausschüttung. Diese Anteilsklasse verwendet Techniken zur Absicherung gegen die Referenzwährung des Teilfonds.
Distribution P (Q)	Ausschüttende Anteile für Privatanleger - vierteljährliche Ausschüttung.
Distribution R	Ausschüttende Anteile für Privatanleger, die sich an Kunden von Vertriebsstellen richten, die Anlageberatung auf Basis einer separaten Gebührenvereinbarung bieten. Diese Anteilsklasse zahlt keine Retrozessionen oder Rückvergütungen. Die maximale Verwaltungsgebühr für die Anteilsklasse „R“ ist niedriger als die maximale Verwaltungsgebühr für die Anteilsklasse „P“. Die feste Servicegebühr für die Anteilsklasse „R“ entspricht derjenigen der Anteilsklasse „P“. Die maximalen Zeichnungs- und Umtauschgebühren der Anteilsklasse „R“ entsprechen denjenigen der Anteilsklasse „P“.
Distribution R Hedged*	Ausschüttende Anteile für Privatanleger, die sich an Kunden von Vertriebsstellen richten, die Anlageberatung auf Basis einer separaten Gebührenvereinbarung bieten. Die Anteile lauten auf eine andere Währung als die Referenzwährung des Teilfonds. Diese Anteilsklasse zahlt keine Retrozessionen oder Rückvergütungen. Die maximale Verwaltungsgebühr für die Anteilsklasse „R“ ist niedriger als die maximale Verwaltungsgebühr für die Anteilsklasse „P“. Die feste Servicegebühr für die Anteilsklasse „R“ entspricht derjenigen der Anteilsklasse „P“. Die maximalen Zeichnungs- und Umtauschgebühren der Anteilsklasse „R“ entsprechen denjenigen der Anteilsklasse „P“. Diese Anteilsklasse verwendet Techniken zur Absicherung gegen die Referenzwährung des Teilfonds.
Distribution R (Q)	Ausschüttende Anteile für Privatanleger, die sich an Kunden von Vertriebsstellen richten, die Anlageberatung auf Basis einer separaten Gebührenvereinbarung bieten. Diese Anteilsklasse zahlt keine Retrozessionen oder Rückvergütungen. Die maximale Verwaltungsgebühr für die Anteilsklasse „R“ ist niedriger als die maximale Verwaltungsgebühr für die Anteilsklasse „P“. Die feste Servicegebühr für die Anteilsklasse „R“ entspricht derjenigen der Anteilsklasse „P“. Die maximalen Zeichnungs- und Umtauschgebühren der Anteilsklasse „R“ entsprechen denjenigen der Anteilsklasse „P“ - vierteljährliche Ausschüttung.
Distribution T	Institutionellen Anlegern vorbehaltene ausschüttende Anteile. Die Anteilsklasse unterscheidet sich von der Klasse „I“ durch ihre niedrigere oder gleiche Verwaltungsgebühr und ihre Zeichnungsgebühr von höchstens 5%. Sie wird durch verbundene Unternehmen der Verwaltungsgesellschaft oder nach Ermessen des Verwaltungsrats durch Vertriebsstellen und/oder in bestimmten Ländern, in denen die Marktbedingungen diese Gebührenstruktur erfordern, vertrieben.
Distribution U (M)	Ausschüttende Anteile, für die keine Rückvergütungen gezahlt werden und die ausgewählten institutionellen Anlegern mit Hauptsitz in der Schweiz im Rahmen einer Vermögensverwaltung vorbehalten sind, die eine spezielle U-Anteilsklassen-Vereinbarung mit der Verwaltungsgesellschaft nach deren Ermessen in Bezug auf ihre Anlagen in der Gesellschaft geschlossen haben. Die maximale Verwaltungsgebühr, das gegebenenfalls anfallende Erfolgshonorar und die feste Servicegebühr für die Anteilsklasse „U“ sind nicht höher als die maximale Verwaltungsgebühr, das gegebenenfalls anfallende Erfolgshonorar und die feste Servicegebühr für die Anteilsklasse „I“, die im jeweiligen Teilfonds-Factsheet näher beschrieben sind. Für diese Anteilsklassenart sind keine Zeichnungs- oder Umtauschgebühren zu zahlen - monatliche Ausschüttung.
Distribution U (Q)	Ausschüttende Anteile, für die keine Rückvergütungen gezahlt werden und die ausgewählten institutionellen Anlegern mit Hauptsitz in der Schweiz im Rahmen einer Vermögensverwaltung vorbehalten sind, die eine spezielle U-Anteilsklassen-Vereinbarung mit der Verwaltungsgesellschaft nach deren Ermessen in Bezug auf ihre Anlagen in der Gesellschaft geschlossen haben. Die maximale Verwaltungsgebühr, das gegebenenfalls anfallende Erfolgshonorar und die feste Servicegebühr für die Anteilsklasse „U“ sind nicht höher als die maximale Verwaltungsgebühr, das gegebenenfalls anfallende Erfolgshonorar und die feste Servicegebühr für die Anteilsklasse „I“, die im jeweiligen Teilfonds-Factsheet näher beschrieben sind. Für diese Anteilsklassenart sind keine Zeichnungs- oder Umtauschgebühren zu zahlen - vierteljährliche Ausschüttung.
Distribution X	Ausschüttende Anteile für Privatanleger. Diese Klasse unterscheidet sich von der Anteilsklasse „P“ dadurch, dass die Verwaltungsgebühr höher ist, weil die Anteile in Ländern vertrieben werden, in denen die Marktbedingungen eine höhere Gebühr erfordern.
Distribution X Hedged*	Ausschüttende Anteile für Privatanleger. Diese Klasse unterscheidet sich von der Anteilsklasse „P“ dadurch, dass die Verwaltungsgebühr höher ist, weil die Anteile in Ländern vertrieben werden, in denen die Marktbedingungen eine höhere Gebühr erfordern. Die Anteile lauten auf eine andere Währung als die Referenzwährung des Teilfonds. Diese Anteilsklasse verwendet Techniken zur Absicherung gegen die Referenzwährung des Teilfonds.



## Erläuterungen zu den Finanzabschlüssen (Fortsetzung)

Bezeichnung der Anteilsklasse	Beschreibung
Distribution X (M)	Ausschüttende Anteile für Privatanleger - monatliche Ausschüttung. Diese Anteilsklasse unterscheidet sich von der Anteilsklasse „P“ dadurch, dass die Verwaltungsgebühr höher ist, weil die Anteile in Ländern vertrieben werden, in denen die Marktbedingungen eine höhere Gebühr erfordern.
Distribution X (M) Hedged*	Ausschüttende Anteile für Privatanleger - monatliche Ausschüttung. Diese Anteilsklasse unterscheidet sich von der Anteilsklasse „P“ dadurch, dass die Verwaltungsgebühr höher ist, weil die Anteile in Ländern vertrieben werden, in denen die Marktbedingungen eine höhere Gebühr erfordern. Die Anteile lauten auf eine andere Währung als die Referenzwährung des Teilfonds. Diese Anteilsklasse verwendet Techniken zur Absicherung gegen die Referenzwährung des Teilfonds.
Distribution X (Q)	Für Privatanleger bestimmte ausschüttende Anteile - vierteljährliche Ausschüttung. Diese Anteilsklasse unterscheidet sich von der Anteilsklasse „P“ dadurch, dass die Verwaltungsgebühr höher ist, weil die Anteile in Ländern vertrieben werden, in denen die Marktbedingungen eine höhere Gebühr erfordern.
Distribution X (Q) Hedged*	Für Privatanleger bestimmte ausschüttende Anteile - vierteljährliche Ausschüttung. Diese Anteilsklasse unterscheidet sich von der Anteilsklasse „P“ dadurch, dass die Verwaltungsgebühr höher ist, weil die Anteile in Ländern vertrieben werden, in denen die Marktbedingungen eine höhere Gebühr erfordern. Die Anteile lauten auf eine andere Währung als die Referenzwährung des Teilfonds. Diese Anteilsklasse verwendet Techniken zur Absicherung gegen die Referenzwährung des Teilfonds.
Distribution Y (M)	Für Privatanleger bestimmte ausschüttende Anteile - monatliche Ausschüttung. Diese Anteilsklasse richtet sich an Kunden von Vertriebsstellen, die mit der Verwaltungsgesellschaft bestimmte Vertriebsvereinbarungen abgeschlossen haben; die Anteilsklasse unterliegt einer bedingt aufgeschobenen Verkaufsgebühr („Contingent Deferred Sales Charge“, CDSC). Die Anteilsklasse unterscheidet sich jedoch von der Anteilsklasse „X“ dahingehend, dass für sie eine zusätzliche Vertriebsgebühr von 1% erhoben wird. Für diese Anteile sind keine Zeichnungsgebühren zu zahlen.
Distribution Y (M) Hedged*	Für Privatanleger bestimmte ausschüttende Anteile - monatliche Ausschüttung. Diese Anteilsklasse richtet sich an Kunden von Vertriebsstellen, die mit der Verwaltungsgesellschaft bestimmte Vertriebsvereinbarungen abgeschlossen haben; die Anteilsklasse unterliegt einer bedingt aufgeschobenen Verkaufsgebühr („Contingent Deferred Sales Charge“, CDSC). Die Anteilsklasse unterscheidet sich jedoch von der Anteilsklasse „X“ dahingehend, dass für sie eine zusätzliche Vertriebsgebühr von 1% erhoben wird, und dass sie auf eine andere Währung als die Referenzwährung des Teilfonds lautet. Für diese Anteile sind keine Zeichnungsgebühren zu zahlen. Diese Anteilsklasse verwendet Techniken zur Absicherung gegen die Referenzwährung des Teilfonds.
Distribution Z	Für institutionelle Anleger bestimmte ausschüttende Anteile, die nach Ermessen der Verwaltungsgesellschaft neben der Zeichnungsvereinbarung in Verbindung mit ihrer Anlage in dem Fonds eine besondere Verwaltungsvereinbarung („Sondervereinbarung“) geschlossen haben. Für diese Anteilsklasse wird die Verwaltungsgebühr gemäß der Sondervereinbarung durch die Verwaltungsgesellschaft direkt beim Anteilsinhaber erhoben und eingezogen. Für Anlagen in diese Anteilsklasse gilt ein Mindestbestand von EUR 5.000.000 oder dem Gegenwert in einer anderen Währung.
Distribution Z Hedged*	Für institutionelle Anleger bestimmte ausschüttende Anteile, die nach Ermessen der Verwaltungsgesellschaft neben der Zeichnungsvereinbarung in Verbindung mit ihrer Anlage in dem Fonds eine besondere Verwaltungsvereinbarung („Sondervereinbarung“) geschlossen haben. Die Anteile lauten auf eine andere Währung als die Referenzwährung des Teilfonds. Für diese Anteilsklasse wird die Verwaltungsgebühr gemäß der Sondervereinbarung durch die Verwaltungsgesellschaft direkt beim Anteilsinhaber erhoben und eingezogen. Für Anlagen in diese Anteilsklasse gilt ein Mindestbestand von EUR 5.000.000 oder dem Gegenwert in einer anderen Währung. Diese Anteilsklasse verwendet Techniken zur Absicherung gegen die Referenzwährung des Teilfonds.
Distribution Z (HY) Hedged*	Für institutionelle Anleger bestimmte ausschüttende Anteile, die nach Ermessen der Verwaltungsgesellschaft neben der Zeichnungsvereinbarung in Verbindung mit ihrer Anlage in dem Fonds eine besondere Verwaltungsvereinbarung („Sondervereinbarung“) geschlossen haben. Die Anteile lauten auf eine andere Währung als die Referenzwährung des Teilfonds - halbjährliche Ausschüttung. Für diese Anteilsklasse wird die Verwaltungsgebühr gemäß der Sondervereinbarung durch die Verwaltungsgesellschaft direkt beim Anteilsinhaber erhoben und eingezogen. Für Anlagen in diese Anteilsklasse gilt ein Mindestbestand von EUR 5.000.000 oder dem Gegenwert in einer anderen Währung. Diese Anteilsklasse verwendet Techniken zur Absicherung gegen die Referenzwährung des Teilfonds.

## Erläuterungen zu den Finanzabschlüssen (Fortsetzung)

Bezeichnung der Anteilsklasse	Beschreibung
Distribution Z (M) Hedged*	Für institutionelle Anleger bestimmte ausschüttende Anteile, die nach Ermessen der Verwaltungsgesellschaft neben der Zeichnungsvereinbarung in Verbindung mit ihrer Anlage in dem Fonds eine besondere Verwaltungsvereinbarung („Sondervereinbarung“) geschlossen haben. Die Anteile lauten auf eine andere Währung als die Referenzwährung des Teilfonds - monatliche Ausschüttung. Für diese Anteilsklasse wird die Verwaltungsgebühr gemäß der Sondervereinbarung durch die Verwaltungsgesellschaft direkt beim Anteilsinhaber erhoben und eingezogen. Für Anlagen in diese Anteilsklasse gilt ein Mindestbestand von EUR 5.000.000 oder dem Gegenwert in einer anderen Währung. Diese Anteilsklasse verwendet Techniken zur Absicherung gegen die Referenzwährung des Teilfonds.
Distribution Z (Q) Hedged*	Für institutionelle Anleger bestimmte ausschüttende Anteile, die nach Ermessen der Verwaltungsgesellschaft neben der Zeichnungsvereinbarung in Verbindung mit ihrer Anlage in dem Fonds eine besondere Verwaltungsvereinbarung („Sondervereinbarung“) geschlossen haben. Die Anteile lauten auf eine andere Währung als die Referenzwährung des Teilfonds - vierteljährliche Ausschüttung. Für diese Anteilsklasse wird die Verwaltungsgebühr gemäß der Sondervereinbarung durch die Verwaltungsgesellschaft direkt beim Anteilsinhaber erhoben und eingezogen. Für Anlagen in diese Anteilsklasse gilt ein Mindestbestand von EUR 5.000.000 oder dem Gegenwert in einer anderen Währung. Diese Anteilsklasse verwendet Techniken zur Absicherung gegen die Referenzwährung des Teilfonds.
Distribution Zz	Institutionellen Anlegern vorbehaltene ausschüttende Anteile, die sich von Anteilen der Anteilsklasse „Z“ dadurch unterscheiden, dass die Verwaltungsgesellschaft eine die Verwaltungsgebühr abdeckende Servicegebühr für die Fondsverwaltung, die Servicegebühr und etwaige andere Gebühren direkt von den Anteilseignern gemäß den Bestimmungen der Vereinbarung zu den Fondsverwaltungsdienstleistungen („Vereinbarung zu den Fondsverwaltungsdienstleistungen“) erhebt und einzieht, die mit der Verwaltungsgesellschaft nach deren Ermessen abgeschlossen wurde, und dass diese auf eine andere Währung als die Referenzwährung des Teilfonds lauten.
Distribution Zz Hedged*	Institutionellen Anlegern vorbehaltene ausschüttende Anteile, die sich von Anteilen der Anteilsklasse „Z“ dadurch unterscheiden, dass die Verwaltungsgesellschaft eine die Verwaltungsgebühr abdeckende Servicegebühr für die Fondsverwaltung, die Servicegebühr und etwaige andere Gebühren direkt von den Anteilseignern gemäß den Bestimmungen der Vereinbarung zu den Fondsverwaltungsdienstleistungen („Vereinbarung zu den Fondsverwaltungsdienstleistungen“) erhebt und einzieht, die mit der Verwaltungsgesellschaft nach deren Ermessen abgeschlossen wurde, und dass diese auf eine andere Währung als die Referenzwährung des Teilfonds lauten. Diese Anteilsklasse verwendet Techniken zur Absicherung gegen die Referenzwährung des Teilfonds.

\*Beabsichtigt ist, den Wert des Nettovermögens teilweise oder vollständig in der Referenzwährung des Teilfonds abzusichern oder das Währungsrisiko einiger (jedoch nicht notwendigerweise aller) Vermögenswerte des betreffenden Teilfonds entweder gegen die Referenzwährung der Anteilsklasse mit Währungsabsicherung oder gegen eine andere Währung abzusichern. Es ist allgemein beabsichtigt, diese Absicherung durch den Einsatz verschiedener derivativer Finanzinstrumente zu erreichen, einschließlich unter anderem außerbörslicher („OTC“) Devisenterminkontrakte und Devisen-Swappgeschäfte. Aus solchen Absicherungsgeschäften entstandene Gewinne und Verluste werden der/den entsprechenden Anteilsklasse(n) mit Währungsabsicherung zugerechnet.

Zu den Techniken, die für die Absicherung einer Anteilsklasse verwendet werden, können folgende gehören:

- i. Absicherungsgeschäfte zur Reduzierung der Auswirkungen von Wechselkursschwankungen zwischen der Währung, auf die die Anteilsklasse lautet, und der Referenzwährung des betreffenden Teilfonds („Basiswährungsabsicherung“);
- ii. Absicherungsgeschäfte zur Reduzierung der Auswirkungen von Wechselkursschwankungen zwischen der Währungsposition, die sich aus dem Bestand des entsprechenden Teilfonds ergibt, und der Währung, auf welche die Anteilsklasse lautet, („Portfolioabsicherung auf Anteilsklassenebene“);
- iii. Absicherungsgeschäfte zur Reduzierung der Auswirkungen von Wechselkursschwankungen zwischen der Währungsposition, die sich aus dem Bestand der relevanten Benchmark ergibt, und der Währung, auf welche die Anteilsklasse lautet, („Benchmarkabsicherung auf Anteilsklassenebene“);

## Erläuterungen zu den Finanzabschlüssen

iv. Absicherungsgeschäfte zur Reduzierung der Auswirkungen von Wechselkursschwankungen auf Basis der Korrelationen zwischen den Währungen, die sich aus dem Bestand des entsprechenden Teilfonds ergeben, und der Währung, auf welche die Anteilsklasse lautet, („Proxyabsicherung auf Anteilsklassenebene“).

Anleger werden darauf hingewiesen, dass nicht jede Anteilsklasse von jedem Teilfonds der Gesellschaft angeboten wird.

### Anlagepolitik

Die Anlagepolitik der einzelnen Teilfonds wird im Verkaufsprospekt ausführlich beschrieben. Letzterer ist bei der Depotbank sowie am eingetragenen Sitz der Gesellschaft und bei den im vorliegenden Bericht aufgeführten lokalen Vertriebsstellen oder Hauptsprechpartnern in der Kundenbetreuung erhältlich. Darüber hinaus wird er auf Anfrage kostenlos versandt.

Die nachfolgend genannten Teilfonds sind in andere Teilfonds des Fonds investiert. Zum 31. März 2022 betrifft dies folgende Anlagen:

Investierender Teilfonds	Investierter Teilfonds	Anlage zum Marktwert per 31. März 2022
NN (L) Emerging Markets Debt (Hard Currency)	NN (L) Asian Debt (Hard Currency)	7.354.480,00 USD
NN (L) Emerging Markets Debt (Hard Currency)	NN (L) Emerging Markets Corporate Debt	91.208.280,43 USD
NN (L) Emerging Markets Debt (Hard Currency)	NN (L) Emerging Markets Debt Short Duration (Hard Currency)	88.999.000,97 USD
NN (L) Emerging Markets Debt (Hard Currency)	NN (L) Frontier Markets Debt (Hard Currency)	204.047.875,39 USD
NN (L) Emerging Markets Debt (Local Currency)	NN (L) Emerging Markets Debt Short Duration (Hard Currency)	2.670.930,79 USD
NN (L) Euro Fixed Income	NN (L) AAA ABS	53.312.299,70 EUR
NN (L) Euro Fixed Income	NN (L) European ABS	27.052.509,36 EUR
NN (L) Euro Long Duration Bond	NN (L) European ABS	19.335.677,52 EUR
NN (L) First Class Yield Opportunities	NN (L) First Class Stable Yield Opportunities	18.412.497,60 EUR
NN (L) Global Convertible Opportunities	NN (L) Global Convertible Bond	26.106.590,00 USD
NN (L) Global High Yield	NN (L) Asian High Yield	45.167.722,55 EUR
NN (L) Global High Yield	NN (L) European High Yield	45.380.026,30 EUR
NN (L) Global High Yield	NN (L) US High Yield	105.498.432,59 EUR
NN (L) Multi Asset High Income	NN (L) Emerging Markets Corporate Debt	335.763,38 EUR
NN (L) Multi Asset High Income	NN (L) Emerging Markets Debt (Hard Currency)	194.572,53 EUR
NN (L) Multi Asset High Income	NN (L) Emerging Markets Enhanced Index Sustainable Equity	256.519,42 EUR
NN (L) Multi Asset High Income	NN (L) European ABS	283.106,88 EUR
NN (L) Multi Asset High Income	NN (L) European High Dividend	705.885,56 EUR
NN (L) Multi Asset High Income	NN (L) Global Enhanced Index Sustainable Equity	493.066,78 EUR
NN (L) Multi Asset High Income	NN (L) Global High Yield	978.916,96 EUR
NN (L) Multi Asset High Income	NN (L) Global Sustainable Equity	853.740,88 EUR
NN (L) Multi Asset High Income	NN (L) US High Yield	118.670,90 EUR

Der konsolidierte Abschluss wird auf Grundlage der Zusammenfassung der Abschlüsse der einzelnen Teilfonds ohne Abzug etwaiger Überkreuzbeteiligungen berechnet. Zum 31. März 2022 machten die Überkreuzbeteiligungen innerhalb des Fonds 696.204.569,76 EUR oder 1,95% des aufaddierten Nettovermögens aus. Die Anlage beim Fonds NN (L) Liquid wurde in der Tabelle nicht berücksichtigt, da er nicht zu den NN (L)-Teilfonds gehört.

### Änderungen

Seit dem Ausbruch des Kriegs zwischen Russland und der Ukraine am 24. Februar 2022 schürten die gegen Russland verhängten internationalen wirtschaftlichen und finanziellen Sanktionen Liquiditätssorgen an den Finanzmärkten im Allgemeinen und den russischen, ukrainischen und belarussischen Märkten im Besonderen. Da die Fonds keine direkten Engagements in diesen Ländern aufweisen, halten sich die Auswirkungen in Grenzen. Der Verwaltungsrat behält die Entwicklungen stets genau im Auge und ist immer bestrebt, im besten Interesse der Anteilinhaber seiner Fonds zu handeln.

## Erläuterungen zu den Finanzabschlüssen

Es wurde beschlossen, die Berechnung des Nettoinventarwerts des Teilfonds NN (L) Emerging Europe Equity sowie die Ausgabe, Rücknahme und den Umtausch von Anteilen aufgrund Konflikts zwischen Russland und der Ukraine am 1. März 2022 vorübergehend auszusetzen, da die daraus resultierenden außergewöhnlichen Marktbedingungen es der Gesellschaft unmöglich machen, eine Veräußerung und Bestimmung des Nettoinventarwerts ihrer Vermögenswerte auf normale oder angemessene Weise durchzuführen. Aufgrund der Auswirkungen dieses Konflikts auf diesen Teilfonds ist der Anlageverwalter des Teilfonds weder in der Lage, noch beabsichtigt er, russische Aktien zu kaufen, was die Performance des Teilfonds erheblich beeinträchtigt. Die Anlagepolitik und das Anlageziel des Teilfonds können daher nicht mehr eingehalten werden. Hinzu kommt, dass der Anteil des vom Teilfonds verwalteten Vermögens gering ist und daher als kritisches Niveau erachtet wird, bei dem keine effiziente Verwaltung möglich ist. Nach sorgfältiger Abwägung aller möglicherweise bestehenden Optionen beschloss der Verwaltungsrat, dass es im besten Interesse der Anteilinhaber ist, den Teilfonds zu liquidieren.

### Entwicklungen im Zusammenhang mit Covid-19

#### *Covid-19 und Betriebskontinuitätsplan*

Nach einem volatilen 2. Quartal 2020 verzeichnete die Weltwirtschaft eine starke Erholung gegenüber den Tiefständen der Covid-19-bedingten Rezession. Ab dem 4. Quartal 2020 erfasste die zweite Coronawelle die meisten Industrieländer und sorgte für strikte Quarantänemaßnahmen und hohe Volatilität an den Märkten. Auf die Nachrichten über die erfolgreiche Entwicklung von Impfstoffen im November 2020 folgte im 2. Quartal 2021 eine groß angelegte Impfstoffverteilung in vielen Teilen der Welt. Mit den zunehmenden Impfungen nahm die Normalisierung der Lage konkretere Formen an. Die Volkswirtschaften wurden schrittweise wiedereröffnet. Dadurch ging die Volatilität zurück, und die führenden Aktienindizes erklommen Rekordniveaus. Die Anleihezinsen sanken im Laufe des Jahres, wofür die anziehende Inflation verantwortlich war.

NN IP verfügt über einen aktiven Risiko- und Portfolioverwaltungsprozess, mit dem das Markt- und das Liquiditätsrisiko täglich bewertet und gegebenenfalls Portfolioanpassungen vorgenommen werden. Die aktuellen Prozesse werden als wirksam eingestuft, um weiterhin eine effektive Portfolioverwaltung sicherzustellen.

NN IP hat den Betriebskontinuitätsplan (BCP) aktiviert. Die IT-Infrastruktur wurde erweitert, sodass die Mehrheit der Mitarbeiter von zuhause aus arbeiten und auf alle Systeme zugreifen kann. NN IP verwaltet die Portfolios unter den gegebenen Umständen weiter, und es gab keine wesentlichen Beeinträchtigungen unseres operativen Kontrollrahmens. Nichts deutet darauf hin, dass sich die gegenwärtige Krise negativ die Lebensfähigkeit des Fonds oder des Verwalters auswirkt.

Ende Februar 2022 führte NN IP eine „hybride“ Arbeitsweise ein, bei der die Mitarbeiter teils von zuhause aus und teils im Büro arbeiten. Störungen der Abläufe gab es nicht. Wir gehen davon aus, dass eine Kombination aus Heim- und Büroarbeit infolge der Coronakrise zur Regel wird.

#### *Marktentwicklung*

Die Portfolioverwaltungsteams von NN IP überwachen und bewerten die Marktbedingungen, die Liquidität und die Bewegungen in den Anlageportfolios kontinuierlich, um eine zeitnahe Anpassung an die sich wandelnden Marktbedingungen vorzunehmen. Sie werden durch ein Team von Spezialisten aus verschiedenen Fachbereichen unterstützt. Diese Teams überprüfen regelmäßig die Wirksamkeit der Maßnahmen, die zur Steuerung der Schwankungen bei den Transaktionskosten ergriffen wurden. Bei Bedarf unternehmen sie entsprechende Schritte, um die Interessen der Kunden zu schützen. Derzeit erfolgen keine speziellen coronabezogenen Überwachungsaktivitäten mehr, eine Covid-19-bedingte Phase erhöhter Volatilität an den Finanzmärkten lässt sich aber nicht ausschließen. Sollte die Volatilität künftig steigen, wird das Management die Überwachungsaktivitäten soweit nötig anpassen.

## 2- ZUSAMMENFASSUNG DER WESENTLICHEN RECHNUNGSLEGUNGSGRUNDSÄTZE

Die Finanzabschlüsse werden unter der Unternehmensfortführungsprämisse erstellt und gemäß den allgemein anerkannten und in Luxemburg geltenden Bilanzierungsgrundsätzen und -vorschriften dargestellt.

### **Währungsumrechnung**

Die Finanzabschlüsse wurden in der Rechnungswährung des jeweiligen Teilfonds erstellt. Vermögenswerte und Verbindlichkeiten in anderen Währungen als der Rechnungswährung der jeweiligen Teilfonds werden zu den am Bilanzstichtag gültigen Wechselkursen umgerechnet.

Erträge und Aufwendungen in anderen Währungen als der Rechnungswährung des Teilfonds werden zu dem am Transaktionstag gültigen Wechselkurs umgerechnet.

Die verschiedenen Posten der konsolidierten Abschlüsse entsprechen der Summe der betreffenden Posten in den Finanzabschlüssen der einzelnen Teilfonds, die gegebenenfalls in EUR (Konsolidierungswährung der Gesellschaft) zu den am Abschlussstichtag geltenden Wechselkursen umgerechnet wurden.

## Erläuterungen zu den Finanzabschlüssen (Fortsetzung)

Die Bewertungsdifferenz, die sich beim Nettovermögen der Teilfonds zu Beginn des Jahres durch die Umrechnung mit dem zum Datum des Finanzabschlusses geltenden Wechselkurs ergibt, ist im Posten „Umrechnungsdifferenz“ in der konsolidierten Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens ausgewiesen.

Zum 31. März 2022 wurden folgende Wechselkurse zugrunde gelegt:

1 EUR =	4,0868	AED	1 EUR =	8,7136	HKD	1 EUR =	57,5741	PHP
	1,4817	AUD		367,2401	HUF		4,6367	PLN
	95,9383	BDT		15.980,4360	IDR		4,0520	QAR
	5,2873	BRL		3,5507	ILS		4,9419	RON
	1,3898	CAD		84,3111	INR		91,6268	RUB
	1,0239	CHF		135,0479	JPY		4,1741	SAR
	875,5722	CLP		127,9548	KES		10,3692	SEK
	7,0632	CNH		1.348,5875	KRW		1,5058	SGD
	7,0577	CNY		0,3380	KWD		36,9956	THB
	4.176,5606	COP		22,1885	MXN		16,3201	TRY
	24,4255	CZK		4,6784	MYR		31,8791	TWD
	1,9558	DEM		462,8626	NGN		1,1127	USD
	7,4385	DKK		9,7290	NOK		16,2586	ZAR
	20,3392	EGP		1,5997	NZD			
	0,8451	GBP		4,1335	PEN			
1 JPY =	0,1809	CZK						
	0,0074	EUR						
	0,0343	PLN						
	0,0082	USD						
1 USD =	3,6731	AED	1 USD =	0,7595	GBP	1 USD =	51,7450	PHP
	110,9865	ARS		7,5500	GHS		4,1673	PLN
	1,3316	AUD		7,8314	HKD		3,6418	QAR
	4,7520	BRL		330,0589	HUF		4,4416	RON
	1,2491	CAD		14.362,5000	IDR		105,8150	RSD
	0,9203	CHF		3,1913	ILS		82,3500	RUB
	786,9250	CLP		75,7750	INR		3,7515	SAR
	6,3481	CNH		121,3750	JPY		9,3194	SEK
	6,3431	CNY		1.212,0500	KRW		1,3534	SGD
	3.753,7050	COP		0,3038	KWD		33,2500	THB
	21,9525	CZK		19,9420	MXN		14,6678	TRY
	1,7578	DEM		4,2048	MYR		28,6515	TWD
	6,6854	DKK		416,0000	NGN		41,0500	UYU
	55,0000	DOP		8,7440	NOK		14,6125	ZAR
	18,2800	EGP		1,4377	NZD			
	0,8988	EUR		3,7150	PEN			

## Erläuterungen zu den Finanzabschlüssen (Fortsetzung)

Eine Ausnahme stellt die Währungsumrechnung für den NN (L) Emerging Europe Equity dar, bei dem die folgenden Wechselkurse per 28. Februar 2022 herangezogen wurden, da die Berechnung des Nettoinventarwerts für den Teilfonds seit dem 1. März 2022 ausgesetzt wurde:

1 EUR =	1,4246	CAD
	25,1845	CZK
	0,8371	GBP
	370,4651	HUF
	4,6989	PLN
	4,9485	RON
	120,3930	RUB
	15,5672	TRY
	1,1232	USD

### Bewertung der Wertpapiere im Portfolio

Der Wert aller Vermögenswerte wird unter der Verantwortung des Verwaltungsrats der Gesellschaft ermittelt.

Die Bewertung der Vermögenswerte der Gesellschaft erfolgt für übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente oder Derivate, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden, auf Grundlage des letzten verfügbaren Kurses des Hauptmarktes, an dem diese Wertpapiere, Geldmarktinstrumente oder Derivate gehandelt werden, der von einem anerkannten und vom Verwaltungsrat der Gesellschaft genehmigten Listing Service bereitgestellt wird. Sind diese Kurse nicht repräsentativ für den Marktwert, erfolgt die Bewertung dieser Wertpapiere, Geldmarktinstrumente oder Derivate sowie anderer zugelassener Vermögenswerte auf Grundlage ihres voraussichtlichen Verkaufspreises, der vom Verwaltungsrat der Gesellschaft nach Treu und Glauben bestimmt wird.

Nicht an einem geregelten Markt notierte oder gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente werden auf Grundlage des letzten verfügbaren Kurses bewertet, es sei denn, dieser Kurs ist nicht repräsentativ für ihren tatsächlichen Wert. In diesem Fall erfolgt die Bewertung auf Grundlage des voraussichtlichen Verkaufspreises des Wertpapiers, der nach Treu und Glauben vom Verwaltungsrat der Gesellschaft bestimmt wird.

Anlagen in Investmentfonds, börsennotiert oder nicht, werden auf Grundlage des letzten verfügbaren Nettoinventarwertes pro Aktie/Anteil bewertet.

Anleihen (einschließlich ABS) werden „clean“, d.h. ohne Zinsen, bewertet. Ausnahmen werden im Wertpapierbestand des betreffenden Teilfonds entsprechend angegeben. Anteile mit „Dirty“-Bewertung sind im Portfolio mit einem Sternchen gekennzeichnet. Der letzte bekannte Kurs der Anleihen ist der Geldkurs.

Die Bewertungsmethode des Fonds für Geldmarktinstrumente in den Geldmarktfonds erfüllt die Anforderungen der Geldmarktfondsverordnung (MMFR), die am 21. Januar 2019 in Kraft getreten ist. Das Bewertungsmodell sieht vor, dass die Bewertung von Geldmarktfonds täglich erfolgt. Die Vermögenswerte eines Geldmarktfonds werden, wann immer möglich, nach der Bewertung zu Marktpreisen bewertet.

Bei der Anwendung der Bewertung zu Marktpreisen:

- a. wird der Vermögenswert eines Geldmarktfonds auf der vorsichtigen Seite des Geld-/Briefkurses bewertet, es sei denn, der Vermögenswert kann zum Mittelkurs glattgestellt werden;
- b. wird ausschließlich auf Qualitätsmarktdaten zurückgegriffen; diese Daten werden anhand aller nachstehend genannten Faktoren bewertet:
  - i. Anzahl und Qualität der Gegenparteien;
  - ii. Volumen und Umsatz des betroffenen Vermögenswerts des Geldmarktfonds im Markt;
  - iii. Umfang der Emission und Anteil, den der Geldmarktfonds kaufen oder verkaufen will.

Ist die Anwendung der Bewertung zu Marktpreisen nicht möglich oder weisen die Marktdaten nicht die erforderliche Qualität auf, wird der Vermögenswert eines Geldmarktfonds konservativ unter Anwendung der Bewertung zu Modellpreisen bewertet. Das Modell muss eine präzise Schätzung des dem Vermögenswert des Geldmarktfonds inhärenten Wertes liefern und sich auf alle folgenden aktuellen Schlüsselfaktoren stützen:

- a. Volumen und Umsatz des betroffenen Vermögenswerts im Markt;
- b. Umfang der Emission und Anteil, den der Geldmarktfonds kaufen oder verkaufen will;
- c. das mit dem Vermögenswert verbundene Markt-, Zins- und Kreditrisiko.

Bei Anwendung der Bewertung zu Modellpreisen wird die Methode der Bewertung zu fortgeführten Anschaffungskosten nicht angewandt. Ein Geldmarktfonds berechnet den Nettoinventarwert pro Anteil als Differenz zwischen der Summe aller Vermögenswerte eines Geldmarktfonds und der Summe aller Verbindlichkeiten dieses Geldmarktfonds, die jeweils nach der Bewertung zu Marktpreisen oder der Bewertung zu Modellpreisen oder beiden Methoden bewertet wurden, geteilt durch die Gesamtzahl der Geldmarktfondsanteile.



## Erläuterungen zu den Finanzabschlüssen (Fortsetzung)

Realisierte Gewinne und Verluste aus dem Anlagenportfolio werden auf Basis des durchschnittlichen Einstandspreises der veräußerten Wertpapiere berechnet.

### Bewertung von derivativen Finanzinstrumenten

Der Wert aller Vermögenswerte wird unter der Verantwortung des Verwaltungsrats der Gesellschaft ermittelt.

Bei Swaps handelt es sich im Allgemeinen um Kontrakte, mit denen sich zwei Parteien verpflichten, während eines bestimmten Zeitraums zwei Zahlungsströme, die auf Grundlage eines nominellen Werts bestimmt werden, auszutauschen - den einen gegen den anderen. Die Zahlungsströme können an einen oder mehrere Zinssätze, Wechselkurse, Aktien, Indizes oder Kreditereignisse gekoppelt sein. Die Bewertung von Swapkontrakten erfolgt unter Heranziehung der Differenz zwischen dem Wert der prognostizierten Zahlungsströme, welche die Gegenpartei dem Teilfonds zu zahlen hat, und dem Wert der prognostizierten Zahlungsströme, die der Teilfonds seinen Gegenparteien schuldet. Swaps werden auf Grundlage ihres Marktwerts bewertet, der von mehreren Parametern abhängt (Indexstand, Marktzinssatz, Restlaufzeit des Swaps).

Positive Netto-Marktwerte der Swapkontrakte werden in der Nettovermögensaufstellung als Vermögenswerte, negative als Verbindlichkeiten unter „Derivative Finanzinstrumente Gesamt“ ausgewiesen. Realisierte Gewinne (oder Verluste) und Veränderungen des nicht realisierten Ergebnisses werden in der Rubrik Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens erfasst.

Swaps werden „clean“, d.h. ohne Zinsforderungen/-verbindlichkeiten, bewertet. Ausnahmen sind bei den derivativen Finanzinstrumenten der einzelnen Teilfonds entsprechend gekennzeichnet. Zinsforderungen aus Swapgeschäften sind im Posten „Sonstige Vermögenswerte“ enthalten. Für Swageschäfte zu entrichtende Zinsen sind im Posten „Sonstige Verbindlichkeiten“ enthalten.

Devisentermingeschäfte stellen Verpflichtungen dar, eine ausländische Währung auf Grundlage ihres zukünftigen Wechselkurses, der zum Zeitpunkt des Vertragsabschlusses festgelegt wird, zu kaufen oder zu verkaufen. Nicht verfallene Devisenterminkontrakte werden zum letzten an den Bewertungstagen oder dem Bilanzstichtag verfügbaren „Termin“-Kurs bewertet, und nicht realisierte Wertsteigerungen (oder Wertminderungen) werden erfasst. Positive Netto-Marktwerte der Devisenterminkontrakte werden in der Nettovermögensaufstellung als Vermögenswerte, negative als Verbindlichkeiten unter „Derivative Finanzinstrumente Gesamt“ ausgewiesen. Realisierte Gewinne (oder Verluste) und Veränderungen des nicht realisierten Ergebnisses werden in der Rubrik Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens erfasst.

Future-Kontrakte werden auf Grundlage des letzten verfügbaren Marktpreises bewertet. Bei Abschluss von Future-Kontrakten wird eine Einschusszahlung (Initial Margin) geleistet. Nachschüsse (Variation Margins) werden in Abhängigkeit von den täglichen Schwankungen des Marktwerts des Kontrakts geleistet oder empfangen und vom Fonds als nicht realisierte Wertsteigerung oder Wertminderung erfasst. Positive Netto-Marktwerte der Future-Kontrakte werden in der Nettovermögensaufstellung als Vermögenswerte, negative als Verbindlichkeiten unter „Derivative Finanzinstrumente Gesamt“ ausgewiesen. Realisierte Gewinne (oder Verluste) und Veränderungen des nicht realisierten Ergebnisses werden in der Rubrik Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens erfasst. Zur Berechnung der Nettobestände der Finanzinstrumente in der jeweiligen Währung werden die Bestände zu dem am Ende des Berichtszeitraums geltenden Wechselkurs umgerechnet.

An einer amtlichen Börse oder einem anderen geregelten Markt notierte Optionskontrakte werden zum letzten bekannten Marktpreis bewertet, oder, falls es mehrere Märkte gibt, zum letzten bekannten Preis des Hauptmarktes. Nicht an einer amtlichen Börse oder einem anderen geregelten Markt notierte Optionskontrakte werden zu ihrem letzten bekannten Marktwert oder in Ermangelung eines Marktwerts zu ihrem wahrscheinlichen Marktwert bewertet, der durch eine angemessene Schätzung des Verwaltungsrats des Fonds bestimmt wird.

Positive Netto-Marktwerte der Optionskontrakte werden in der Nettovermögensaufstellung als Vermögenswerte, negative als Verbindlichkeiten unter „Derivative Finanzinstrumente Gesamt“ ausgewiesen. Realisierte Gewinne (oder Verluste) und Veränderungen des nicht realisierten Ergebnisses werden in der Rubrik Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens erfasst.

### Erträge und Ausgaben

Dividenden werden an dem Tag verbucht, an dem das Wertpapier an der Börse Ex-Dividende notiert wird (nach Abzug der Quellensteuer).

Zinsen laufen täglich auf.

Disagio- bzw. Agio-Beträge werden unter Zinsen aus Anleihen und anderen Schuldtiteln verrechnet.

### 3- SWINGING SINGLE PRICING

Es kann bei Teilfonds zu einer „Verwässerung“ des Nettoinventarwerts je Anteil kommen, da der Preis, zu dem Anleger Anteile des Teilfonds zeichnen oder zurückgeben, nicht die Transaktionskosten und sonstigen Kosten widerspiegelt, die anfallen, wenn der Anlageverwalter im Rahmen von Mittelzu- und -abflüssen aus diesen Zeichnungen oder Rücknahmen Geschäfte tätigen muss.

## Erläuterungen zu den Finanzabschlüssen (Fortsetzung)

Um dies zu verhindern, kann die Methode des „Swinging Single Pricing“ (SSP) angewandt werden, die darauf abzielt, die erwarteten Transaktionskosten auszugleichen, die der Unterschied zwischen Kapitalzu- und -abflüssen nach sich zieht. Übersteigen die Nettotransaktionen mit Anteilen des Teilfonds an einem Bewertungstag einen vorher festgelegten Schwellenwert, kann der Nettoinventarwert des betreffenden Teilfonds nach oben oder unten angepasst werden, um die erwarteten Transaktionskosten zu kompensieren, die mit diesen Nettokapitalzu- bzw. -abflüssen verbunden sind. Der Verwaltungsrat ermittelt die Nettomittelzu- und -abflüsse auf Basis der zum Zeitpunkt der Berechnung des Nettoinventarwerts aktuellsten Daten.

Dieser vorab festgelegte Schwellenwert und die Swing-Faktoren werden regelmäßig überprüft und gegebenenfalls angepasst. Der maximale Swing-Faktor beträgt 1,50% des Nettoinventarwerts des betreffenden Teilfonds; von dieser Regelung ausgenommen sind Teilfonds, die in festverzinsliche Instrumente investieren und einen maximalen Swing-Faktor von 3,00% anwenden können.

Unter außergewöhnlichen Marktbedingungen kann der Verwaltungsrat im Falle umfangreicher Zeichnungs-, Rücknahme- oder Umtauschanträge, die sich abträglich auf die Interessen der Anteilhaber auswirken können, nach eigenem Ermessen eine vorübergehende Erhöhung des Swing-Faktors über den maximalen Swing-Faktor hinaus genehmigen. Außergewöhnliche Marktbedingungen können unter anderem als Phasen mit erhöhter Marktvolatilität, mangelnder Liquidität, Schwierigkeiten bei der Zwischenschaltung von Händlern, ungeordneten Handelsbedingungen, Marktverwerfungen und großer Kluft zwischen Marktpreisen und Bewertungen definiert werden und könnten eine Folge höherer Gewalt sein (zu der unter anderem Kriegshandlungen, Unruhen oder Cybersabotage zählen).

Die aktuellen Schwellenwerte und Swing-Faktoren für die einzelnen Teilfonds werden auf der Website [www.nnip.com](http://www.nnip.com) veröffentlicht und aktualisiert.

Per 31. März 2022 wurde bei folgenden Teilfonds ein Swing-Faktor angewandt:

- NN (L) Corporate Green Bond,
- NN (L) Greater China Equity.

Welche Teilfonds in der am 31. März 2022 beendeten Berichtsperiode den Mechanismus des Swinging Single Pricing angewandt haben, ist aus der folgenden Liste zu entnehmen:

Teilfonds	Schwellenwerte	Swing-Faktor Zeichnungen	Swing-Faktor Rücknahmen
NN (L) AAA ABS	1,00%	0,15%	0,05%
NN (L) Alternative Beta	1,00%	0,02%	0,02%
NN (L) Asia Income	2,00%	0,22%	0,32%
NN (L) Asian Debt (Hard Currency)	0,50%	0,23%	0,25%
NN (L) Asian High Yield	1,00%	0,30%	0,30%
NN (L) Banking & Insurance	2,00%	0,08%	0,05%
NN (L) Climate & Environment	1,00%	0,14%	0,12%
NN (L) Commodity Enhanced	1,00%	0,00%	0,00%
NN (L) Corporate Green Bond	1,00%	0,17%	0,08%
NN (L) Emerging Europe Equity	2,00%	0,70%	0,70%
NN (L) Emerging Markets Corporate Debt	1,00%	0,30%	0,30%
NN (L) Emerging Markets Debt (Hard Currency)	0,25%	0,30%	0,30%
NN (L) Emerging Markets Debt (Local Bond)	0,50%	0,20%	0,20%
NN (L) Emerging Markets Debt (Local Currency)	1,00%	0,20%	0,20%
NN (L) Emerging Markets Enhanced Index Sustainable Equity	0,50%	0,23%	0,40%
NN (L) Emerging Markets High Dividend	1,00%	0,23%	0,40%
NN (L) Energy	2,00%	0,08%	0,05%
NN (L) EURO Equity	1,00%	0,20%	0,06%
NN (L) Euro Fixed Income	1,00%	0,08%	0,04%
NN (L) Euro High Dividend	1,00%	0,20%	0,06%
NN (L) Euro Long Duration Bond	1,00%	0,08%	0,04%
NN (L) Euro Sustainable Credit (excluding Financials)	1,00%	0,17%	0,08%
NN (L) Euromix Bond	1,00%	0,04%	0,02%



## Erläuterungen zu den Finanzabschlüssen (Fortsetzung)

Teilfonds	Schwellenwerte	Swing-Faktor Zeichnungen	Swing-Faktor Rücknahmen
NN (L) European ABS	1,00%	0,17%	0,08%
NN (L) European Enhanced Index Sustainable Equity	1,00%	0,21%	0,06%
NN (L) European High Dividend	1,00%	0,21%	0,06%
NN (L) European High Yield	1,00%	0,30%	0,30%
NN (L) European Participation Equity	2,00%	0,73%	0,66%
NN (L) European Real Estate	2,00%	0,27%	0,12%
NN (L) European Sustainable Equity	1,00%	0,21%	0,06%
NN (L) First Class Multi Asset	1,00%	0,10%	0,05%
NN (L) First Class Multi Asset Premium	2,00%	0,11%	0,06%
NN (L) First Class Protection	2,00%	0,05%	0,05%
NN (L) First Class Yield Opportunities	1,00%	0,25%	0,13%
NN (L) Food & Beverages	2,00%	0,08%	0,05%
NN (L) Frontier Markets Debt (Hard Currency)	0,50%	0,30%	0,30%
NN (L) Global Convertible Bond	2,00%	0,37%	0,18%
NN (L) Global Convertible Opportunities	1,00%	0,37%	0,18%
NN (L) Global Enhanced Index Sustainable Equity	1,00%	0,08%	0,05%
NN (L) Global Equity Impact Opportunities	1,00%	0,14%	0,12%
NN (L) Global High Dividend	1,00%	0,08%	0,05%
NN (L) Global High Yield	0,50%	0,30%	0,30%
NN (L) Global Inflation Linked Bond	1,00%	0,05%	0,03%
NN (L) Global Investment Grade Credit	2,00%	0,17%	0,08%
NN (L) Global Real Estate	2,00%	0,10%	0,08%
NN (L) Global Sustainable Equity	0,50%	0,08%	0,05%
NN (L) Greater China Equity	1,00%	0,24%	0,31%
NN (L) Green Bond	1,00%	0,17%	0,08%
NN (L) Green Bond Short Duration	1,00%	0,17%	0,08%
NN (L) Health & Well-being	1,00%	0,14%	0,12%
NN (L) Health Care	1,00%	0,08%	0,05%
NN (L) Japan Equity	2,00%	0,08%	0,08%
NN (L) Multi Asset Factor Opportunities	1,00%	0,11%	0,11%
NN (L) North America Enhanced Index Sustainable Equity	1,00%	0,05%	0,05%
NN (L) Sovereign Green Bond	2,00%	0,17%	0,08%
NN (L) US Credit	0,50%	0,17%	0,08%
NN (L) US Enhanced Core Concentrated Equity	1,00%	0,05%	0,05%
NN (L) US Factor Credit	2,00%	0,20%	0,10%
NN (L) US High Dividend	1,00%	0,05%	0,05%
NN (L) US High Yield	1,00%	0,30%	0,30%

Bei den angegebenen Swing-Faktoren handelt es sich um die derzeit geltenden Faktoren und möglicherweise nicht um die tatsächlich in dem am 31. März 2022 beendeten Berichtszeitraum angewandten Swing-Faktoren.

#### 4- SONSTIGE VERMÖGENSWERTE UND SONSTIGE VERBINDLICHKEITEN

Der Posten „Sonstige Vermögenswerte“ umfasst hauptsächlich aufgelaufene Zinsen, Forderungen aus dem Verkauf von Wertpapieren und anderen Instrumenten, Forderungen aus Zeichnungen, sonstige Forderungen, Bar-Sicherheiten (cash collaterals) von Brokern und Zinsforderungen aus Swaps.

## Erläuterungen zu den Finanzabschlüssen (Fortsetzung)

Der Posten „Sonstige Verbindlichkeiten“ enthält vor allem Gebührenrückstellungen, Verbindlichkeiten aus dem Kauf von Wertpapieren und anderen Instrumenten, Verbindlichkeiten aus Rücknahmen, sonstige Verbindlichkeiten, an Broker zu leistende Bar-Sicherheiten (cash collaterals), für Swapgeschäfte zu entrichtende Zinsenn und Rückstellungen für Verwässerungs-Swing-downs.

### 5- VERWALTUNGSgebÜHREN

Die Teilfonds zahlen gemäß dem zwischen NN Investment Partners B.V. und der SICAV geschlossenen "Gesamtportfolioverwaltungsvertrag" und den darin festgelegten Bedingungen eine jährliche Verwaltungsgebühr an NN Investment Partners B.V., die auf der Grundlage des durchschnittlichen Nettovermögens der jeweiligen Anteilsklasse gemäß nachstehender Tabelle berechnet wird. Sie ist monatlich rückwirkend zahlbar.

Zum 31. März 2022 galten folgende Sätze für die effektive Verwaltungsgebühr der aktiven Anteilsklassen:

Teilfonds	Verwaltungsgebühren (p.a.)															
	Klasse D	Klasse I	Klasse M	Klasse N	Klasse O	Klasse P	Klasse Q	Klasse R	Klasse S	Klasse T	Klasse U	Klasse V	Klasse X	Klasse Y	Klasse Z*	Klasse Zz*
	(in %)	(in %)	(in %)	(in %)	(in %)	(in %)	(in %)	(in %)	(in %)	(in %)	(in %)	(in %)	(in %)	(in %)	(in %)	(in %)
NN (L) AAA ABS	-	0,12	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0,00	0,00
NN (L) Alternative Beta	-	0,50	-	0,50	-	1,00	-	0,50	-	-	-	-	1,30	-	-	0,00
NN (L) Asia Income	-	0,60	-	0,65	0,45	1,50	-	0,75	-	-	-	-	2,00	2,00	-	-
NN (L) Asian Debt (Hard Currency)	-	0,72	-	0,50	0,30	1,00	-	0,60	-	-	0,39	-	1,50	1,50	0,00	-
NN (L) Asian High Yield	-	0,72	-	-	-	1,00	-	-	-	-	0,39	-	-	-	-	-
NN (L) Banking & Insurance	-	0,60	-	-	-	1,50	-	0,75	-	-	-	-	2,00	-	-	-
NN (L) Belgian Government Bond	-	-	-	-	-	0,60	-	0,36	-	-	-	-	-	-	-	-
NN (L) Climate & Environment	-	0,60	-	0,58	-	1,50	-	0,75	-	-	-	-	2,00	2,00	-	-
NN (L) Commodity Enhanced	-	0,50	-	0,50	0,30	1,00	-	-	-	-	-	-	1,30	-	0,00	0,00
NN (L) Corporate Green Bond	-	0,20	-	-	-	0,40	0,07	0,20	-	-	-	-	0,75	-	-	-
NN (L) Emerging Europe Equity	-	0,65	-	-	-	1,50	-	0,75	-	-	-	-	2,00	-	-	-
NN (L) Emerging Markets Corporate Debt	-	0,72	-	0,60	-	1,20	-	-	-	-	-	-	1,50	-	0,00	-
NN (L) Emerging Markets Debt (Hard Currency)	-	0,72	-	0,60	0,36	1,20	-	0,72	-	-	-	-	1,50	1,50	0,00	0,00
NN (L) Emerging Markets Debt (Local Bond)	-	0,72	-	0,50	-	1,00	-	0,72	-	-	-	-	1,50	-	-	0,00
NN (L) Emerging Markets Debt (Local Currency)	-	0,72	-	0,50	-	1,00	-	0,72	-	-	-	-	1,50	-	0,00	0,00
NN (L) Emerging Markets Debt Short Duration (Hard Currency)	-	0,50	-	-	-	1,00	-	-	-	-	-	-	-	-	0,00	-
NN (L) Emerging Markets Enhanced Index Sustainable Equity	-	0,10	-	0,10	-	0,35	-	0,10	-	-	-	-	0,85	0,85	0,00	-
NN (L) Emerging Markets High Dividend	-	0,60	-	0,65	-	1,50	-	0,75	-	-	-	-	2,00	2,00	-	0,00
NN (L) Energy	-	0,60	-	-	-	1,50	-	0,75	-	-	-	-	2,00	2,00	-	-
NN (L) Euro Covered Bond	-	0,24	-	0,25	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0,00	0,00
NN (L) Euro Credit	-	0,36	-	-	-	0,75	0,25	0,36	-	-	-	0,75	1,00	-	0,00	-
NN (L) EURO Equity	-	0,48	-	-	-	1,30	-	0,65	-	-	-	1,30	1,80	-	-	-
NN (L) Euro Fixed Income	-	0,36	-	0,35	0,20	0,65	-	0,36	-	-	-	0,65	0,75	-	0,00	-

## Erläuterungen zu den Finanzabschlüssen (Fortsetzung)

Teilfonds	Verwaltungsgebühren (p.a.)															
	Klasse D (in %)	Klasse I (in %)	Klasse M (in %)	Klasse N (in %)	Klasse O (in %)	Klasse P (in %)	Klasse Q (in %)	Klasse R (in %)	Klasse S (in %)	Klasse T (in %)	Klasse U (in %)	Klasse V (in %)	Klasse X (in %)	Klasse Y (in %)	Klasse Z* (in %)	Klasse Zz* (in %)
NN (L) Euro High Dividend	-	0,60	-	0,60	-	1,50	-	0,75	-	-	0,48	1,50	2,00	2,00	0,00	-
NN (L) Euro Income	-	-	-	-	-	1,50	-	0,75	-	-	-	-	2,00	-	-	-
NN (L) Euro Liquidity	-	-	-	0,01	-	0,01	-	0,01	0,01	-	-	-	0,01	-	-	-
NN (L) Euro Long Duration Bond	-	0,36	-	0,20	-	0,65	-	-	-	-	-	-	0,75	-	-	-
NN (L) Euro Short Duration	-	0,36	-	-	-	0,60	-	0,36	-	-	-	-	-	-	0,00	-
NN (L) Euro Sustainable Credit	-	0,36	-	0,23	-	0,65	-	0,36	-	0,19	-	-	0,75	-	0,00	-
NN (L) Euro Sustainable Credit (excluding Financials)	-	0,36	-	0,23	0,20	0,65	-	0,36	-	-	-	-	0,75	-	-	-
NN (L) Euromix Bond	-	0,36	-	0,25	-	0,65	-	0,36	-	-	-	0,65	0,75	-	-	-
NN (L) European ABS	-	0,36	-	0,15	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0,00	-
NN (L) European Enhanced Index Sustainable Equity	-	0,08	-	-	-	0,35	-	0,10	-	-	-	-	0,85	-	0,00	-
NN (L) European Equity	-	0,48	-	0,65	0,39	1,30	-	0,65	-	-	-	-	1,80	-	0,00	-
NN (L) European High Dividend	-	0,60	-	0,60	-	1,50	-	0,75	-	-	-	1,50	2,00	-	-	-
NN (L) European High Yield	-	0,72	-	0,50	-	1,00	-	0,60	-	-	-	-	1,50	-	0,00	0,00
NN (L) European Participation Equity	-	0,60	-	-	-	1,50	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
NN (L) European Real Estate	-	0,48	-	0,65	-	1,30	-	0,65	-	-	-	-	1,80	-	-	-
NN (L) European Sustainable Equity	-	0,60	-	0,65	-	1,50	-	0,75	-	-	-	-	2,00	-	0,00	0,00
NN (L) First Class Multi Asset	-	0,50	-	0,50	0,30	1,00	-	0,50	-	-	-	-	1,50	1,50	-	0,00
NN (L) First Class Multi Asset Premium	-	0,60	-	0,60	-	1,20	-	-	-	-	-	-	2,00	-	-	-
NN (L) First Class Protection	-	0,36	-	0,36	-	0,72	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
NN (L) First Class Stable Yield Opportunities	0,45	0,30	-	0,25	-	0,45	-	-	-	-	-	-	0,75	-	0,00	-
NN (L) First Class Yield Opportunities	-	0,60	-	0,45	-	0,90	-	-	-	-	-	-	1,20	1,20	0,00	0,00
NN (L) Food & Beverages	-	0,60	-	-	-	1,50	-	0,75	-	-	-	-	2,00	2,00	-	-
NN (L) Frontier Markets Debt (Hard Currency)	-	0,72	-	0,60	-	1,20	-	-	-	-	-	-	1,50	1,50	-	-
NN (L) Global Bond Opportunities	-	0,36	-	0,35	-	0,75	-	0,36	-	-	-	-	1,00	-	-	-
NN (L) Global Convertible Bond	-	0,50	-	-	-	0,80	-	0,50	-	-	-	-	-	-	0,00	-
NN (L) Global Convertible Opportunities	-	0,72	-	0,50	-	1,20	-	0,60	-	-	-	-	1,50	-	0,00	0,00
NN (L) Global Enhanced Index Sustainable Equity	-	0,08	-	-	-	0,35	-	0,10	-	-	-	-	0,85	-	0,00	-
NN (L) Global Equity Impact Opportunities	-	0,60	1,18	0,30	0,30	1,50	-	0,75	-	-	-	-	2,00	-	-	-
NN (L) Global High Dividend	-	0,60	-	-	-	1,50	-	0,75	-	-	-	-	2,00	2,00	-	0,00
NN (L) Global High Yield	-	0,72	-	0,50	-	1,00	-	0,60	-	-	-	-	1,50	1,50	0,00	0,00
NN (L) Global Inflation Linked Bond	-	0,36	-	0,35	-	0,65	-	0,36	-	-	-	-	0,75	-	-	-
NN (L) Global Investment	-	0,36	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0,00

## Erläuterungen zu den Finanzabschlüssen (Fortsetzung)

Teilfonds	Verwaltungsgebühren (p.a.)															
	Klasse D (in %)	Klasse I (in %)	Klasse M (in %)	Klasse N (in %)	Klasse O (in %)	Klasse P (in %)	Klasse Q (in %)	Klasse R (in %)	Klasse S (in %)	Klasse T (in %)	Klasse U (in %)	Klasse V (in %)	Klasse X (in %)	Klasse Y (in %)	Klasse Z* (in %)	Klasse Zz* (in %)
Grade Credit																
NN (L) Global Real Estate	-	0,48	1,09	-	-	1,30	-	0,65	-	-	-	-	1,80	-	-	0,00
NN (L) Global Sustainable Equity	-	0,60	1,08	0,43	0,43	1,50	-	0,75	-	0,49	-	1,50	2,00	-	0,00	0,00
NN (L) Greater China Equity	-	0,60	-	0,65	0,45	1,50	-	0,75	-	-	-	-	2,00	2,00	-	-
NN (L) Green Bond	-	0,20	-	0,20	-	0,40	-	0,20	-	0,14	-	-	0,75	-	0,00	-
NN (L) Green Bond Short Duration	-	0,20	-	-	-	0,40	-	0,20	-	-	-	-	0,75	-	-	-
NN (L) Health & Well-being	-	0,60	-	0,58	0,35	1,50	-	0,75	-	-	-	-	2,00	-	-	-
NN (L) Health Care	-	0,60	-	-	-	1,50	-	0,75	-	-	-	-	2,00	-	-	-
NN (L) Japan Equity	-	0,60	-	-	-	1,30	-	0,65	-	-	-	1,30	1,80	1,80	0,00	-
NN (L) Multi Asset Factor Opportunities	-	0,60	-	-	-	1,20	-	-	-	-	-	-	-	-	0,00	-
NN (L) Multi Asset High Income	-	0,60	-	-	-	1,20	-	-	-	-	-	-	2,00	-	0,00	-
NN (L) North America Enhanced Index Sustainable Equity	-	0,08	-	-	-	0,35	0,03	0,10	-	-	-	-	0,85	-	0,00	-
NN (L) Smart Connectivity	-	0,60	-	0,58	-	1,50	-	0,75	-	-	-	-	2,00	-	-	-
NN (L) Sovereign Green Bond	-	0,20	-	-	-	0,40	-	0,20	-	-	-	-	0,75	-	0,00	-
NN (L) US Behavioural Equity	-	0,60	-	-	-	1,50	-	0,75	-	-	-	-	-	-	0,00	-
NN (L) US Credit	-	0,36	-	0,35	-	0,75	-	0,36	-	-	-	-	1,00	1,00	0,00	-
NN (L) US Enhanced Core Concentrated Equity	-	0,48	-	-	-	1,30	-	0,65	-	-	-	1,30	1,80	-	-	-
NN (L) US Factor Credit	-	0,36	-	0,36	-	0,65	-	-	-	-	-	-	0,75	-	-	-
NN (L) US High Dividend	-	0,60	-	0,15	-	1,50	-	0,75	-	-	-	-	2,00	2,00	-	-
NN (L) US High Yield	-	0,72	-	-	-	1,00	-	-	-	-	-	-	-	-	0,00	0,00

\* Bei dieser Anteilsklasse wird die Verwaltungsgebühr nicht der Anteilsklasse berechnet. Stattdessen wird durch die Verwaltungsgesellschaft eine spezielle Verwaltungsgebühr erhoben und direkt von den Anteilshabern eingezogen.

Wenn bei Anlagen in OGAW und andere Ziel-OGA die Verwaltungsgesellschaft oder der beauftragte Anlageverwalter direkt aus dem Vermögen dieser OGAW oder anderen OGA eine Verwaltungsgebühr erhält, werden diese Zahlungen von der Vergütung der Verwaltungsgesellschaft oder des beauftragten Anlageverwalters abgezogen.

Der Teilfonds NN (L) Multi Asset High Income hat über 50% seines jeweiligen Nettovermögens in andere OGAW/OGA investiert, die direkt oder im Auftrag derselben Verwaltungsgesellschaft verwaltet werden. Der maximale Prozentsatz der Verwaltungsgebühr, die von diesen Teilfonds und den OGAW/OGA, in die sie investiert haben, erhoben wird, ist in folgender Tabelle aufgeführt:

Teilfonds	Verwaltungsgebühr %
NN (L) Emerging Markets Corporate Debt - Z Cap USD*	-
NN (L) Emerging Markets Debt (Hard Currency) - I Cap USD	0,72
NN (L) Emerging Markets Enhanced Index Sustainable Equity - I Cap EUR	0,10
NN (L) European ABS - I Cap EUR	0,36
NN (L) European High Dividend - I Cap EUR	0,60
NN (L) Global Enhanced Index Sustainable Equity - I Cap USD	0,08
NN (L) Global High Yield - I Cap EUR (hedged iii)	0,72
NN (L) Global Sustainable Equity - I Cap EUR	0,60

## Erläuterungen zu den Finanzabschlüssen (Fortsetzung)

Teilfonds	Verwaltungsgebühr %
NN (L) Liquid EUR - B Cap EUR	0,12
NN (L) US High Yield - Z Cap USD*	-

\* Bei dieser Anteilsklasse wird die Verwaltungsgebühr nicht der Anteilsklasse berechnet. Stattdessen wird durch die Verwaltungsgesellschaft eine spezielle Verwaltungsgebühr erhoben und direkt von den Anteilsinhabern eingezogen.

Wenn die von den investierten Teilfonds gezahlten Verwaltungsgebühren höher sind als die von den Teilfonds der SICAV zu zahlenden Verwaltungsgebühren, wird die Differenz (die „überschüssige Verwaltungsgebühr“) in der Ergebnisrechnung und den Veränderungen des Nettovermögens unter „Sonstige Erträge“ ausgewiesen.

NN Investment Partners B.V. hat auf eigene Kosten die nachstehenden Anlageverwalter mit der Verwaltung der verschiedenen Teilfonds betraut:

Teilfonds	Anlageverwalter
NN (L) Asia Income	Nomura Asset Management Taiwan Ltd.
NN (L) Asian Debt (Hard Currency)	NN Investment Partners (Singapore) Ltd.
NN (L) Asian High Yield	NN Investment Partners (Singapore) Ltd.
NN (L) Emerging Europe Equity	NN Investment Partners Towarzystwo Funduszy Inwestycyjnych S.A.
NN (L) Emerging Markets Corporate Debt	NN Investment Partners (Singapore) Ltd., NN Investment Partners North America LLC.
NN (L) Emerging Markets Debt (Hard Currency)	NN Investment Partners (Singapore) Ltd., NN Investment Partners North America LLC.
NN (L) Emerging Markets Debt (Local Bond)	NN Investment Partners (Singapore) Ltd., NN Investment Partners North America LLC.
NN (L) Emerging Markets Debt (Local Currency)	NN Investment Partners (Singapore) Ltd., NN Investment Partners North America LLC.
NN (L) Emerging Markets Debt Short Duration (Hard Currency)	NN Investment Partners (Singapore) Ltd., NN Investment Partners North America LLC.
NN (L) Emerging Markets Enhanced Index Sustainable Equity	Irish Life Investment Managers Limited
NN (L) Euro High Dividend	NNIP Advisors B.V.
NN (L) European Enhanced Index Sustainable Equity	Irish Life Investment Managers Limited
NN (L) European High Dividend	NNIP Advisors B.V.
NN (L) First Class Multi Asset	NN Investment Partners North America LLC.
NN (L) First Class Multi Asset Premium	NN Investment Partners North America LLC.
NN (L) First Class Stable Yield Opportunities	NN Investment Partners (Singapore) Ltd., NN Investment Partners North America LLC.
NN (L) First Class Yield Opportunities	NN Investment Partners (Singapore) Ltd., NN Investment Partners North America LLC.
NN (L) Frontier Markets Debt (Hard Currency)	NN Investment Partners (Singapore) Ltd., NN Investment Partners North America LLC.
NN (L) Global Bond Opportunities	NN Investment Partners North America LLC.
NN (L) Global Enhanced Index Sustainable Equity	Irish Life Investment Managers Limited
NN (L) Global High Dividend	American Century Investment Management Inc.
NN (L) Global High Yield	NN Investment Partners (Singapore) Ltd., NN Investment Partners North America LLC.
NN (L) Global Investment Grade Credit	NN Investment Partners (Singapore) Ltd., NN Investment Partners North America LLC.
NN (L) Greater China Equity	Nomura Asset Management Taiwan Ltd.
NN (L) Japan Equity	Nomura Asset Management Co. Ltd.
NN (L) North America Enhanced Index Sustainable Equity	Irish Life Investment Managers Limited
NN (L) US Credit	Voya Investment Management Co. LLC.
NN (L) US Enhanced Core Concentrated Equity	Voya Investment Management Co. LLC.
NN (L) US Factor Credit	NN Investment Partners North America LLC.
NN (L) US High Dividend	American Century Investment Management Inc.
NN (L) US High Yield	NN Investment Partners North America LLC.

## Erläuterungen zu den Finanzabschlüssen (Fortsetzung)

### 6- FESTE SERVICEGEBÜHR

Für jeden Teilfonds wird auf Ebene der Anteilklassen eine feste Servicegebühr berechnet. Diese Gebühr wird an die Verwaltungsgesellschaft entrichtet, die damit im Namen der Gesellschaft Kosten für die Verwaltung und Verwahrung von Vermögenswerten, die Transferstellengebühr, die belgische Zeichnungsgebühr sowie sonstige laufende Betriebs- und Verwaltungskosten, die der Gesellschaft entstehen, begleicht.

Die feste Servicegebühr ist in dem Sinne fest, dass die Verwaltungsgesellschaft die über die jährlich gezahlte feste Servicegebühr hinausgehenden Aufwendungen für jede Anteilklasse der einzelnen Teilfonds trägt.

Umgekehrt ist die Verwaltungsgesellschaft berechtigt, den über die tatsächlichen Aufwendungen der jeweiligen Anteilklasse hinausgehenden Betrag der Servicegebühr einzubehalten, die der jeweiligen Anteilklasse in Rechnung gestellt wurde.

Die auf Basis des durchschnittlichen Nettovermögens jeder Anteilklasse berechnete Gebühr ist monatlich rückwirkend zahlbar.

Zum 31. März 2022 galten folgende Sätze für die effektiven festen Servicegebühren der aktiven Anteilklassen:

Teilfonds	Feste Servicegebühr (p.a.)															
	Klasse D (in %)	Klasse I (in %)	Klasse M (in %)	Klasse N (in %)	Klasse O (in %)	Klasse P (in %)	Klasse Q (in %)	Klasse R (in %)	Klasse S (in %)	Klasse T (in %)	Klasse U (in %)	Klasse V (in %)	Klasse X (in %)	Klasse Y* (in %)	Klasse Z** (in %)	Klasse Zz** (in %)
NN (L) AAA ABS	-	0,12	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0,05	0,00
NN (L) Alternative Beta	-	0,20	-	0,30	-	0,30	-	0,30	-	-	-	-	0,30	-	-	0,00
NN (L) Asia Income	-	0,25	-	0,35	0,35	0,35	-	0,35	-	-	-	-	0,35	0,35	-	-
NN (L) Asian Debt (Hard Currency)	-	0,15	-	0,25	0,25	0,25	-	0,25	-	-	0,15	-	0,25	0,25	0,15	-
NN (L) Asian High Yield	-	0,15	-	-	-	0,25	-	-	-	-	0,15	-	-	-	-	-
NN (L) Banking & Insurance	-	0,20	-	-	-	0,25	-	0,25	-	-	-	-	0,25	-	-	-
NN (L) Belgian Government Bond	-	-	-	-	-	0,15	-	0,15	-	-	-	-	-	-	-	-
NN (L) Climate & Environment	-	0,20	-	0,20	-	0,25	-	0,25	-	-	-	-	0,25	0,25	-	-
NN (L) Commodity Enhanced	-	0,20	-	0,30	0,30	0,30	-	-	-	-	-	-	0,30	-	0,20	0,00
NN (L) Corporate Green Bond	-	0,12	-	-	-	0,15	0,12	0,15	-	-	-	-	0,15	-	-	-
NN (L) Emerging Europe Equity	-	0,25	-	-	-	0,35	-	0,35	-	-	-	-	0,35	-	-	-
NN (L) Emerging Markets Corporate Debt	-	0,15	-	0,25	-	0,25	-	-	-	-	-	-	0,25	-	0,15	-
NN (L) Emerging Markets Debt (Hard Currency)	-	0,15	-	0,25	0,25	0,25	-	0,25	-	-	-	-	0,25	0,25	0,08	0,00
NN (L) Emerging Markets Debt (Local Bond)	-	0,15	-	0,25	-	0,25	-	0,25	-	-	-	-	0,25	-	-	0,00
NN (L) Emerging Markets Debt (Local Currency)	-	0,15	-	0,25	-	0,25	-	0,25	-	-	-	-	0,25	-	0,08	0,00
NN (L) Emerging Markets Debt Short Duration (Hard Currency)	-	0,15	-	-	-	0,20	-	-	-	-	-	-	-	-	0,15	-
NN (L) Emerging Markets Enhanced Index Sustainable Equity	-	0,15	-	0,20	-	0,20	-	0,20	-	-	-	-	0,20	0,20	0,15	-
NN (L) Emerging Markets High Dividend	-	0,25	-	0,35	-	0,35	-	0,35	-	-	-	-	0,35	0,35	-	0,00
NN (L) Energy	-	0,20	-	-	-	0,25	-	0,25	-	-	-	-	0,25	0,25	-	-
NN (L) Euro Covered Bond	-	0,12	-	0,15	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0,065	0,00
NN (L) Euro Credit	-	0,12	-	-	-	0,15	0,12	0,15	-	-	-	0,12	0,15	-	0,12	-

## Erläuterungen zu den Finanzabschlüssen (Fortsetzung)

Teilfonds	Feste Servicegebühr (p.a.)															
	Klasse D (in %)	Klasse I (in %)	Klasse M (in %)	Klasse N (in %)	Klasse O (in %)	Klasse P (in %)	Klasse Q (in %)	Klasse R (in %)	Klasse S (in %)	Klasse T (in %)	Klasse U (in %)	Klasse V (in %)	Klasse X (in %)	Klasse Y* (in %)	Klasse Z** (in %)	Klasse Zz** (in %)
NN (L) EURO Equity	-	0,20	-	-	-	0,25	-	0,25	-	-	-	0,20	0,25	-	-	-
NN (L) Euro Fixed Income	-	0,12	-	0,15	0,15	0,15	-	0,15	-	-	-	0,12	0,15	-	0,12	-
NN (L) Euro High Dividend	-	0,20	-	0,25	-	0,25	-	0,25	-	-	0,20	0,20	0,25	0,25	0,20	-
NN (L) Euro Income	-	-	-	-	-	0,25	-	0,25	-	-	-	-	0,25	-	-	-
NN (L) Euro Liquidity	-	-	-	0,15	-	0,15	-	0,15	0,12	-	-	-	0,15	-	-	-
NN (L) Euro Long Duration Bond	-	0,12	-	0,15	-	0,15	-	-	-	-	-	-	0,15	-	-	-
NN (L) Euro Short Duration	-	0,12	-	-	-	0,15	-	0,15	-	-	-	-	-	-	0,12	-
NN (L) Euro Sustainable Credit	-	0,12	-	0,15	-	0,15	-	0,15	-	0,12	-	-	0,15	-	0,12	-
NN (L) Euro Sustainable Credit (excluding Financials)	-	0,12	-	0,15	0,15	0,15	-	0,15	-	-	-	-	0,15	-	-	-
NN (L) Euromix Bond	-	0,12	-	0,15	-	0,15	-	0,15	-	-	-	0,12	0,15	-	-	-
NN (L) European ABS	-	0,12	-	0,15	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0,05	-
NN (L) European Enhanced Index Sustainable Equity	-	0,10	-	-	-	0,15	-	0,15	-	-	-	-	0,15	-	0,10	-
NN (L) European Equity	-	0,20	-	0,25	0,25	0,25	-	0,25	-	-	-	-	0,25	-	0,20	-
NN (L) European High Dividend	-	0,20	-	0,25	-	0,25	-	0,25	-	-	-	0,20	0,25	-	-	-
NN (L) European High Yield	-	0,15	-	0,25	-	0,25	-	0,25	-	-	-	-	0,25	-	0,15	0,00
NN (L) European Participation Equity	-	0,20	-	-	-	0,25	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
NN (L) European Real Estate	-	0,20	-	0,25	-	0,25	-	0,25	-	-	-	-	0,25	-	-	-
NN (L) European Sustainable Equity	-	0,20	-	0,25	-	0,25	-	0,25	-	-	-	-	0,25	-	0,08	0,00
NN (L) First Class Multi Asset	-	0,15	-	0,20	0,20	0,20	-	0,20	-	-	-	-	0,20	0,20	-	0,00
NN (L) First Class Multi Asset Premium	-	0,15	-	0,25	-	0,25	-	-	-	-	-	-	0,25	-	-	-
NN (L) First Class Protection	-	0,15	-	0,20	-	0,20	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
NN (L) First Class Stable Yield Opportunities	0,15	0,12	-	0,15	-	0,15	-	-	-	-	-	-	0,15	-	0,12	-
NN (L) First Class Yield Opportunities	-	0,15	-	0,25	-	0,25	-	-	-	-	-	-	0,25	0,25	0,15	0,00
NN (L) Food & Beverages	-	0,20	-	-	-	0,25	-	0,25	-	-	-	-	0,25	0,25	-	-
NN (L) Frontier Markets Debt (Hard Currency)	-	0,15	-	0,25	-	0,25	-	-	-	-	-	-	0,25	0,25	-	-
NN (L) Global Bond Opportunities	-	0,12	-	0,15	-	0,15	-	0,15	-	-	-	-	0,15	-	-	-
NN (L) Global Convertible Bond	-	0,15	-	-	-	0,25	-	0,25	-	-	-	-	-	-	0,15	-

## Erläuterungen zu den Finanzabschlüssen (Fortsetzung)

Teilfonds	Feste Servicegebühr (p.a.)															
	Klasse D (in %)	Klasse I (in %)	Klasse M (in %)	Klasse N (in %)	Klasse O (in %)	Klasse P (in %)	Klasse Q (in %)	Klasse R (in %)	Klasse S (in %)	Klasse T (in %)	Klasse U (in %)	Klasse V (in %)	Klasse X (in %)	Klasse Y* (in %)	Klasse Z** (in %)	Klasse Zz** (in %)
NN (L) Global Convertible Opportunities	-	0,15	-	0,25	-	0,25	-	0,25	-	-	-	-	0,25	-	0,15	0,00
NN (L) Global Enhanced Index Sustainable Equity	-	0,10	-	-	-	0,15	-	0,15	-	-	-	-	0,15	-	0,10	-
NN (L) Global Equity Impact Opportunities	-	0,20	0,20	0,25	0,25	0,25	-	0,25	-	-	-	-	0,25	-	-	-
NN (L) Global High Dividend	-	0,20	-	-	-	0,25	-	0,25	-	-	-	-	0,25	0,25	-	0,00
NN (L) Global High Yield	-	0,15	-	0,25	-	0,25	-	0,25	-	-	-	-	0,25	0,25	0,06	0,00
NN (L) Global Inflation Linked Bond	-	0,12	-	0,15	-	0,15	-	0,15	-	-	-	-	0,15	-	-	-
NN (L) Global Investment Grade Credit	-	0,12	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0,00
NN (L) Global Real Estate	-	0,20	0,20	-	-	0,25	-	0,25	-	-	-	-	0,25	-	-	0,00
NN (L) Global Sustainable Equity	-	0,20	0,20	0,25	0,25	0,25	-	0,25	-	0,20	-	0,20	0,25	-	0,20	0,00
NN (L) Greater China Equity	-	0,25	-	0,35	0,35	0,35	-	0,35	-	-	-	-	0,35	0,35	-	-
NN (L) Green Bond	-	0,12	-	0,15	-	0,15	-	0,15	-	0,12	-	-	0,15	-	0,12	-
NN (L) Green Bond Short Duration	-	0,12	-	-	-	0,15	-	0,15	-	-	-	-	0,15	-	-	-
NN (L) Health & Well-being	-	0,20	-	0,20	0,20	0,25	-	0,25	-	-	-	-	0,25	-	-	-
NN (L) Health Care	-	0,20	-	-	-	0,25	-	0,25	-	-	-	-	0,25	-	-	-
NN (L) Japan Equity	-	0,20	-	-	-	0,25	-	0,25	-	-	-	0,20	0,25	0,25	0,08	-
NN (L) Multi Asset Factor Opportunities	-	0,20	-	-	-	0,30	-	-	-	-	-	-	-	-	0,20	-
NN (L) Multi Asset High Income	-	0,15	-	-	-	0,25	-	-	-	-	-	-	0,25	-	0,15	-
NN (L) North America Enhanced Index Sustainable Equity	-	0,10	-	-	-	0,15	0,10	0,15	-	-	-	-	0,15	-	0,10	-
NN (L) Smart Connectivity	-	0,20	-	0,20	-	0,25	-	0,25	-	-	-	-	0,25	-	-	-
NN (L) Sovereign Green Bond	-	0,12	-	-	-	0,15	-	0,15/ 0,12 <sup>(1)</sup>	-	-	-	-	0,15	-	0,12	-
NN (L) US Behavioural Equity	-	0,20	-	-	-	0,25	-	0,25	-	-	-	-	-	-	0,20	-
NN (L) US Credit	-	0,12	-	0,15	-	0,15	-	0,15	-	-	-	-	0,15	0,15	0,12	-
NN (L) US Enhanced Core Concentrated Equity	-	0,20	-	-	-	0,25	-	0,25	-	-	-	0,20	0,25	-	-	-
NN (L) US Factor Credit	-	0,12	-	0,15	-	0,15	-	-	-	-	-	-	0,15	-	-	-
NN (L) US High Dividend	-	0,20	-	0,25	-	0,25	-	0,25	-	-	-	-	0,25	0,25	-	-
NN (L) US High Yield	-	0,15	-	-	-	0,25	-	-	-	-	-	-	-	-	0,15	0,00

\* Für diese Anteilsklasse wird eine zusätzliche Vertriebsgebühr von 1,00% p.a. erhoben.

\*\* Für diese Anteilsklasse wird eine Servicegebühr erhoben, durch die die Verwaltungs- und Verwahrungskosten von Vermögenswerten und weitere laufende Betriebs- und Verwaltungskosten beglichen werden.

<sup>(1)</sup> Bei dieser Anteilsklasse bestehen zwei unterschiedliche feste Servicegebühren: 0,15% für thesaurierende und 0,12% für ausschüttende Anteile.



## Erläuterungen zu den Finanzabschlüssen (Fortsetzung)

### 7- OVERLAYGEBÜHREN

Die Verwaltungsgesellschaft hat möglicherweise Anspruch auf eine einheitliche Gebühr für ein Anteilklassen-Overlay von maximal 0,04%, die aus dem Vermögen der betreffenden Anteilsklasse und auf Basis der tatsächlichen Kosten zu zahlen ist. Die Gebühr für ein Anteilklassen-Overlay fällt bei jeder Berechnung des Nettoinventarwerts an und ist insofern als Höchstgebühr festgelegt, als die Verwaltungsgesellschaft beschließen kann, die der jeweiligen Anteilsklasse in Rechnung gestellte Overlaygebühr zu senken, wenn Skaleneffekte dies zulassen.

Die Overlaygebühr gilt für alle Anteilklassen mit Währungsabsicherung und Anteilklassen mit Durationsabsicherung. Im Falle der Anteilklassen „Z“ und „Zz“ können diese Gebühren in der Sondervereinbarung festgelegt sein und werden von der Verwaltungsgesellschaft direkt vom Anteilsinhaber erhoben und eingezogen und nicht der jeweiligen Anteilsklasse in Rechnung gestellt.

Zum 31. März 2022 betrug die Overlaygebühr 0,021%.

### 8- TRANSAKTIONSKOSTEN

Die den Teilfonds der SICAV entstandenen Transaktionskosten umfassen Brokerage-Gebühren im Zusammenhang mit dem Kauf bzw. Verkauf übertragbarer Wertpapiere, Geldmarktinstrumente und derivativer Finanzinstrumente (bzw. anderer zulässiger Vermögenswerte, in denen die Teilfonds Transaktionen tätigen) und/oder gegebenenfalls Gebühren aus der Zeichnung/Rückgabe von Anteilen/Aktien von OGAW/OGA.

Im Falle von gegenseitigen Anlagen oder Anlagen in Aktien/Anteilen anderer OGAW und/oder anderer OGA, die direkt oder im Auftrag der Verwaltungsgesellschaft verwaltet werden (die „NNIP-Fonds“), gelten keine Transaktionskosten.

Die Transaktionskosten sind ggf. im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten.

Die nachstehende Tabelle zeigt die den einzelnen Teilfonds im Berichtszeitraum zum 31. März 2022 entstandenen Transaktionskosten:

Teilfonds	Währung	Transaktionskosten	Transaktionskosten - Basispunkte (annualisiert)
NN (L) AAA ABS	EUR	-	-
NN (L) Alternative Beta	USD	21.416,00	1,03
NN (L) Asia Income	USD	426.316,00	42,68
NN (L) Asian Debt (Hard Currency)	USD	1.538,00	0,07
NN (L) Asian High Yield	USD	-	-
NN (L) Banking & Insurance	USD	24.900,86	9,00
NN (L) Belgian Government Bond	EUR	32,00	0,02
NN (L) Climate & Environment	EUR	82.642,26	6,95
NN (L) Commodity Enhanced	USD	-	-
NN (L) Corporate Green Bond	EUR	1.670,00	0,06
NN (L) Emerging Europe Equity	EUR	5.838,00	3,61
NN (L) Emerging Markets Corporate Debt	USD	799,00	0,11
NN (L) Emerging Markets Debt (Hard Currency)	USD	50.815,00	0,15
NN (L) Emerging Markets Debt (Local Bond)	USD	169.243,06	8,44
NN (L) Emerging Markets Debt (Local Currency)	USD	1.994,01	0,93
NN (L) Emerging Markets Debt Short Duration (Hard Currency)	USD	142,00	0,03
NN (L) Emerging Markets Enhanced Index Sustainable Equity	USD	822.522,16	22,79
NN (L) Emerging Markets High Dividend	EUR	200.530,00	20,52
NN (L) Energy	USD	47.772,69	7,42
NN (L) Euro Covered Bond	EUR	28,00	0,03
NN (L) Euro Credit	EUR	4.668,00	0,06
NN (L) EURO Equity	EUR	283.412,92	16,73
NN (L) Euro Fixed Income	EUR	15.914,00	0,25

## Erläuterungen zu den Finanzabschlüssen (Fortsetzung)

Teilfonds	Währung	Transaktionskosten	Transaktionskosten - Basispunkte (annualisiert)
NN (L) Euro High Dividend	EUR	1.418.255,24	38,35
NN (L) Euro Income	EUR	27.131,89	15,43
NN (L) Euro Liquidity	EUR	-	-
NN (L) Euro Long Duration Bond	EUR	7.887,00	0,18
NN (L) Euro Short Duration	EUR	988,00	0,11
NN (L) Euro Sustainable Credit	EUR	2.519,00	0,04
NN (L) Euro Sustainable Credit (excluding Financials)	EUR	990,00	0,04
NN (L) Euromix Bond	EUR	2.323,00	0,15
NN (L) European ABS	EUR	-	-
NN (L) European Enhanced Index Sustainable Equity	EUR	542.168,43	47,07
NN (L) European Equity	EUR	195.207,88	19,14
NN (L) European High Dividend	EUR	279.652,01	25,91
NN (L) European High Yield	EUR	278,00	0,04
NN (L) European Participation Equity	EUR	301,58	3,28
NN (L) European Real Estate	EUR	118.699,18	17,56
NN (L) European Sustainable Equity	EUR	143.685,10	4,73
NN (L) First Class Multi Asset	EUR	107.532,54	2,75
NN (L) First Class Multi Asset Premium	EUR	33.298,69	5,50
NN (L) First Class Protection	EUR	1.388,00	0,43
NN (L) First Class Stable Yield Opportunities	EUR	1.402,00	0,54
NN (L) First Class Yield Opportunities	EUR	14.023,00	0,69
NN (L) Food & Beverages	USD	141.535,01	14,28
NN (L) Frontier Markets Debt (Hard Currency)	USD	2.718,00	0,16
NN (L) Global Bond Opportunities	EUR	4.758,00	1,59
NN (L) Global Convertible Bond	USD	75,00	0,02
NN (L) Global Convertible Opportunities	USD	-	-
NN (L) Global Enhanced Index Sustainable Equity	USD	79.748,26	2,01
NN (L) Global Equity Impact Opportunities	EUR	143.167,75	6,12
NN (L) Global High Dividend	EUR	356.981,00	12,84
NN (L) Global High Yield	EUR	937,00	0,01
NN (L) Global Inflation Linked Bond	EUR	3.494,00	0,36
NN (L) Global Investment Grade Credit	USD	2.345,00	0,49
NN (L) Global Real Estate	EUR	110.629,54	12,38
NN (L) Global Sustainable Equity	EUR	266.346,01	2,25
NN (L) Greater China Equity	USD	658.535,00	40,42
NN (L) Green Bond	EUR	5.900,00	0,08
NN (L) Green Bond Short Duration	EUR	2.627,00	0,22
NN (L) Health & Well-being	EUR	46.439,66	2,94
NN (L) Health Care	USD	223.240,25	12,10
NN (L) Japan Equity	JPY	5.258.673,00	5,69
NN (L) Multi Asset Factor Opportunities	USD	211.002,00	12,58
NN (L) Multi Asset High Income	EUR	109,00	0,39
NN (L) North America Enhanced Index Sustainable Equity	USD	45.462,70	1,08
NN (L) Smart Connectivity	EUR	103.459,49	2,69
NN (L) Sovereign Green Bond	EUR	643,00	0,09
NN (L) US Behavioural Equity	USD	19.028,00	9,94
NN (L) US Credit	USD	38.634,00	0,27

## Erläuterungen zu den Finanzabschlüssen (Fortsetzung)

Teilfonds	Währung	Transaktionskosten	Transaktionskosten - Basispunkte (annualisiert)
NN (L) US Enhanced Core Concentrated Equity	USD	94.688,00	4,78
NN (L) US Factor Credit	USD	281,00	0,14
NN (L) US High Dividend	USD	21.111,00	1,26
NN (L) US High Yield	USD	106,00	0,01

### 9- ABONNEMENTSTEUER

Die Gesellschaft unterliegt in Luxemburg einer Abonnementsteuer („Taxe d'abonnement“) von 0,01% p.a. ihres Nettovermögens für sämtliche institutionellen Anlegern vorbehaltenen Anteile sowie alle Anteile des Geldmarktteilfonds NN (L) Euro Liquidity und von 0,05% p.a. für alle anderen Anteile.

Die Abonnementsteuer ist vierteljährlich zu zahlen und wird auf der Grundlage des Nettoinventarwertes am Ende des entsprechenden Quartals berechnet.

Auf Anteile, welche die Gesellschaft in anderen OGAs hält, die dieser Steuer in Luxemburg bereits unterliegen, wird keine Abonnementsteuer gezahlt.

### 10- WERTPAPIER-BESTANDSVERÄNDERUNGEN

Die Auflistung der Bestandsveränderungen steht den Anteilsinhabern bei der Depotbank und am Sitz der Gesellschaft sowie an den Schaltern der in diesem Bericht aufgeführten lokalen Vertriebsstellen oder Hauptansprechpartnern in der Kundenbetreuung zur Verfügung. Darüber hinaus werden sie auf Anfrage kostenlos versandt.

### 11- INFORMATION FÜR DIE ANTEILSINHABER

Gemäß dem belgischen Programmgesetz vom 22. Dezember 2003, das am 1. Januar 2004 in Kraft trat, ist auf den Anteil belgischer Anleger am Fondsvermögen, der am 31. Dezember des vorangehenden Berichtsjahres investiert war, eine Steuer von 0,06% p.a. zu zahlen. Die Steuer wurde 2005 auf 0,07% p.a., 2007 auf 0,08% p.a., 2013 auf 0,0965% erhöht. Ab 2014 wurde sie auf 0,0925% gesenkt.

Die Gesellschaft hat bei der Europäischen Kommission eine Beschwerde gegen den belgischen Staat eingereicht, um die Unvereinbarkeit dieser Steuer mit dem Gemeinschaftsrecht feststellen zu lassen. Die Europäische Kommission hat diese Beschwerde zurückgewiesen. Die Gesellschaft hat in Belgien eine weitere Beschwerde eingereicht. Das Brüsseler Gericht erster Instanz hat den belgischen Staat daraufhin zur Erstattung der rechtsgrundlos geleisteten Zahlungen verurteilt. Der belgische Staat legte Rechtsmittel gegen das Urteil ein. Das Brüsseler Appellationsgericht verkündete am 29. November 2018 sein Urteil. Das erstinstanzliche Urteil wurde bestätigt, das den belgischen Staat zur Erstattung der jährlich vom Luxemburger Fonds erhobenen belgischen Steuer verurteilte. Der belgische Staat legte beim obersten Gerichtshof Belgiens Rechtsmittel gegen das Urteil des Appellationsgerichts ein. Am 25. März 2022 fand eine Verhandlung vor dem obersten Gerichtshof statt. Die Gerichtsentscheidung wurde am 13. April 2022 veröffentlicht. Die Entscheidung des obersten Gerichtshofs fiel nicht zugunsten der klagenden Luxemburger Fonds aus, zu denen die Gesellschaft gehört. Das positive Urteil des erstinstanzlichen Brüsseler Gerichts wurde aufgehoben. Das bedeutet, dass der belgische Staat die jährlich erhobene Steuer nicht zurückerstatten muss. Die Verwaltungsgesellschaft der Gesellschaft prüft derzeit das Urteil des obersten Gerichtshofs, um abzuschätzen, ob weitere gerichtliche Schritte möglich sind.

### 12- SICHERHEITEN IM ZUSAMMENHANG MIT AUßERBÖRSLICH GEHANDELTEN DERIVATIVEN FINANZINSTRUMENTEN

Zur Reduzierung des Gegenparteirisikos im Zusammenhang mit außerbörslich gehandelten derivativen Finanzinstrumenten hat die Gesellschaft von den unten aufgeführten Gegenparteien Sicherheiten (*Collaterals*) erhalten bzw. diesen Sicherheiten gestellt.

## Erläuterungen zu den Finanzabschlüssen (Fortsetzung)

Zum 31. März 2022 belief sich der Wert der erhaltenen/(gestellten) Sicherheiten auf folgende Beträge:

Teilfonds	Gegenpartei	Art der Sicherheiten	Währung	Erhaltene/(gestellte) Sicherheiten gesamt
NN (L) AAA ABS	Goldman Sachs	Barmittel	EUR	490.000,00
			<b>Gesamt</b>	<b>490.000,00</b>

Teilfonds	Gegenpartei	Art der Sicherheiten	Währung	Erhaltene/(gestellte) Sicherheiten gesamt
NN (L) Alternative Beta	Goldman Sachs	Barmittel	USD	1.100.000,00
	JP Morgan Chase Bank	Barmittel	USD	(1.200.000,00)
	State Street Bank	Barmittel	USD	(330.000,00)
			<b>Gesamt</b>	<b>(430.000,00)</b>

Teilfonds	Gegenpartei	Art der Sicherheiten	Währung	Erhaltene/(gestellte) Sicherheiten gesamt
NN (L) Asia Income	Bank of America	Barmittel	USD	(50.000,00)
	BNP Paribas	Barmittel	USD	(290.000,01)
			<b>Gesamt</b>	<b>(340.000,01)</b>

Teilfonds	Gegenpartei	Art der Sicherheiten	Währung	Erhaltene/(gestellte) Sicherheiten gesamt
NN (L) Asian Debt (Hard Currency)	State Street Bank	Barmittel	USD	1.290.000,00
			<b>Gesamt</b>	<b>1.290.000,00</b>

Teilfonds	Gegenpartei	Art der Sicherheiten	Währung	Erhaltene/(gestellte) Sicherheiten gesamt
NN (L) Banking & Insurance	State Street Bank	Barmittel	USD	(60.000,00)
			<b>Gesamt</b>	<b>(60.000,00)</b>

Teilfonds	Gegenpartei	Art der Sicherheiten	Währung	Erhaltene/(gestellte) Sicherheiten gesamt
NN (L) Climate & Environment	State Street Bank	Barmittel	EUR	1.024.580,95
			<b>Gesamt</b>	<b>1.024.580,95</b>

Teilfonds	Gegenpartei	Art der Sicherheiten	Währung	Erhaltene/(gestellte) Sicherheiten gesamt
NN (L) Commodity Enhanced	Goldman Sachs	Barmittel	USD	24.240.000,00
	Société Générale	Barmittel	USD	10.920.000,00
	State Street Bank	Barmittel	USD	8.760.000,00
			<b>Gesamt</b>	<b>43.920.000,00</b>

## Erläuterungen zu den Finanzabschlüssen (Fortsetzung)

Teilfonds	Gegenpartei	Art der Sicherheiten	Währung	Erhaltene/(gestellte) Sicherheiten gesamt
NN (L) Emerging Markets Debt (Hard Currency)	Barclays	Barmittel	USD	860.000,00
	BNP Paribas	Barmittel	USD	1.150.000,00
	JP Morgan Chase Bank	Barmittel	USD	(462.132,00)
	Morgan Stanley	Barmittel	USD	4.360.000,00
	State Street Bank	Barmittel	USD	14.950.000,00
	<b>Gesamt</b>			<b>20.857.868,00</b>

Teilfonds	Gegenpartei	Art der Sicherheiten	Währung	Erhaltene/(gestellte) Sicherheiten gesamt
NN (L) Emerging Markets Debt (Local Bond)	BNP Paribas	Barmittel	USD	60.000,00
	Deutsche Bank	Barmittel	USD	(60.000,00)
	HSBC Continental	Barmittel	USD	490.000,00
	JP Morgan Chase Bank	Barmittel	USD	210.000,00
	Morgan Stanley	Barmittel	USD	(199.999,99)
	Société Générale	Barmittel	USD	(80.000,00)
	State Street Bank	Barmittel	USD	0,01
	<b>Gesamt</b>			<b>420.000,02</b>

Teilfonds	Gegenpartei	Art der Sicherheiten	Währung	Erhaltene/(gestellte) Sicherheiten gesamt
NN (L) Emerging Markets Debt (Local Currency)	Bank of America	Barmittel	USD	(280.000,00)
	HSBC Continental	Barmittel	USD	(180.000,00)
	Morgan Stanley	Barmittel	USD	(10.000,00)
	Société Générale	Barmittel	USD	40.000,00
	<b>Gesamt</b>			<b>(430.000,00)</b>

Teilfonds	Gegenpartei	Art der Sicherheiten	Währung	Erhaltene/(gestellte) Sicherheiten gesamt
NN (L) Emerging Markets Debt Short Duration (Hard Currency)	Citigroup	Barmittel	USD	30.000,00
	<b>Gesamt</b>			<b>30.000,00</b>

Teilfonds	Gegenpartei	Art der Sicherheiten	Währung	Erhaltene/(gestellte) Sicherheiten gesamt
NN (L) Emerging Markets Enhanced Index Sustainable	State Street Bank	Barmittel	USD	570.000,00
	<b>Gesamt</b>			<b>570.000,00</b>

Teilfonds	Gegenpartei	Art der Sicherheiten	Währung	Erhaltene/(gestellte) Sicherheiten gesamt
NN (L) Emerging Markets High Dividend	State Street Bank	Barmittel	EUR	668.000,00
	<b>Gesamt</b>			<b>668.000,00</b>

## Erläuterungen zu den Finanzabschlüssen (Fortsetzung)

Teilfonds	Gegenpartei	Art der Sicherheiten	Währung	Erhaltene/(gestellte) Sicherheiten gesamt
NN (L) Energy	State Street Bank	Barmittel	USD	260.360,10
			<b>Gesamt</b>	<b>260.360,10</b>

Teilfonds	Gegenpartei	Art der Sicherheiten	Währung	Erhaltene/(gestellte) Sicherheiten gesamt
NN (L) Euro Credit	Barclays	Barmittel	EUR	(970.000,01)
	BNP Paribas	Barmittel	EUR	210.000,00
	Citigroup	Barmittel	EUR	(50.000,00)
	Goldman Sachs	Barmittel	EUR	(570.000,00)
	JP Morgan Chase Bank	Barmittel	EUR	(1.320.000,00)
	Morgan Stanley	Barmittel	EUR	(1.890.000,00)
	State Street Bank	Barmittel	EUR	236.000,00
	UBS AG	Barmittel	EUR	(620.000,00)
			<b>Gesamt</b>	<b>(4.974.000,01)</b>

Teilfonds	Gegenpartei	Art der Sicherheiten	Währung	Erhaltene/(gestellte) Sicherheiten gesamt
NN (L) EURO Equity	State Street Bank	Barmittel	EUR	1.149.000,00
			<b>Gesamt</b>	<b>1.149.000,00</b>

Teilfonds	Gegenpartei	Art der Sicherheiten	Währung	Erhaltene/(gestellte) Sicherheiten gesamt
NN (L) Euro Fixed Income	Bank of America	Barmittel	EUR	10.000,00
	Bank of New York Mellon	Barmittel	EUR	(4.380.000,01)
	Barclays	Barmittel	EUR	(1.500.000,00)
	BNP Paribas	Barmittel	EUR	(17.530.000,01)
	Citigroup	Barmittel	EUR	(2.560.000,00)
	Goldman Sachs	Barmittel	EUR	(7.159.999,99)
	HSBC Continental	Barmittel	EUR	130.000,00
	JP Morgan Chase Bank	Barmittel	EUR	(1.150.000,00)
Morgan Stanley	Barmittel	EUR	250.000,00	
			<b>Gesamt</b>	<b>(33.890.000,01)</b>

Teilfonds	Gegenpartei	Art der Sicherheiten	Währung	Erhaltene/(gestellte) Sicherheiten gesamt
NN (L) Euro High Dividend	State Street Bank	Barmittel	EUR	354.000,00
			<b>Gesamt</b>	<b>354.000,00</b>

Teilfonds	Gegenpartei	Art der Sicherheiten	Währung	Erhaltene/(gestellte) Sicherheiten gesamt
NN (L) Euro Long Duration Bond	Barclays	Barmittel	EUR	(810.000,00)
	BNP Paribas	Barmittel	EUR	(8.949.999,97)
	Goldman Sachs	Barmittel	EUR	(4.690.000,00)
	JP Morgan Chase Bank	Barmittel	EUR	(450.000,00)
			<b>Gesamt</b>	<b>(14.899.999,97)</b>

## Erläuterungen zu den Finanzabschlüssen (Fortsetzung)

Teilfonds	Gegenpartei	Art der Sicherheiten	Währung	Erhaltene/(gestellte) Sicherheiten gesamt
NN (L) Euro Sustainable Credit	Barclays	Barmittel	EUR	(890.000,00)
	BNP Paribas	Barmittel	EUR	(260.000,00)
	JP Morgan Chase Bank	Barmittel	EUR	(400.000,00)
	Morgan Stanley	Barmittel	EUR	(270.000,00)
			<b>Gesamt</b>	<b>(1.820.000,00)</b>

Teilfonds	Gegenpartei	Art der Sicherheiten	Währung	Erhaltene/(gestellte) Sicherheiten gesamt
NN (L) Euro Sustainable Credit (excluding Financials)	Barclays	Barmittel	EUR	(260.000,00)
	BNP Paribas	Barmittel	EUR	120.000,00
	Deutsche Bank	Barmittel	EUR	(150.000,00)
			<b>Gesamt</b>	<b>(290.000,00)</b>

Teilfonds	Gegenpartei	Art der Sicherheiten	Währung	Erhaltene/(gestellte) Sicherheiten gesamt
NN (L) European Equity	State Street Bank	Barmittel	EUR	236.000,00
			<b>Gesamt</b>	<b>236.000,00</b>

Teilfonds	Gegenpartei	Art der Sicherheiten	Währung	Erhaltene/(gestellte) Sicherheiten gesamt
NN (L) European High Dividend	State Street Bank	Barmittel	EUR	243.000,00
			<b>Gesamt</b>	<b>243.000,00</b>

Teilfonds	Gegenpartei	Art der Sicherheiten	Währung	Erhaltene/(gestellte) Sicherheiten gesamt
NN (L) European High Yield	Barclays	Barmittel	EUR	(320.000,00)
			<b>Gesamt</b>	<b>(320.000,00)</b>

Teilfonds	Gegenpartei	Art der Sicherheiten	Währung	Erhaltene/(gestellte) Sicherheiten gesamt
NN (L) First Class Multi Asset	Bank of America	Barmittel	EUR	(650.000,00)
	Barclays	Barmittel	EUR	(1.020.000,00)
	BNP Paribas	Barmittel	EUR	(5.020.000,03)
	Deutsche Bank	Barmittel	EUR	10.000,00
	JP Morgan Chase Bank	Barmittel	EUR	(520.000,00)
	Morgan Stanley	Barmittel	EUR	(40.000,00)
	Société Générale	Barmittel	EUR	10.000,00
	State Street Bank	Barmittel	EUR	1.248.000,00
			<b>Gesamt</b>	<b>(5.982.000,03)</b>

## Erläuterungen zu den Finanzabschlüssen (Fortsetzung)

Teilfonds	Gegenpartei	Art der Sicherheiten	Währung	Erhaltene/(gestellte) Sicherheiten gesamt
NN (L) First Class Multi Asset Premium	Barclays	Barmittel	EUR	(260.000,00)
	BNP Paribas	Barmittel	EUR	(520.000,00)
	Deutsche Bank	Barmittel	EUR	170.000,00
	State Street Bank	Barmittel	EUR	(254.000,00)
			<b>Gesamt</b>	<b>(864.000,00)</b>

Teilfonds	Gegenpartei	Art der Sicherheiten	Währung	Erhaltene/(gestellte) Sicherheiten gesamt
NN (L) First Class Stable Yield Opportunities	Bank of America	Barmittel	EUR	(10.000,00)
	Barclays	Barmittel	EUR	(1.440.000,00)
			<b>Gesamt</b>	<b>(1.450.000,00)</b>

Teilfonds	Gegenpartei	Art der Sicherheiten	Währung	Erhaltene/(gestellte) Sicherheiten gesamt
NN (L) First Class Yield Opportunities	Barclays	Barmittel	EUR	(3.840.000,01)
	JP Morgan Chase Bank	Barmittel	EUR	(1.020.000,00)
	Morgan Stanley	Barmittel	EUR	240.000,00
	State Street Bank	Barmittel	EUR	1.164.000,00
			<b>Gesamt</b>	<b>(3.456.000,01)</b>

Teilfonds	Gegenpartei	Art der Sicherheiten	Währung	Erhaltene/(gestellte) Sicherheiten gesamt
NN (L) Frontier Markets Debt (Hard Currency)	BNP Paribas	Barmittel	USD	30.000,00
	Morgan Stanley	Barmittel	USD	60.000,00
			<b>Gesamt</b>	<b>90.000,00</b>

Teilfonds	Gegenpartei	Art der Sicherheiten	Währung	Erhaltene/(gestellte) Sicherheiten gesamt
NN (L) Global Bond Opportunities	Bank of America	Barmittel	EUR	(280.000,00)
	BNP Paribas	Barmittel	EUR	(1.410.000,00)
	Goldman Sachs	Barmittel	EUR	(1.030.000,00)
	HSBC Continental	Barmittel	EUR	50.000,00
	JP Morgan Chase Bank	Barmittel	EUR	(330.000,01)
	Morgan Stanley	Barmittel	EUR	210.000,00
	State Street Bank	Barmittel	EUR	288.000,00
	UBS AG	Barmittel	EUR	430.000,00
			<b>Gesamt</b>	<b>(2.072.000,01)</b>

Teilfonds	Gegenpartei	Art der Sicherheiten	Währung	Erhaltene/(gestellte) Sicherheiten gesamt
NN (L) Global Convertible Bond	Goldman Sachs	Barmittel	USD	440.000,00
	Morgan Stanley	Barmittel	USD	60.000,00
			<b>Gesamt</b>	<b>500.000,00</b>



## Erläuterungen zu den Finanzabschlüssen (Fortsetzung)

Teilfonds	Gegenpartei	Art der Sicherheiten	Währung	Erhaltene/(gestellte) Sicherheiten gesamt
NN (L) Global Convertible Opportunities	Bank of America	Barmittel	USD	(70.000,00)
	Barclays	Barmittel	USD	(260.000,00)
	Goldman Sachs	Barmittel	USD	3.600.000,00
	JP Morgan Chase Bank	Barmittel	USD	600.000,00
	Morgan Stanley	Barmittel	USD	580.000,00
	Société Générale	Barmittel	USD	160.000,00
	State Street Bank	Barmittel	USD	(1.280.000,03)
	<b>Gesamt</b>			<b>3.329.999,97</b>

Teilfonds	Gegenpartei	Art der Sicherheiten	Währung	Erhaltene/(gestellte) Sicherheiten gesamt
NN (L) Global Equity Impact Opportunities	State Street Bank	Barmittel	EUR	2.049.161,91
	<b>Gesamt</b>			<b>2.049.161,91</b>

Teilfonds	Gegenpartei	Art der Sicherheiten	Währung	Erhaltene/(gestellte) Sicherheiten gesamt
NN (L) Global High Dividend	State Street Bank	Barmittel	EUR	6.091.000,00
	UBS AG	Barmittel	EUR	1.420.000,00
	<b>Gesamt</b>			<b>7.511.000,00</b>

Teilfonds	Gegenpartei	Art der Sicherheiten	Währung	Erhaltene/(gestellte) Sicherheiten gesamt
NN (L) Global High Yield	Barclays	Barmittel	EUR	900.000,00
	BNP Paribas	Barmittel	EUR	600.000,00
	Deutsche Bank	Barmittel	EUR	590.000,00
	HSBC Continental	Barmittel	EUR	(180.000,00)
	JP Morgan Chase Bank	Barmittel	EUR	270.000,00
	Morgan Stanley	Barmittel	EUR	(900.000,00)
	Société Générale	Barmittel	EUR	(99.999,99)
	State Street Bank	Barmittel	EUR	9.318.000,00
	<b>Gesamt</b>			<b>10.498.000,01</b>

Teilfonds	Gegenpartei	Art der Sicherheiten	Währung	Erhaltene/(gestellte) Sicherheiten gesamt
NN (L) Global Inflation Linked Bond	BNP Paribas	Barmittel	EUR	(820.000,00)
	Goldman Sachs	Barmittel	EUR	(600.000,00)
	HSBC Continental	Barmittel	EUR	10.000,00
	JP Morgan Chase Bank	Barmittel	EUR	20.000,00
	State Street Bank	Barmittel	EUR	951.000,00
	UBS AG	Barmittel	EUR	270.000,00
	<b>Gesamt</b>			<b>(169.000,00)</b>

Teilfonds	Gegenpartei	Art der Sicherheiten	Währung	Erhaltene/(gestellte) Sicherheiten gesamt
NN (L) Global Investment Grade Credit	Barclays	Barmittel	USD	20.000,00
	<b>Gesamt</b>			<b>20.000,00</b>

## Erläuterungen zu den Finanzabschlüssen (Fortsetzung)

Teilfonds	Gegenpartei	Art der Sicherheiten	Währung	Erhaltene/(gestellte) Sicherheiten gesamt
NN (L) Global Sustainable Equity	State Street Bank	Barmittel	EUR	1.305.000,00
			<b>Gesamt</b>	<b>1.305.000,00</b>

Teilfonds	Gegenpartei	Art der Sicherheiten	Währung	Erhaltene/(gestellte) Sicherheiten gesamt
NN (L) Green Bond	Barclays	Barmittel	EUR	(1.059.999,99)
			<b>Gesamt</b>	<b>(1.059.999,99)</b>

Teilfonds	Gegenpartei	Art der Sicherheiten	Währung	Erhaltene/(gestellte) Sicherheiten gesamt
NN (L) Green Bond Short Duration	Goldman Sachs	Barmittel	EUR	(270.000,00)
			<b>Gesamt</b>	<b>(270.000,00)</b>

Teilfonds	Gegenpartei	Art der Sicherheiten	Währung	Erhaltene/(gestellte) Sicherheiten gesamt
NN (L) Health Care	State Street Bank	Barmittel	USD	1.220.000,00
			<b>Gesamt</b>	<b>1.220.000,00</b>

Teilfonds	Gegenpartei	Art der Sicherheiten	Währung	Erhaltene/(gestellte) Sicherheiten gesamt
NN (L) Japan Equity	State Street Bank	Barmittel	JPY	6.251.000,00
			<b>Gesamt</b>	<b>6.251.000,00</b>

Teilfonds	Gegenpartei	Art der Sicherheiten	Währung	Erhaltene/(gestellte) Sicherheiten gesamt
NN (L) Multi Asset Factor Opportunities	Bank of America	Barmittel	USD	5.020.000,00
	Barclays	Barmittel	USD	350.000,00
	BNP Paribas	Barmittel	USD	1.840.000,00
	HSBC Continental	Barmittel	USD	(7.169.999,99)
	JP Morgan Chase Bank	Barmittel	USD	(1.210.000,00)
	Morgan Stanley	Barmittel	USD	(660.000,00)
	Société Générale	Barmittel	USD	(7.570.000,01)
			<b>Gesamt</b>	<b>(9.400.000,00)</b>

Teilfonds	Gegenpartei	Art der Sicherheiten	Währung	Erhaltene/(gestellte) Sicherheiten gesamt
NN (L) North America Enhanced Index Sustainable Equity	State Street Bank	Barmittel	USD	(850.000,00)
			<b>Gesamt</b>	<b>(850.000,00)</b>

Teilfonds	Gegenpartei	Art der Sicherheiten	Währung	Erhaltene/(gestellte) Sicherheiten gesamt
NN (L) Smart Connectivity	State Street Bank	Barmittel	EUR	260.639,02
			<b>Gesamt</b>	<b>260.639,02</b>

## Erläuterungen zu den Finanzabschlüssen (Fortsetzung)

Teilfonds	Gegenpartei	Art der Sicherheiten	Währung	Erhaltene/(gestellte) Sicherheiten gesamt
NN (L) US Credit	State Street Bank	Barmittel	USD	(4.590.000,03)
			<b>Gesamt</b>	<b>(4.590.000,03)</b>

Teilfonds	Gegenpartei	Art der Sicherheiten	Währung	Erhaltene/(gestellte) Sicherheiten gesamt
NN (L) US Enhanced Core Concentrated Equity	State Street Bank	Barmittel	USD	1.380.000,00
			<b>Gesamt</b>	<b>1.380.000,00</b>

Teilfonds	Gegenpartei	Art der Sicherheiten	Währung	Erhaltene/(gestellte) Sicherheiten gesamt
NN (L) US High Dividend	State Street Bank	Barmittel	USD	2.850.000,00
			<b>Gesamt</b>	<b>2.850.000,00</b>

Teilfonds	Gegenpartei	Art der Sicherheiten	Währung	Erhaltene/(gestellte) Sicherheiten gesamt
NN (L) US High Yield	Goldman Sachs	Barmittel	USD	450.000,00
	JP Morgan Chase Bank	Barmittel	USD	(40.000,00)
			<b>Gesamt</b>	<b>410.000,00</b>

Die gestellten Barsicherheiten sind im Posten „Sonstige Vermögenswerte“ enthalten.  
Die erhaltenen Barsicherheiten sind im Posten „Sonstige Verbindlichkeiten“ enthalten.

### 13- VERORDNUNG ÜBER WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTE

Die Verordnung über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte („SFTR“) führt im Rahmen der Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften und der Weiterverwendung Berichtspflichten für Wertpapierfinanzierungsgeschäfte („SFTs“) und Gesamtrendite-Swaps (Total Return Swaps) ein.

## Erläuterungen zu den Finanzabschlüssen

Ein Wertpapierfinanzierungsgeschäft (SFT) ist gemäß Artikel 3 Absatz 11 der SFTR definiert als:

- ein Pensionsgeschäft (Repo- oder Reverse Repo-Geschäft);
- ein Wertpapier- oder Warenleihgeschäft;
- ein Kauf-/Rückverkaufgeschäft oder ein Verkauf-/Rückkaufgeschäft;
- ein Lombardgeschäft.

Per 31. März 2022 bestanden folgende Arten von Wertpapierfinanzierungsgeschäften gemäß SFTR bei den Teilfonds: Wertpapierleihgeschäfte und Total Return Swaps.

### Allgemeine Angaben

Der Betrag der Vermögenswerte, die bei allen Wertpapierleihgeschäften eingesetzt worden sind, beläuft sich zum 31. März 2022 auf:

Teilfonds	Art des Vermögenswerts	Währung	Marktwert	% des verwalteten Vermögens	% der verleihbaren Vermögenswerte
NN (L) Asian Debt (Hard Currency)	Wertpapierleihgeschäfte	USD	2.132.913,25	0,65	0,70
NN (L) Asian High Yield	Wertpapierleihgeschäfte	USD	2.852.748,49	1,75	1,88
NN (L) Emerging Markets Debt (Hard Currency)	Wertpapierleihgeschäfte	USD	79.994.809,69	1,41	1,54
NN (L) European High Dividend	Wertpapierleihgeschäfte	EUR	591.250,00	0,28	0,29
NN (L) European High Yield	Wertpapierleihgeschäfte	EUR	12.119.039,37	7,92	8,28
NN (L) First Class Yield Opportunities	Wertpapierleihgeschäfte	EUR	4.793.882,73	1,32	1,44
NN (L) Frontier Markets Debt (Hard Currency)	Wertpapierleihgeschäfte	USD	2.517.882,76	0,91	1,01
NN (L) Global High Dividend	Wertpapierleihgeschäfte	EUR	12.832.936,85	2,02	2,07
NN (L) Global High Yield	Wertpapierleihgeschäfte	EUR	123.366.110,31	4,75	4,96
NN (L) Greater China Equity	Wertpapierleihgeschäfte	USD	1.425.504,47	0,61	0,61
NN (L) US High Yield	Wertpapierleihgeschäfte	USD	8.809.045,35	2,70	2,91

Der Betrag der Vermögenswerte, die bei Total Return Swaps eingesetzt worden sind, beläuft sich zum 31. März 2022 auf:

Teilfonds	Art des Vermögenswerts	Währung	Marktwert	% des verwalteten Vermögens
NN (L) Commodity Enhanced	Total Return Swaps	USD	29.969.517,40	7,82
NN (L) Euro Fixed Income	Total Return Swaps	EUR	(4.105.591,06)	(0,35)
NN (L) Multi Asset Factor Opportunities	Total Return Swaps	USD	6.460.818,58	1,89

### Angaben zur Weiterverwendung von Sicherheiten

In dem am 31. März 2022 beendeten Berichtszeitraum wurden keine Sicherheiten weiterverwendet.

### Angaben zur Konzentration

Die zehn wichtigsten Emittenten erhaltener Sicherheiten für alle Wertpapierfinanzierungsgeschäfte insgesamt waren zum 31. März 2022 folgende:

Teilfonds	Sicherheitenemittent	Währung	Marktwert der erhaltenen Sicherheiten
NN (L) Asian Debt (Hard Currency)	Britischer Staat	USD	2.043.938,79
	Belgischer Staat	USD	353.044,84
	US-amerikanischer Staat	USD	77.920,31
NN (L) Asian High Yield	US-amerikanischer Staat	USD	2.177.744,39
	Französischer Staat	USD	1.180.168,25
	Belgischer Staat	USD	117,98

## Erläuterungen zu den Finanzabschlüssen (Fortsetzung)

Teilfonds	Sicherheitenemittent	Währung	Marktwert der erhaltenen Sicherheiten
NN (L) Emerging Markets Debt (Hard Currency)	Französischer Staat	USD	40.518.658,20
	US-amerikanischer Staat	USD	34.439.979,69
	Belgischer Staat	USD	26.729.017,61
	Deutscher Staat	USD	1.514.832,18
	Niederländischer Staat	USD	389.820,64
	Britischer Staat	USD	121.746,61
NN (L) European High Dividend	US-amerikanischer Staat	EUR	674.252,84
NN (L) European High Yield	US-amerikanischer Staat	EUR	12.269.591,18
	Französischer Staat	EUR	1.170.908,65
	Niederländischer Staat	EUR	438.744,81
NN (L) First Class Yield Opportunities	Britischer Staat	EUR	3.090.675,44
	US-amerikanischer Staat	EUR	2.481.181,16
NN (L) Frontier Markets Debt (Hard Currency)	Französischer Staat	USD	1.852.508,70
	US-amerikanischer Staat	USD	1.043.933,83
	Niederländischer Staat	USD	7.843,65
	Britischer Staat	USD	7.779,19
	Deutscher Staat	USD	7.525,03
	Belgischer Staat	USD	1,20
NN (L) Global High Dividend	US-amerikanischer Staat	EUR	14.169.752,18
NN (L) Global High Yield	Britischer Staat	EUR	61.613.617,17
	US-amerikanischer Staat	EUR	57.667.810,23
	Niederländischer Staat	EUR	15.828.081,27
	Belgischer Staat	EUR	2.762.306,13
	Französischer Staat	EUR	2.734.900,63
NN (L) Greater China Equity	Kanadischer Staat	USD	1.584.385,08
NN (L) US High Yield	US-amerikanischer Staat	USD	9.960.353,81

Die wichtigsten Gegenparteien für jede Einzelart von Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps waren zum 31. März 2022 folgende:

Teilfonds	Art des Wertpapiers	Gegenpartei	Währung	Marktwert der erhaltenen Sicherheiten
NN (L) Asian Debt (Hard Currency)	Wertpapierleihgeschäfte	Goldman Sachs International Ltd	USD	2.043.938,79
		Merrill Lynch International	USD	353.044,84
		Barclays Capital Securities Ltd	USD	77.920,31
NN (L) Asian High Yield	Wertpapierleihgeschäfte	Barclays Capital Securities Ltd	USD	1.942.353,61
		Merrill Lynch International	USD	1.180.286,23
		Goldman Sachs International Ltd	USD	235.390,78
NN (L) Emerging Markets Debt (Hard Currency)	Wertpapierleihgeschäfte	Citigroup Global Markets Limited	USD	66.023.820,56
		Barclays Capital Securities Ltd	USD	23.072.249,97
		Merrill Lynch International	USD	5.766.346,69
		Morgan Stanley International	USD	3.826.549,00
		Nomura International PLC	USD	3.004.425,03
		Goldman Sachs International Ltd	USD	1.197.527,19
NN (L) European High Dividend	Wertpapierleihgeschäfte	JP Morgan Securities PLC	USD	823.136,49
		Goldman Sachs International Ltd	EUR	674.252,84

## Erläuterungen zu den Finanzabschlüssen (Fortsetzung)

Teilfonds	Art des Wertpapiers	Gegenpartei	Währung	Marktwert der erhaltenen Sicherheiten
NN (L) European High Yield	Wertpapierleihgeschäfte	Goldman Sachs International Ltd	EUR	7.471.473,63
		Barclays Capital Securities Ltd	EUR	4.271.458,76
		Merrill Lynch International	EUR	1.170.908,65
		JP Morgan Securities PLC	EUR	526.789,18
		Morgan Stanley International	EUR	438.614,42
NN (L) First Class Yield Opportunities	Wertpapierleihgeschäfte	Goldman Sachs International Ltd	EUR	3.090.675,44
		Barclays Capital Securities Ltd	EUR	1.634.230,86
		JP Morgan Securities PLC	EUR	846.950,30
NN (L) Frontier Markets Debt (Hard NN (L) Frontier Markets Debt (Hard Currency)	Wertpapierleihgeschäfte	Citigroup Global Markets Limited	USD	1.417.377,13
		Barclays Capital Securities Ltd	USD	797.755,53
		Merrill Lynch International	USD	470.666,67
		JP Morgan Securities PLC	USD	233.792,27
NN (L) Global High Dividend	Wertpapierleihgeschäfte	Goldman Sachs International Ltd	EUR	11.325.540,96
		Barclays Capital Securities Ltd	EUR	2.844.211,22
NN (L) Global High Yield	Wertpapierleihgeschäfte	Goldman Sachs International Ltd	EUR	61.613.617,18
		Barclays Capital Securities Ltd	EUR	50.714.261,22
		Morgan Stanley International	EUR	16.514.583,33
		JP Morgan Securities PLC	EUR	6.953.549,01
		Merrill Lynch International	EUR	2.762.332,90
		Credit Suisse International	EUR	1.231.633,76
		Nomura International PLC	EUR	816.738,03
NN (L) Greater China Equity	Wertpapierleihgeschäfte	UBS AG	USD	1.584.385,08
NN (L) US High Yield	Wertpapierleihgeschäfte	Goldman Sachs International Ltd	USD	6.448.857,66
		Barclays Capital Securities Ltd	USD	3.511.496,15

Teilfonds	Art des Wertpapiers	Gegenpartei	Währung	Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust)
NN (L) Commodity Enhanced	Total Return Swap	Goldman Sachs International Ltd	USD	20.876.053,19
		Société Générale SA	USD	9.093.464,21
NN (L) Euro Fixed Income	Total Return Swap	NN Re (Netherlands) NV	EUR	(4.105.591,06)
NN (L) Multi Asset Factor Opportunities	Total Return Swap	Société Générale SA	USD	6.460.818,58

### Verwahrung erhaltener Sicherheiten

Alle erhaltenen Sicherheiten wurden zum 31. März 2022 von einer einzigen Depotbank verwahrt: Brown Brothers Harriman (Luxembourg) S.C.A.

## Erläuterungen zu den Finanzabschlüssen (Fortsetzung)

### Aggregierte Transaktionsdaten

Die aggregierten Transaktionsdaten für erhaltende Sicherheiten (einschließlich Barmittel) für jede Einzelart von Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps waren zum 31. März 2022 folgende:

Art des abgesicherten Wertpapiers	Art der Sicherheiten	Währung	Marktwert der erhaltenen Sicherheiten	Qualität	Laufzeit der Sicherheiten	Währung der Sicherheiten	Land, in dem die Gegenpartei niedergelassen ist (nicht der Sicherheit)	Abwicklung und Clearing
<b>NN (L) Asian Debt (Hard Currency)</b>								
<b>Wertpapierleihgeschäfte</b>								
Goldman Sachs International Ltd	Staatsanleihe	USD	2.043.938,79	AA-	Über ein Jahr	GBP	Vereinigtes Königreich	Trilateral
Merrill Lynch International	Staatsanleihe	USD	353.044,84	AA	Über ein Jahr	EUR	Vereinigtes Königreich	Trilateral
Barclays Capital Securities Ltd	Staatsanleihe	USD	77.920,31	AAA	Über ein Jahr	USD	Vereinigtes Königreich	Trilateral
<b>NN (L) Asian High Yield</b>								
<b>Wertpapierleihgeschäfte</b>								
Barclays Capital Securities Ltd	Staatsanleihe	USD	1.942.353,61	AAA	Über ein Jahr	USD	Vereinigtes Königreich	Trilateral
Merrill Lynch International	Staatsanleihe	USD	1.180.286,23	AA	Über ein Jahr	EUR	Vereinigtes Königreich	Trilateral
Goldman Sachs International Ltd	Staatsanleihe	USD	235.390,78	AAA	Über ein Jahr	USD	Vereinigtes Königreich	Trilateral
<b>NN (L) Emerging Markets Debt (Hard Currency)</b>								
<b>Wertpapierleihgeschäfte</b>								
Citigroup Global Markets Limited	Staatsanleihe	USD	36.692.056,43	AA	Über ein Jahr	EUR	Vereinigtes Königreich	Trilateral
Barclays Capital Securities Ltd	Staatsanleihe	USD	23.072.249,97	AAA	Über ein Jahr	USD	Vereinigtes Königreich	Trilateral
Citigroup Global Markets Limited	Staatsanleihe	USD	17.958.297,51	AA-	Über ein Jahr	EUR	Vereinigtes Königreich	Trilateral
Citigroup Global Markets Limited	Staatsanleihe	USD	9.346.965,64	AAA	Über ein Jahr	USD	Vereinigtes Königreich	Trilateral
Merrill Lynch International	Staatsanleihe	USD	5.766.346,69	AA	Über ein Jahr	EUR	Vereinigtes Königreich	Trilateral
Morgan Stanley International	Staatsanleihe	USD	3.826.549,00	AA	Über ein Jahr	EUR	Vereinigtes Königreich	Trilateral
Nomura International PLC	Staatsanleihe	USD	3.004.425,03	AA-	Über ein Jahr	EUR	Vereinigtes Königreich	Trilateral
Citigroup Global Markets Limited	Staatsanleihe	USD	1.904.652,82	AAA	Über ein Jahr	EUR	Vereinigtes Königreich	Trilateral
Goldman Sachs International Ltd	Staatsanleihe	USD	1.197.527,19	AAA	Über ein Jahr	USD	Vereinigtes Königreich	Trilateral
JP Morgan Securities PLC	Staatsanleihe	USD	823.136,49	AAA	Über ein Jahr	USD	Vereinigtes Königreich	Trilateral
Citigroup Global Markets Limited	Staatsanleihe	USD	121.734,37	AA-	Drei Monate bis ein Jahr	GBP	Vereinigtes Königreich	Trilateral
Citigroup Global Markets Limited	Staatsanleihe	USD	100,40	AAA	Drei Monate bis ein Jahr	USD	Vereinigtes Königreich	Trilateral
Citigroup Global Markets Limited	Staatsanleihe	USD	12,24	AA-	Über ein Jahr	GBP	Vereinigtes Königreich	Trilateral

## Erläuterungen zu den Finanzabschlüssen (Fortsetzung)

Art des abgesicherten Wertpapiers	Art der Sicherheiten	Währung	Marktwert der erhaltenen Sicherheiten	Qualität	Laufzeit der Sicherheiten	Währung der Sicherheiten	Land, in dem die Gegenpartei niedergelassen ist (nicht der Sicherheit)	Abwicklung und Clearing
<b>NN (L) Emerging Markets Debt (Hard Currency) (Fortsetzung)</b>								
Citigroup Global Markets Limited	Staatsanleihe	USD	1,15	AA	Eine Woche bis ein Monat	EUR	Vereinigtes Königreich	Trilateral
<b>NN (L) European High Dividend</b>								
<b>Wertpapierleihgeschäfte</b>								
Goldman Sachs International Ltd	Staatsanleihe	EUR	674.252,84	AAA	Über ein Jahr	USD	Vereinigtes Königreich	Trilateral
<b>NN (L) European High Yield</b>								
<b>Wertpapierleihgeschäfte</b>								
Goldman Sachs International Ltd	Staatsanleihe	EUR	7.471.473,63	AAA	Über ein Jahr	USD	Vereinigtes Königreich	Trilateral
Barclays Capital Securities Ltd	Staatsanleihe	EUR	4.271.458,76	AAA	Über ein Jahr	USD	Vereinigtes Königreich	Trilateral
Merrill Lynch International	Staatsanleihe	EUR	1.170.908,65	AA	Über ein Jahr	EUR	Vereinigtes Königreich	Trilateral
JP Morgan Securities PLC	Staatsanleihe	EUR	526.658,79	AAA	Über ein Jahr	USD	Vereinigtes Königreich	Trilateral
Morgan Stanley International	Staatsanleihe	EUR	438.614,42	AAA	Über ein Jahr	EUR	Vereinigtes Königreich	Trilateral
JP Morgan Securities PLC	Staatsanleihe	EUR	130,39	AAA	Über ein Jahr	EUR	Vereinigtes Königreich	Trilateral
<b>NN (L) First Class Yield Opportunities</b>								
<b>Wertpapierleihgeschäfte</b>								
Goldman Sachs International Ltd	Staatsanleihe	EUR	3.090.675,44	AA-	Über ein Jahr	GBP	Vereinigtes Königreich	Trilateral
Barclays Capital Securities Ltd	Staatsanleihe	EUR	1.634.230,86	AAA	Über ein Jahr	USD	Vereinigtes Königreich	Trilateral
JP Morgan Securities PLC	Staatsanleihe	EUR	846.950,30	AAA	Über ein Jahr	USD	Vereinigtes Königreich	Trilateral
<b>NN (L) Frontier Markets Debt (Hard Currency)</b>								
<b>Wertpapierleihgeschäfte</b>								
Citigroup Global Markets Limited	Staatsanleihe	USD	1.381.842,03	AA	Über ein Jahr	EUR	Vereinigtes Königreich	Trilateral
Barclays Capital Securities Ltd	Staatsanleihe	USD	797.755,53	AAA	Über ein Jahr	USD	Vereinigtes Königreich	Trilateral
Merrill Lynch International	Staatsanleihe	USD	470.666,67	AA	Über ein Jahr	EUR	Vereinigtes Königreich	Trilateral
JP Morgan Securities PLC	Staatsanleihe	USD	233.792,27	AAA	Über ein Jahr	USD	Vereinigtes Königreich	Trilateral
Citigroup Global Markets Limited	Staatsanleihe	USD	15.365,33	AAA	Über ein Jahr	EUR	Vereinigtes Königreich	Trilateral
Citigroup Global Markets Limited	Staatsanleihe	USD	12.386,03	AAA	Über ein Jahr	USD	Vereinigtes Königreich	Trilateral
Citigroup Global Markets Limited	Staatsanleihe	USD	7.773,94	AA-	Drei Monate bis ein Jahr	GBP	Vereinigtes Königreich	Trilateral
Citigroup Global Markets Limited	Staatsanleihe	USD	5,25	AA-	Über ein Jahr	GBP	Vereinigtes Königreich	Trilateral



## Erläuterungen zu den Finanzabschlüssen (Fortsetzung)

Art des abgesicherten Wertpapiers	Art der Sicherheiten	Währung	Marktwert der erhaltenen Sicherheiten	Qualität	Laufzeit der Sicherheiten	Währung der Sicherheiten	Land, in dem die Gegenpartei niedergelassen ist (nicht der Sicherheit)	Abwicklung und Clearing
<b>NN (L) Frontier Markets Debt (Hard Currency) (Fortsetzung)</b>								
Citigroup Global Markets Limited	Staatsanleihe	USD	3,35	AAA	Drei Monate bis ein Jahr	EUR	Vereinigtes Königreich	Trilateral
Citigroup Global Markets Limited	Staatsanleihe	USD	1,20	AA-	Über ein Jahr	EUR	Vereinigtes Königreich	Trilateral
<b>NN (L) Global High Dividend</b>								
<b>Wertpapierleihgeschäfte</b>								
Goldman Sachs International Ltd	Staatsanleihe	EUR	11.325.540,96	AAA	Über ein Jahr	USD	Vereinigtes Königreich	Trilateral
Barclays Capital Securities Ltd	Staatsanleihe	EUR	2.844.211,22	AAA	Über ein Jahr	USD	Vereinigtes Königreich	Trilateral
<b>NN (L) Global High Yield</b>								
<b>Wertpapierleihgeschäfte</b>								
Goldman Sachs International Ltd	Staatsanleihe	EUR	61.613.617,17	AA-	Über ein Jahr	GBP	Vereinigtes Königreich	Trilateral
Barclays Capital Securities Ltd	Staatsanleihe	EUR	32.716.803,77	AAA	Über ein Jahr	USD	Vereinigtes Königreich	Trilateral
Barclays Capital Securities Ltd	Staatsanleihe	EUR	17.997.457,45	AAA	Drei Monate bis ein Jahr	USD	Vereinigtes Königreich	Trilateral
Morgan Stanley International	Staatsanleihe	EUR	15.828.081,27	AAA	Über ein Jahr	EUR	Vereinigtes Königreich	Trilateral
JP Morgan Securities PLC	Staatsanleihe	EUR	6.953.549,01	AAA	Über ein Jahr	USD	Vereinigtes Königreich	Trilateral
Merrill Lynch International	Staatsanleihe	EUR	2.762.332,90	AA	Über ein Jahr	EUR	Vereinigtes Königreich	Trilateral
Credit Suisse International London	Staatsanleihe	EUR	1.231.633,76	AA	Über ein Jahr	EUR	Vereinigtes Königreich	Trilateral
Nomura International PLC	Staatsanleihe	EUR	816.706,82	AA	Über ein Jahr	EUR	Vereinigtes Königreich	Trilateral
Morgan Stanley International	Staatsanleihe	EUR	686.502,06	AA	Über ein Jahr	EUR	Vereinigtes Königreich	Trilateral
Nomura International PLC	Staatsanleihe	EUR	31,21	AA-	Über ein Jahr	EUR	Vereinigtes Königreich	Trilateral
Goldman Sachs International Ltd	Staatsanleihe	EUR	0,01	AA	Über ein Jahr	EUR	Vereinigtes Königreich	Trilateral
<b>NN (L) Greater China Equity</b>								
<b>Wertpapierleihgeschäfte</b>								
UBS AG	Staatsanleihe	USD	1.584.385,08	AAA	Über ein Jahr	CAD	Vereinigtes Königreich	Trilateral
<b>NN (L) US High Yield</b>								
<b>Wertpapierleihgeschäfte</b>								
Goldman Sachs International Ltd	Staatsanleihe	USD	6.448.857,66	AAA	Über ein Jahr	USD	Vereinigtes Königreich	Trilateral
Barclays Capital Securities Ltd	Staatsanleihe	USD	3.511.496,15	AAA	Über ein Jahr	USD	Vereinigtes Königreich	Trilateral

## Erläuterungen zu den Finanzabschlüssen (Fortsetzung)

Art des abgesicherten Wertpapiers	Art der Sicherheiten	Währung	Marktwert der erhaltenen Sicherheiten	Qualität	Laufzeit der Sicherheiten	Währung der Sicherheiten	Land, in dem die Gegenpartei niedergelassen ist (nicht der Sicherheit)	Abwicklung und Clearing
<b>NN (L) Commodity Enhanced</b>								
<b>Total Return Swaps*</b>								
Goldman Sachs	Barmittel	USD	24.240.000,00	Entfällt	Entfällt	USD	Deutschland	Bilateral
Société Générale	Barmittel	USD	10.920.000,00	Entfällt	Entfällt	USD	Frankreich	Bilateral
State Street Bank	Barmittel	USD	8.760.000,00	Entfällt	Entfällt	USD	Vereinigte Staaten	Bilateral
<b>NN (L) Euro Fixed Income</b>								
<b>Total Return Swaps*</b>								
Bank of America	Barmittel	EUR	10.000,00	Entfällt	Entfällt	EUR	Frankreich	Bilateral
Bank of New York Mellon	Barmittel	EUR	(4.380.000,01)	Entfällt	Entfällt	EUR	Vereinigte Staaten	Bilateral
Barclays	Barmittel	EUR	(1.500.000,00)	Entfällt	Entfällt	EUR	Irland	Bilateral
BNP Paribas	Barmittel	EUR	(17.530.000,01)	Entfällt	Entfällt	EUR	Frankreich	Bilateral
Citigroup	Barmittel	EUR	(2.560.000,00)	Entfällt	Entfällt	EUR	Deutschland	Bilateral
Goldman Sachs	Barmittel	EUR	(7.159.999,99)	Entfällt	Entfällt	EUR	Deutschland	Bilateral
HSBC Continental	Barmittel	EUR	130.000,00	Entfällt	Entfällt	EUR	Frankreich	Bilateral
JP Morgan Chase Bank	Barmittel	EUR	(1.150.000,00)	Entfällt	Entfällt	EUR	Deutschland	Bilateral
Morgan Stanley	Barmittel	EUR	250.000,00	Entfällt	Entfällt	EUR	Deutschland	Bilateral
<b>NN (L) Multi Asset Factor Opportunities</b>								
<b>Total Return Swaps*</b>								
Bank of America	Barmittel	USD	5.020.000,00	Entfällt	Entfällt	USD	Frankreich	Bilateral
Barclays	Barmittel	USD	350.000,00	Entfällt	Entfällt	USD	Irland	Bilateral
BNP Paribas	Barmittel	USD	1.840.000,00	Entfällt	Entfällt	USD	Frankreich	Bilateral
HSBC Continental	Barmittel	USD	(7.169.999,99)	Entfällt	Entfällt	USD	Frankreich	Bilateral
JP Morgan Chase Bank	Barmittel	USD	(1.210.000,00)	Entfällt	Entfällt	USD	Deutschland	Bilateral
Morgan Stanley	Barmittel	USD	(660.000,00)	Entfällt	Entfällt	USD	Deutschland	Bilateral
Société Générale	Barmittel	USD	(7.570.000,01)	Entfällt	Entfällt	USD	Frankreich	Bilateral

\* Die ausgewiesenen Beträge beziehen sich auf außerbörsliche Derivatepositionen und nicht nur auf Total Return Swaps.

Die Laufzeiten der Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Total Return Swaps sind folgende:

Per 31. März 2022 hatten alle Wertpapierleihgeschäfte eine unbefristete Laufzeit.

Per 31. März 2022 wird die Fälligkeit aller Total Return Swaps in der Aufstellung „Derivative Finanzinstrumente“ des jeweiligen Teilfonds angegeben.

Für den Teilfonds NN (L) Commodity Enhanced liegt die Laufzeit der Total Return Swaps zwischen drei Monaten und einem Jahr.

Für den Teilfonds NN (L) Euro Fixed Income liegt die Laufzeit des Total Return Swaps zwischen einem Monat und drei Monaten.

Für den Teilfonds NN (L) Multi Asset Factor Opportunities liegt die Laufzeit zweier Total Return Swaps zwischen drei Monaten und einem Jahr und die Laufzeit der übrigen Total Return Swaps zwischen einem Monat und drei Monaten.

## Erläuterungen zu den Finanzabschlüssen (Fortsetzung)

### Verwahrung gestellter Sicherheiten

Die Stellung von Sicherheiten erfolgt auf Basis einer Eigentumsübertragung, und der Fonds kann diese Sicherheiten jederzeit wieder zurückfordern. Die Gegenpartei ist lediglich verpflichtet, dem Fonds denselben Betrag zurückzuerstatten, und solange eine Exponierung gegenüber der zugrunde liegenden Transaktion besteht, kann dieser Betrag vom Fonds nicht „jederzeit“ zurückgefordert werden.

In dem am 31. März 2022 beendeten Berichtszeitraum wurden keine Sicherheiten gestellt.

### Rendite/Kosten

Die Renditen und Kosten für jede Einzelart von Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps waren für den Berichtszeitraum zum 31. März 2022 folgende:

Rendite	Währung	Betrag	% der Gesamrendite
<b>NN (L) Asian Debt (Hard Currency)</b>			
<b>Wertpapierleihgeschäfte</b>			
an Teilfonds:	USD	9.283,51	100,00%
<b>NN (L) Asian High Yield</b>			
<b>Wertpapierleihgeschäfte</b>			
an Teilfonds:	USD	45.701,34	100,00%
<b>NN (L) Emerging Europe Equity</b>			
<b>Wertpapierleihgeschäfte</b>			
an Teilfonds:	EUR	167,06	100,00%
<b>NN (L) Emerging Markets Corporate Debt</b>			
<b>Wertpapierleihgeschäfte</b>			
an Teilfonds:	USD	326,31	100,00%
<b>NN (L) Emerging Markets Debt (Hard Currency)</b>			
<b>Wertpapierleihgeschäfte</b>			
an Teilfonds:	USD	201.077,33	100,00%
<b>NN (L) EURO Equity</b>			
<b>Wertpapierleihgeschäfte</b>			
an Teilfonds:	EUR	5.027,19	100,00%
<b>NN (L) European Equity</b>			
<b>Wertpapierleihgeschäfte</b>			
an Teilfonds:	EUR	6.932,66	100,00%
<b>NN (L) European High Dividend</b>			
<b>Wertpapierleihgeschäfte</b>			
an Teilfonds:	EUR	61.826,25	100,00%
<b>NN (L) European High Yield</b>			
<b>Wertpapierleihgeschäfte</b>			
an Teilfonds:	EUR	30.322,90	100,00%
<b>NN (L) First Class Yield Opportunities</b>			
<b>Wertpapierleihgeschäfte</b>			
an Teilfonds:	EUR	16.608,10	100,00%
<b>NN (L) Frontier Markets Debt (Hard Currency)</b>			
<b>Wertpapierleihgeschäfte</b>			
an Teilfonds:	USD	10.789,92	100,00%

## Erläuterungen zu den Finanzabschlüssen (Fortsetzung)

Rendite	Währung	Betrag	% der Gesamrendite
<b>NN (L) Global High Dividend</b>			
<b>Wertpapierleihgeschäfte</b>			
an Teilfonds:	EUR	14.506,33	100,00%
<b>NN (L) Global High Yield</b>			
<b>Wertpapierleihgeschäfte</b>			
an Teilfonds:	EUR	436.894,21	100,00%
<b>NN (L) Greater China Equity</b>			
<b>Wertpapierleihgeschäfte</b>			
an Teilfonds:	USD	12.156,19	100,00%
<b>NN (L) US High Yield</b>			
<b>Wertpapierleihgeschäfte</b>			
an Teilfonds:	USD	31.513,67	100,00%

<b>NN (L) Commodity Enhanced</b>			
<b>Total Return Swaps</b>			
an Teilfonds:	USD	22.464.501,53	100,00%
<b>NN (L) Euro Fixed Income</b>			
<b>Total Return Swaps</b>			
an Teilfonds:	EUR	842.751,99	100,00%
<b>NN (L) Multi Asset Factor Opportunities</b>			
<b>Total Return Swaps</b>			
an Teilfonds:	USD	(2.537.699,79)	100,00%

Kosten	Währung	Betrag	% der Gesamtkosten
<b>NN (L) Asian Debt (Hard Currency)</b>			
<b>Wertpapierleihgeschäfte</b>			
an Teilfonds:	USD	807,29	100,00%
<b>NN (L) Asian High Yield</b>			
<b>Wertpapierleihgeschäfte</b>			
an Teilfonds:	USD	3.973,70	100,00%
<b>NN (L) Emerging Europe Equity</b>			
<b>Wertpapierleihgeschäfte</b>			
an Teilfonds:	EUR	14,49	100,00%
<b>NN (L) Emerging Markets Corporate Debt</b>			
<b>Wertpapierleihgeschäfte</b>			
an Teilfonds:	USD	28,34	100,00%
<b>NN (L) Emerging Markets Debt (Hard Currency)</b>			
<b>Wertpapierleihgeschäfte</b>			
an Teilfonds:	USD	17.485,82	100,00%
<b>NN (L) EURO Equity</b>			
<b>Wertpapierleihgeschäfte</b>			
an Teilfonds:	EUR	1.036,10	100,00%

## Erläuterungen zu den Finanzabschlüssen (Fortsetzung)

Kosten	Währung	Betrag	% der Gesamtkosten
<b>NN (L) European Equity</b>			
<b>Wertpapierleihgeschäfte</b>			
an Teilfonds:	EUR	3,89	100,00%
<b>NN (L) European High Dividend</b>			
<b>Wertpapierleihgeschäfte</b>			
an Teilfonds:	EUR	5.376,24	100,00%
<b>NN (L) European High Yield</b>			
<b>Wertpapierleihgeschäfte</b>			
an Teilfonds:	EUR	2.636,31	100,00%
<b>NN (L) First Class Yield Opportunities</b>			
<b>Wertpapierleihgeschäfte</b>			
An Fonds:	EUR	1.444,39	100,00%
<b>NN (L) Frontier Markets Debt (Hard Currency)</b>			
<b>Wertpapierleihgeschäfte</b>			
an Teilfonds:	USD	937,83	100,00%
<b>NN (L) Global High Dividend</b>			
<b>Wertpapierleihgeschäfte</b>			
an Teilfonds:	EUR	1.261,42	100,00%
<b>NN (L) Global High Yield</b>			
<b>Wertpapierleihgeschäfte</b>			
an Teilfonds:	EUR	37.991,21	100,00%
<b>NN (L) Greater China Equity</b>			
<b>Wertpapierleihgeschäfte</b>			
an Teilfonds:	USD	1.057,06	100,00%
<b>NN (L) US High Yield</b>			
<b>Wertpapierleihgeschäfte</b>			
an Teilfonds:	USD	2.739,82	100,00%

### 14- PORTFOLIUMSCHLAGSRATE

Die Portfolioumschlagsrate (PTR) ist ein Indikator für die Relevanz der zusätzlichen Kosten, die dem Fonds beim Kauf und Verkauf von Anlagen im Einklang mit seiner Anlagepolitik entstehen.

Die Portfolioumschlagsrate wird nach der unten beschriebenen Methode wie folgt berechnet:

$$\text{Umschlag} = \frac{(\text{Summe 1} - \text{Summe 2})}{M} * 100$$

Summe 1 = Summe Wertpapiergeschäfte im maßgeblichen Zeitraum = X + Y

X = Käufe

Y = Verkäufe

Summe 2 = Summe der Kapitaltransaktionen im maßgeblichen Zeitraum = S + R

S = Zeichnungen

R = Rücknahmen

M = Durchschnittliches Nettovermögen

Die Portfolioumschlagsrate wird als Prozentsatz angegeben. In die Berechnung des Portfolioumschlags fließen die in NN (L) Liquid getätigten Geschäfte nicht ein, die mit dem Liquiditätsmanagement verbunden sind.

## Erläuterungen zu den Finanzabschlüssen (Fortsetzung)

### 15- EREIGNISSE NACH DEM BILANZSTICHTAG

Am 19. August 2021 kündigte die NN Group an, dass eine Vereinbarung über den Verkauf ihrer Verwaltungsgesellschaft NN Partners (NN IP) an die Goldman Group Inc. (Goldman Sachs) erzielt wurde. Der Vereinbarung ging eine strategische Überprüfung voraus, die am 26. April 2021 angekündigt und von der NN Group mit dem Ziel durchgeführt wurde, eine langfristige Wertschöpfung anzustreben, die allen Stakeholdern zugutekommt. Der vollständige Vollzug der Transaktion erfolgte am 11. April 2022. Bis zum Vollzug handelten NN IP und Goldman Sachs als zwei getrennte Unternehmen.

---

## Weitere Informationen für die Anteilsinhaber

### **ALFI-Verhaltenskodex**

Hierdurch wird bestätigt, dass NN (L) die Grundsätze des „Verhaltenskodex für Luxemburger Investmentfonds“ des Luxemburger Fondsverbands ALFI beachtet und einhält.

Weitere Informationen sind erhältlich bei:

NN Investment Partners B.V.  
P.O. Box 90470  
Prinses Beatrixlaan 35  
2509 LL The Hague  
The Netherlands  
E-mail: [info@nnip.com](mailto:info@nnip.com)  
oder [www.nnip.com](http://www.nnip.com)