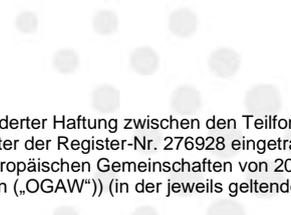


PIMCO

PIMCO FUNDS: GLOBAL INVESTORS SERIES PLC

Jahresbericht

31. Dezember 2022



A company of **Allianz** 

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

ALLGEMEINE KENNDATEN

Fondstyp:

OGAW

Anzahl an Fonds der Gesellschaft:

56 Fonds

Zum 31. Dezember 2022 angebotene Anteilsklassen der Gesellschaft:*

Institutional
 Institutional AUD (Hedged)
 Institutional BRL (Hedged)
 Institutional CAD (Hedged)
 Institutional CHF (Hedged)
 Institutional CHF (Partially Hedged)
 Institutional CZK (Hedged)
 Institutional EUR (Currency Exposure)
 Institutional EUR (Hedged)
 Institutional EUR (Partially Hedged)
 Institutional EUR (Unhedged)
 Institutional GBP (Currency Exposure)
 Institutional GBP (Hedged)
 Institutional GBP (Partially Hedged)
 Institutional GBP (Unhedged)
 Institutional HKD (Unhedged)
 Institutional ILS (Hedged)
 Institutional JPY (Hedged)
 Institutional MXN (Hedged)
 Institutional NOK (Hedged)
 Institutional NOK (Partially Hedged)
 Institutional NZD (Hedged)
 Institutional PLN (Hedged)
 Institutional RMB (Hedged)
 Institutional SEK (Hedged)
 Institutional SGD (Hedged)
 Institutional USD (Currency Exposure)
 Institutional USD (Hedged)
 Investor
 Investor AUD (Hedged)
 Investor CAD (Hedged)
 Investor CHF (Hedged)
 Investor EUR (Hedged)
 Investor EUR (Unhedged)
 Investor GBP (Hedged)
 Investor NOK (Hedged)
 Investor RMB (Hedged)
 Investor SEK (Hedged)
 Investor SGD (Hedged)
 Investor USD (Hedged)
 Administrative
 Administrative AUD (Hedged)
 Administrative CHF (Hedged)
 Administrative EUR (Hedged)
 Administrative GBP (Hedged)
 Administrative HKD (Unhedged)
 Administrative JPY (Hedged)
 Administrative SEK (Hedged)
 Administrative SGD (Hedged)
 BE Retail
 BM Retail
 BM Retail AUD (Hedged)
 BM Retail USD (Hedged)
 BN Retail
 E Class
 E Class AUD (Hedged)
 E Class AUD (Partially Hedged)
 E Class CHF (Hedged)
 E Class EUR (Currency Exposure)
 E Class EUR (Hedged)
 E Class EUR (Partially Hedged)
 E Class EUR (Unhedged)
 E Class GBP (Hedged)
 E Class GBP (Partially Hedged)
 E Class HKD (Unhedged)
 E Class JPY (Hedged)
 E Class NOK (Hedged)
 E Class RMB (Hedged)
 E Class SGD (Hedged)
 E Class SGD (Partially Hedged)
 E Class USD (Currency Exposure)

E Class USD (Hedged)
 G Retail EUR (Hedged)
 G Retail EUR (Unhedged)
 H Institutional
 H Institutional EUR (Hedged)
 H Institutional USD (Currency Exposure)
 H Institutional USD (Hedged)
 M Retail
 M Retail AUD (Hedged)
 M Retail HKD (Unhedged)
 M Retail SEK (Hedged)
 M Retail SGD (Hedged)
 M Retail USD (Hedged)
 N Retail
 R Class
 R Class AUD (Hedged)
 R Class EUR (Hedged)
 R Class GBP (Hedged)
 T Class
 T Class EUR (Hedged)
 T Class USD (Hedged)
 W Class
 W Class CAD (Hedged)
 W Class CHF (Hedged)
 W Class EUR (Hedged)
 W Class GBP (Hedged)
 W Class NOK (Hedged)
 W Class SEK (Hedged)
 W Class SGD (Hedged)
 W Class USD (Currency Exposure)
 Z Class
 Z Class AUD (Hedged)
 Z Class EUR (Hedged)
 Z Class GBP (Hedged)

Anteilsarten:

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

Nettovermögen (Angaben in Tausend):

USD 151.524.519

Mindestbestand:

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

Handelstag:

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

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

Funktionswährung der Fonds:

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

* Eine vollständige Liste aller während des aktuellen und vorangegangenen Berichtszeitraums ausgegebenen Anteilsklassen ist Erläuterung 19 zu entnehmen. Eine Liste aller für die einzelnen Fonds angebotenen Anteilsklassen ist dem Verkaufsprospekt zu entnehmen.

ALLGEMEINE KENNDATEN (Forts.)

Handelstag:

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

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

Funktionswährung der Fonds:

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

ALLGEMEINE KENNDATEN (Forts.)

Zulassung in Hongkong:

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

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

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

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

PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund
 UK Corporate Bond Fund
 UK Long Term Corporate Bond Fund
 US Investment Grade Corporate Bond Fund
 US Short-Term Fund

Zulassung in Singapur

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

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

Reuters-Seite:

PAFPPLC

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

	Seite
Schreiben des Vorsitzenden*	4
Wichtige Angaben zu den Fonds	5
Beschreibungen der Vergleichsindizes	67
Finanzstatus	72
Betriebsergebnisrechnung	92
Ausweis der Nettovermögensänderungen	112
Aufstellung der Wertpapieranlagen	118
Erläuterungen zum Abschluss	730
Bericht des Verwaltungsrats	859
Bericht des unabhängigen Abschlussprüfers	862
Bericht der Verwahrstelle	867
Angaben zur Vergütung (ungeprüft)	868
Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung (ungeprüft)	869
Aktionärsrechterichtlinie II (ungeprüft)	926
Offenlegungen gemäß der Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor und der Taxonomie- Verordnung (ungeprüft)	927
Glossar (ungeprüft)	1028
Allgemeine Informationen (ungeprüft)	1030

FONDS	Teilfondsüberblick*	Aufstellung der Wertpapieranlagen
PIMCO Asia High Yield Bond Fund	6	118
Asia Strategic Interest Bond Fund	7	126
PIMCO Capital Securities Fund	8	134
PIMCO Climate Bond Fund	10	142
Commodity Real Return Fund	11	149
PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	12	159
Diversified Income Fund	13	168
Diversified Income Duration Hedged Fund	15	185
Diversified Income ESG Fund	16	195
Dynamic Bond Fund	17	199
Dynamic Multi-Asset Fund	18	216
Emerging Local Bond Fund	19	228
Emerging Local Bond ESG Fund	20	249
Emerging Markets Bond Fund	21	255
Emerging Markets Bond ESG Fund	22	270
Emerging Markets Corporate Bond Fund	23	284
PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	24	291
Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	25	303
PIMCO ESG Income Fund	26	316
Euro Bond Fund	27	327
Euro Credit Fund	28	335
Euro Income Bond Fund	29	342
Euro Long Average Duration Fund	30	350
Euro Short-Term Fund	31	356
PIMCO European High Yield Bond Fund	32	361
PIMCO European Short-Term Opportunities Fund	33	367
Global Advantage Fund	34	374
Global Bond Fund	35	392
Global Bond ESG Fund	37	416
Global Bond Ex-US Fund	38	433
PIMCO Global Core Asset Allocation Fund	39	449
Global High Yield Bond Fund	40	461
Global Investment Grade Credit Fund	41	470
Global Investment Grade Credit ESG Fund	43	491
Global Low Duration Real Return Fund	44	503
Global Real Return Fund	45	511

FOONDS	Teilfondsüberblick*	Aufstellung der Wertpapieranlagen
Income Fund	46	521
Income Fund II	48	558
Inflation Multi-Asset Fund	49	565
Low Average Duration Fund	50	574
Low Duration Global Investment Grade Credit Fund	51	582
Low Duration Income Fund	52	592
Low Duration Opportunities Fund	53	606
Low Duration Opportunities ESG Fund	54	618
PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	55	621
Mortgage Opportunities Fund	56	624
StocksPLUS™ Fund	57	633
PIMCO StocksPLUS™ AR Fund	58	640
Strategic Income Fund	59	645
Total Return Bond Fund	60	661
PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	61	674
UK Corporate Bond Fund	62	689
UK Long Term Corporate Bond Fund	63	697
US High Yield Bond Fund	64	705
US Investment Grade Corporate Bond Fund	65	713
US Short-Term Fund	66	723

Dieser Jahresbericht und der geprüfte Abschluss (der „Jahresbericht“) können in andere Sprachen übersetzt werden. Eine solche Übersetzung darf nur dieselben Informationen wie der englischsprachige Jahresbericht enthalten und muss dieselbe Bedeutung haben. Soweit zwischen dem englischsprachigen Jahresbericht und dem Jahresbericht in einer anderen Sprache Widersprüche bestehen, hat der englischsprachige Jahresbericht Vorrang, es sei denn, es ist in irgendeinem Rechtsgebiet, in dem die Anteile verkauft werden, gesetzlich vorgeschrieben, dass bei einer Klage, die auf Angaben in einem Jahresbericht in einer anderen Sprache als Englisch beruht, die Sprache des Jahresberichts, auf der diese Klage beruht, maßgeblich ist. Etwaige Streitigkeiten bezüglich der Bedingungen des Jahresberichts unterliegen unabhängig von der Sprache des Jahresberichts den Gesetzen Irlands und werden in Übereinstimmung mit diesen ausgelegt.

* Dieses Dokument enthält die Meinungen der Gesellschaft, und diese Meinungen können sich ohne Vorankündigung ändern. Dieses Material wurde ausschließlich zu Informationszwecken verteilt. Prognosen, Schätzungen und bestimmte hierin enthaltene Informationen beruhen auf firmeneigenem Research und sollten nicht als Anlageberatung oder Empfehlung eines bestimmten Wertpapiers, einer bestimmten Strategie oder eines bestimmten Anlageprodukts erachtet werden. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen. Die hierin enthaltenen Informationen wurden aus Quellen bezogen, die als verlässlich erachtet werden. Eine diesbezügliche Garantie wird jedoch nicht abgegeben. Kein Teil dieses Dokuments darf ohne ausdrückliche schriftliche Zustimmung in jedweder Form reproduziert werden, und es ist ebenso untersagt, in anderen Veröffentlichungen darauf Bezug zu nehmen. PIMCO ist in den USA und weltweit eine Marke von Allianz Asset Management of America LLC ©2023, PIMCO.

Schreiben des Vorsitzenden

Sehr geehrte Anteilnehmerinnen und Anteilhaber,

2022 war ein schwieriges Jahr an den Kapitalmärkten. Wir arbeiten weiterhin unermüdlich daran, die globalen Märkte zu navigieren und die Vermögenswerte, die Sie uns anvertraut haben, zu verwalten. Im Anschluss an dieses Schreiben folgt der Halbjahresbericht von PIMCO Funds: Global Investors Series plc, der den am 31. Dezember 2022 abgeschlossenen zwölfmonatigen Berichtszeitraum (der „Berichtszeitraum“) umfasst. Auf den nachfolgenden Seiten finden Sie Einzelheiten zu den Anlageergebnissen sowie eine Erörterung der Faktoren, die während des Berichtszeitraums den stärksten Einfluss auf die Wertentwicklung hatten.

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2022

Die Weltwirtschaft sah sich 2022 mit erheblichen Schwierigkeiten konfrontiert, unter anderem im Zusammenhang mit der erhöhten Inflation, der Covid-Pandemie und dem Konflikt zwischen Russland und der Ukraine. In seinem World Economic Outlook Update vom Oktober 2022 senkte der Internationale Währungsfonds (der „IWF“) unter Verweis auf „turbulente Herausforderungen“ wie hohe Inflation, eine Verschärfung der Finanzlage sowie den anhaltenden Konflikt zwischen Russland und der Ukraine und die Covid-Pandemie seine Erwartungen für das BIP 2022. Für 2022 nahm der IWF in seine Prognosen auf, dass das BIP in den USA um 1,6 % (gegenüber 5,7 % im Jahr 2021), in der Eurozone um 3,1 % (gegenüber 5,2 % im Jahr 2021), in Großbritannien um 3,6 % (gegenüber 7,4 % im Jahr 2021) und in Japan um 1,7 % (wie im Jahr 2021) steigen wird.

Mehrere Zentralbanken strafften ihre jeweilige Geldpolitik in den letzten Jahren. So erhöhte beispielsweise die Bank of England (die „BoE“) im Dezember 2021, vor Beginn des Berichtszeitraums, ihre Zinssätze zum ersten Mal seit Beginn der Covid-Pandemie. Sie hob die Zinsen bei jeder ihrer nächsten acht Sitzungen erneut an, insgesamt um 3,50 % seit der ersten Anhebung. Die Europäische Zentralbank erhöhte die Zinsen 2022 viermal, insgesamt um 2,50 %. Im Gegensatz dazu behielt die Bank of Japan (die „BoJ“) für den Großteil des Jahres 2022 ihre lockere Geldpolitik bei. Im Dezember 2022 kündigte die BoJ jedoch an, die Rendite ihrer 10-jährigen Staatsanleihen auf 0,5 % (bisher begrenzt auf 0,25 %) steigen zu lassen. Diese Meldung trieb die Rendite 10-jähriger Anleihen und den japanischen Yen in die Höhe, da die Marktteilnehmer die Ankündigung so interpretierten, dass die BoJ von ihrer bisherigen geldpolitischen Haltung abweichen könnte.

Die US-Notenbank (die „Fed“ oder „US-Notenbank“) ergriff Maßnahmen zur Bekämpfung der erhöhten Inflation. Im März 2022 hob die Fed den Leitzins um 0,25 % auf eine Spanne zwischen 0,25 % und 0,50 % an – die erste Zinserhöhung seit 2018. Die US-Notenbank erhöhte dann bei ihren nächsten sechs Sitzungen die Zinsen, was 2022 insgesamt einen Anstieg von 4,25 % zur Folge hatte. Zum Jahresende lag der US-Leitzins in einer Spanne zwischen 4,25 % und 4,50 %.

Während des Berichtszeitraums zogen die kurz- und langfristigen Renditen auf US-Staatsanleihen deutlich an. Die Rendite der 10-jährige US-Benchmarkanleihen lag am 31. Dezember 2022 bei 3,88 % gegenüber 1,52 % am 31. Dezember 2021. Der Bloomberg Global Treasury Index (USD Hedged), der festverzinsliche, auf Lokalwährung lautende staatliche Schuldtitel von Ländern mit Investment Grade-Rating abdeckt und Industrie- sowie Schwellenländer umfasst, erzielte eine Rendite von -10,79 %. Der Bloomberg Global Aggregate Credit Index (USD Hedged), ein weitläufig verwendeter Index für globale Anleihen mit Investment Grade-Rating, rentierte derweil mit -14,22 %. Auch mit höherem Risiko behaftete festverzinsliche Anlageklassen wie etwa hochverzinsliche Unternehmensanleihen und Schuldtitel aus Schwellenländern schnitten schwach ab. Der ICE BofA Merrill Lynch Developed Markets High Yield Constrained Index (USD Hedged), ein weitläufig verwendeter Index für Anleihen unterhalb von Investment Grade, verzeichnete eine Rendite von -10,56 %, während Auslandsschulden von Schwellenländern, die vom JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global (USD Hedged) abgebildet werden, mit -16,45 % rentierten. Auf Landeswährungen lautende Schwellenmarktanleihen, die vom JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (Unhedged) abgebildet werden, rentierten mit -11,69 %.

Vor dem Hintergrund volatiler Phasen verzeichneten globale Aktien im Berichtszeitraum allgemein schwache Ergebnisse, da wirtschaftliche und geopolitische Sorgen die Anlegerstimmung belasteten. US-Aktien verzeichneten gemessen am S&P 500-Index ein Minus von -18,11 %. Die im MSCI World Index vertretenen globalen Aktien brachten eine Rendite von -18,14 %, während die im MSCI Emerging Markets Index vertretenen Schwellenmarktaktien mit -20,09 % rentierten. Japanische Aktien verbuchten derweil am Nikkei 225 Index (in JPY) gemessen ein Minus von -7,37 %, während die vom MSCI Europe Index (in EUR) abgebildeten europäischen Aktien mit -9,49 % rentierten.

Die Rohstoffpreise waren volatil und generierten im Berichtszeitraum uneinheitliche Ergebnisse. Rohöl der Sorte Brent, das zu Beginn des Berichtszeitraums bei rund 77,24 USD pro Barrel lag, stieg Ende Dezember 2022 auf rund 82,82 USD pro Barrel. Die Preise anderer Rohstoffe wie Kupfer und Gold gingen während des Berichtszeitraums zurück.

Schließlich gab es auch Phasen mit Volatilität an den Devisenmärkten. Dies wurde unserer Meinung nach durch mehrere Faktoren ausgelöst, darunter die Prognosen des Wirtschaftswachstums und die Umstellung der Geldpolitik durch die Zentralbanken sowie die steigende Inflation, Varianten des Coronavirus und geopolitische Ereignisse. Der US-Dollar wertete gegenüber mehreren wichtigen Währungen auf. Beispielsweise verbuchte der US-Dollar während des Berichtszeitraums gegenüber dem Euro, dem britischen Pfund und dem japanischen Yen eine Rendite von jeweils 5,85 % bzw. 10,71 % und 12,23 %.

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

Mit freundlichem Gruß



Craig A. Dawson
Vorsitzender

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

Wichtige Angaben zu den Fonds

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

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

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

Bestimmte Fonds können eine Environmental, Social and Governance (ESG)-Anlagestrategie verfolgen, die Wertpapiere bestimmter Emittenten aus anderen Gründen als ihrer finanziellen Wertentwicklung auswählt oder ausschließt. Diese Strategie birgt das Risiko, dass die Wertentwicklung eines Fonds von ähnlichen Fonds, die keine ESG-Anlagestrategie anwenden, abweicht. Die Anwendung dieser Strategie könnte sich beispielsweise auf das Engagement eines Fonds in bestimmten Sektoren oder Anlagearten auswirken, was die Wertentwicklung eines Fonds beeinträchtigen kann. Es besteht keine Garantie, dass die vom Anlageberater verwendeten Faktoren den Meinungen eines bestimmten Anlegers entsprechen. Außerdem können die vom Anlageberater verwendeten Faktoren von den Faktoren abweichen, die ein bestimmter Anleger bei der Beurteilung der ESG-Praktiken eines Emittenten für relevant hält. Zukünftige Entwicklungen und Regulierungen im ESG-Bereich können sich auf die Umsetzung der Anlagestrategie eines Fonds auswirken. Darüber hinaus können sich Kosten aus ESG-bezogenen Sorgfaltsprüfungen, erhöhtem Berichtsaufwand und der Inanspruchnahme externer ESG-Datenanbieter ergeben.

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

In der Aufstellung der Wertpapieranlagen können bestimmte Portfoliopositionen zusammengefasst werden, wenn die Anlagen über die gleichen Eigenschaften verfügen (z. B. Anleihezinssätze und Fälligkeitstermine).

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

Bestimmte Wertpapiere und Instrumente, in die ein Fonds investieren kann, stützen sich gegebenenfalls in bestimmter Weise auf den London Interbank Offered Rate („LIBOR“). Der LIBOR ist ein durchschnittlicher Zinssatz, den die ICE Benchmark Administration bestimmt und den sich Banken gegenseitig für die Nutzung kurzfristiger Geldmittel berechnen. Angesichts der allmählichen Einstellung der Verwendung des LIBOR müssen die betreffenden Fonds zu einer anderen Benchmark wechseln (z. B. dem Secured Overnight Financing Rate, der den US-Dollar-LIBOR ersetzen soll und die Kosten von Tagesgeldern bei Besicherung mit US-Staatsanleihen abbildet). Die möglichen Auswirkungen des Übergangs weg vom LIBOR auf einen Fonds oder auf bestimmte Wertpapiere und Instrumente, in die ein Fonds investiert, lassen sich gegebenenfalls nur mit Schwierigkeiten ermitteln, und sie können in Abhängigkeit von mehreren Faktoren unterschiedlich ausfallen. Der Übergang kann außerdem zu einer Verringerung des Werts bestimmter von einem Fonds gehaltener Anlagen oder zu einer Verringerung der Wirksamkeit damit verbundener Fondstransaktionen wie z.B. Absicherungen führen. Derartige Auswirkungen des Übergangs weg vom LIBOR sowie andere unvorhergesehene Effekte könnten einem Fonds Verluste verursachen.

Die Diagramme mit der Netto-Wertentwicklung auf den Überblicksseiten der einzelnen Fonds in diesem Jahresbericht erfassen die Anlageentwicklung, davon ausgehend, dass alle Dividenden und Kapitalgewinnausschüttungen wiederangelegt wurden. In den Renditen ist nicht der Abzug von Steuern berücksichtigt, die ein Anteilinhaber für die folgenden Posten zahlen würde: (i) Ausschüttungen des Fonds; oder (ii) die Rücknahme von Fondsanteilen. Das Diagramm mit der Netto-Wertentwicklung misst die Wertentwicklung des jeweiligen Fonds im Vergleich zur Wertentwicklung eines breit angelegten Wertpapiermarktindex (Referenzindex). Die frühere Wertentwicklung eines Fonds vor und nach Steuern ist nicht unbedingt ein Indikator dafür, wie sich der Fonds zukünftig entwickeln wird. Anlagen in einem Fonds gelten nicht als Bankeinlagen und werden nicht von einer behördlichen Stelle verbürgt oder versichert. Der Wert der und die Einkünfte aus den Anteilen am Teilfonds können steigen oder sinken und eventuell erhalten Sie nicht den ursprünglich in den Teilfonds investierten Betrag zurück.

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

Definierte Begriffe, die in diesem Jahresbericht verwendet werden und nicht anderweitig definiert sind, haben die im Verkaufsprospekt der Gesellschaft angegebene Bedeutung.

Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2022 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 14. Feb. 2019)	(14,01 %)	(2,96 %)
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 14. Feb. 2019)	(13,98 %)	(2,94 %)
Investor, thesaurierend (Auflegung: 25. Mai 2021)	(14,38 %)	(16,43 %)
Investor, ausschüttend (Auflegung: 20. Aug. 2020)	(14,34 %)	(9,21 %)
Administrative, ausschüttend (Auflegung: 14. Feb. 2019)	(14,41 %)	(3,43 %)
Class E, thesaurierend (Auflegung: 01. Jul. 2020)	(14,81 %)	(7,76 %)
Class E, ausschüttend (Auflegung: 14. Feb. 2019)	(14,76 %)	(3,81 %)
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 12. März 2021)	(14,17 %)	(13,54 %)
H Institutional, ausschüttend (Auflegung: 12. März 2021)	(14,09 %)	(13,50 %)
M Retail, ausschüttend II (Auflegung: 14. Feb. 2019)	(14,87 %)	(3,83 %)
Class Z, thesaurierend (Auflegung: 14. Feb. 2019)	(13,46 %)	(2,32 %)
JPMorgan JACI Non-Investment Grade Index	(15,09 %)	(3,89 %)²
Auf AUD lautende Klassen		
Institutional AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Juli 2021)	(14,52 %)	(15,55 %)
Investor AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung 30. Sep. 2020)	(14,91 %)	(9,70 %)
JPMorgan JACI Non-Investment Grade Index (AUD Hedged)	(16,72 %)	(11,19 %)²
Auf CHF lautende Klassen		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung 23. Okt. 2020)	(15,98 %)	(10,83 %)
Institutional CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung 23. Okt. 2020)	(15,95 %)	(10,82 %)
Class E CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung 23. Okt. 2020)	(16,70 %)	(11,62 %)
Class E CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung 23. Okt. 2020)	(16,70 %)	(11,62 %)
JPMorgan JACI Non-Investment Grade Index (CHF Hedged)	(17,93 %)	(12,34 %)
Auf CNH lautende Klassen		
Investor RMB (Hedged), ausschüttend (Auflegung 09. Okt. 2020)	(14,09 %)	(8,23 %)
JPMorgan JACI Non-Investment Grade Index (CNH Hedged)	(15,49 %)	(9,39 %)
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 25. Sep. 2020)	(15,81 %)	(10,23 %)
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung 25. Sep. 2020)	(15,80 %)	(10,19 %)
Investor EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung 10. Sep. 2020)	(16,06 %)	(11,02 %)
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 25. Sept. 2020)	(16,61 %)	(11,00 %)
Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung 25. Sep. 2020)	(16,54 %)	(10,99 %)
JPMorgan JACI Non-Investment Grade Index (EUR Hedged)	(17,65 %)	(12,33 %)²
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 29. Juli 2021)	(14,33 %)	(15,78 %)
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 6. Mai 2021)	(14,26 %)	(15,72 %)
JPMorgan JACI Non-Investment Grade Index (GBP Hedged)	(16,13 %)	(17,42 %)²
Auf HKD lautende Klassen		
Class E HKD (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 14. Feb. 2019)	(14,63 %)	(3,92 %)
M Retail HKD (Unhedged), ausschüttend II (Auflegung: 14. Feb. 2019)	(14,64 %)	(3,94 %)
JPMorgan JACI Non-Investment Grade Index (HKD Unhedged)	(15,00 %)	(4,03 %)
Auf SGD lautende Klassen		
Institutional SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Jul. 2021)	(14,05 %)	(15,16 %)
Investor SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung 20. Aug. 2020)	(14,33 %)	(9,21 %)
Class E SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 14. Feb. 2019)	(14,83 %)	(4,06 %)
M Retail SGD (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 14. Feb. 2019)	(14,83 %)	(4,05 %)
JPMorgan JACI Non-Investment Grade Index (SGD Hedged)	(15,67 %)	(4,34 %)²

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der PIMCO Asia High Yield Bond Fund strebt eine maximale Gesamterträge bei umsichtiger Anlageverwaltung an, indem er in einen Mix aus festverzinslichen Instrumenten (wie im Verkaufsprospekt definiert) von Emittenten, die wirtschaftlich mit asiatischen Ländern, ausgenommen Japan, verbunden sind, sowie verbundenen Derivaten auf diese Wertpapiere investiert. Vom Fonds gekaufte Rentenwerte (wie im Verkaufsprospekt definiert) sind von Moody's mindestens mit C oder von S&P oder Fitch gleichwertig bewertet (oder weisen, falls sie kein Rating haben, nach Meinung der Anlageberatungsgesellschaft eine vergleichbare Qualität auf). Ausgenommen davon sind hypothekarisch gesicherte Wertpapiere, für die es kein vorgeschriebenes Mindest-Kreditrating gibt.

Kommentare zum Fonds

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

- » Eine Untergewichtung der US-Durationsposition trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die Zinssätze während des Berichtszeitraums sanken.
- » Die Titelauswahl bei indischen Unternehmensanleihen trug zur relativen Wertentwicklung bei, insbesondere im Versorgungssektor.
- » Die Kreditauswahl bei anderen Unternehmensanleihen aus asiatischen Schwellenländern trug zur relativen Wertentwicklung bei, insbesondere in Hongkong, den Philippinen und Singapur.
- » Die Titelauswahl bei chinesischen Unternehmensanleihen war der relativen Wertentwicklung abträglich, insbesondere aufgrund eines Engagements im Immobiliensektor und einer Übergewichtung im Papier eines bestimmten diversifizierten Fertigungsanbieters.
- » Das Engagement in ausgewählten indonesischen Unternehmensanleihen belastete die relative Wertentwicklung, insbesondere im Industrie- und Finanzsektor.

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

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

Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2022 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, ausschüttend (Auflegung 04. Sep. 2020)	(10,27 %)	(5,41 %)
Class E, thesaurierend (Auflegung 04. Sep. 2020)	(11,04 %)	(6,19 %)
Class E, ausschüttend (Auflegung: 01. Jun. 2010)	(11,06 %)	2,29 %
Class Z, thesaurierend (Auflegung 01. Dez. 2020)	(9,65 %)	(5,95 %)
JPMorgan Asia Credit Index ³	(11,02 %)	2,99 % ²
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 5. März 2021)	(12,12 %)	(9,04 %)
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 5. März 2021)	(12,83 %)	(9,77 %)
JPMorgan Asia Credit Index (EUR Hedged) ³	(13,21 %)	(8,58 %)
Auf EUR lautende Klassen (nicht abgesichert)		
Class E EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung 03. Jun. 2011)	(5,22 %)	3,05 %
JPMorgan Asia Credit Index (EUR Unhedged) ³	(5,19 %)	4,25 %
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 13. Aug. 2021)	(10,64 %)	(10,93 %)
JPMorgan Asia Credit Index (GBP Hedged) ³	(11,89 %)	(10,35 %)
Auf HKD lautende Klassen		
Class E HKD (Unhedged), ausschüttend (Auflegung 04. Sep. 2020)	(10,94 %)	(5,91 %)
M Retail HKD (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 01. Mrz. 2011)	(10,87 %)	0,85 %
JPMorgan Asia Credit Index (HKD Unhedged) ³	(11,01 %)	1,83 % ²
Auf SGD lautende Klassen		
Institutional SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung 09. Okt. 2020)	(10,31 %)	(5,28 %)
Class E SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung 09. Okt. 2020)	(11,07 %)	(6,08 %)
JPMorgan Asia Credit Index (SGD Hedged) ³	(11,33 %)	(5,62 %)

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

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

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

Kommentare zum Fonds

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

- » Die Währungspositionierung trug zur absoluten Wertentwicklung bei.
- » Das Engagement in hochverzinslichen Unternehmensanleihen aus China und Hongkong trug zur absoluten Wertentwicklung bei, insbesondere im Glücksspielsektor von Macao.
- » Die Durationspositionierung in den USA war der absoluten Wertentwicklung abträglich, da die Zinsen im Laufe des Berichtszeitraums stiegen.
- » Das Engagement in hochverzinslichen Unternehmensanleihen aus China/Hongkong belastete die absolute Wertentwicklung, insbesondere aufgrund von chinesischen Immobilieniteln.
- » Das Engagement in asiatischen Staatsanleihen belastete die absolute Wertentwicklung, insbesondere aufgrund von Pakistan und Sri Lanka.

Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2022 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 31. Jul. 2013)	(11,53 %)	4,72 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 23. Sep. 2014)	(11,56 %)	3,78 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 19. Mai 2014)	(11,86 %)	3,36 %
Investor, ausschüttend (Auflegung: 19. Mai 2014)	(11,87 %)	3,37 %
Administrative, thesaurierend (Auflegung: 09. Aug. 2013)	(11,97 %)	4,12 %
Administrative, ausschüttend (Auflegung: 09. Aug. 2013)	(11,97 %)	4,12 %
Administrative, ausschüttend II (Auflegung: 12. Aug. 2012)	—	(1,97 %)
Class E, thesaurierend (Auflegung: 28. Okt. 2013)	(12,32 %)	3,47 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 19. Mai 2014)	(12,27 %)	2,82 %
M Retail, ausschüttend II (Auflegung: 23. Dez. 2013)	(12,37 %)	3,23 %
Class R, ausschüttend (Auflegung: 18. Mrz. 2014)	(11,61 %)	3,72 %
Class T, ausschüttend (Auflegung: 16. Okt. 2014)	(12,67 %)	2,76 %
Class Z, ausschüttend (Auflegung: 31. Okt. 2013)	(10,78 %)	5,18 %
ICE BofA SOFR Overnight Rate Index ³	1,78 %	1,07 % ²
Auf AUD lautende Klassen		
Investor AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 23. Mai 2018)	(12,77 %)	1,18 %
Class Z AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 11. Aug. 2015)	(11,84 %)	4,06 %
Bloomberg AusBond Bank Bills Index	1,25 %	1,32 % ²
Auf BRL lautende Klassen		
Institutional BRL (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 02. Jan. 2018)	2,48 %	(3,71 %)
ICE BofA SOFR Overnight Rate Index (BRL Hedged) ³	17,91 %	(3,81 %)
Auf CAD lautende Klassen		
Investor CAD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 25. Jun. 2018)	(12,04 %)	1,92 %
Canadian Overnight Repo Rate (CORRA) ⁴	1,61 %	1,17 %
Auf CHF lautende Klassen		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 09. Aug. 2013)	(13,77 %)	2,61 %
Class E CHF (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 18. Jun. 2014)	(14,54 %)	0,46 %
ICE BofA SARON Overnight Rate Index ⁵	(0,24 %)	(0,79 %) ²
Auf CNH lautende Klassen		
Investor RMB (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 25. Jun. 2018)	(11,55 %)	3,76 %
ICE BofA SOFR Overnight Rate Index (RMB Hedged) ³	2,07 %	2,77 %
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 09. Aug. 2013)	(13,44 %)	2,99 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 09. Aug. 2013)	(13,49 %)	3,00 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 29. Jul. 2014)	(13,51 %)	1,87 %
Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 26. Feb. 2016)	(13,80 %)	2,46 %
Administrative EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 09. Aug. 2013)	(13,92 %)	2,47 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Okt. 2013)	(14,26 %)	1,80 %
Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Okt. 2015)	(14,31 %)	0,75 %
Class R EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 18. Jun. 2014)	(13,66 %)	1,62 %
Class T EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Sep. 2014)	(14,58 %)	0,78 %
Euro Short-Term Rate (ESTER) Index ⁶	(0,02 %)	(0,20 %) ²
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 09. Aug. 2013)	(12,20 %)	3,73 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 31. Jul. 2013)	(12,27 %)	3,80 %
Investor GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Jan. 2020)	(12,50 %)	(2,32 %)
Class R GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 18. Jun. 2014)	(12,36 %)	2,38 %
ICE BofA SONIA Overnight Rate Index ⁷	1,42 %	0,59 % ²

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der PIMCO Capital Securities Fund strebt Engagements mit Fokus auf Capital Securities (wie im Verkaufsprospekt definiert) zusammen mit einer maximalen Gesamterträge an, in Übereinstimmung mit der Kapitalerhaltung und umsichtigen Anlageverwaltung durch die Anlage in ein aktiv verwaltetes, aus Rentenwerten bestehendes Portfolio (wie im Verkaufsprospekt definiert) und andere Wertpapiere, von denen gemäß den im Verkaufsprospekt des Teilfonds angegebenen Richtlinien mindestens 80 % in Capital Securities angelegt werden. Der Fonds bewirbt ökologische Eigenschaften, verfolgt jedoch kein nachhaltiges Anlageziel.

Kommentare zum Fonds

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

» Ausgewählte Zinsswap-Positionen trugen zur Wertentwicklung bei.

» Das Engagement in vorrangigen und Tier-2-Schuldtiteln einer italienischen Bank, die sich nach der Sicherung einer Kapitalerhöhung überdurchschnittlich entwickelte, leistete einen positiven Beitrag.

» Das Engagement und die Titelauswahl im Additional-Tier-1-Anleihen (AT1) und nachrangigen Hybridanleihen, insbesondere in AT1s einer ausgewählten Schweizer Bank und unbefristeten Anleihen ausgewählter niederländischer und britischer Emittenten, die unterdurchschnittlich abschnitten, waren abträglich.

» Das taktische Engagement in Nicht-Finanzwerten und Hybridanleihen von Unternehmen war abträglich, da sich die Spreads ausweiteten.

» Das Engagement und die Titelauswahl bei Tier-2-Anleihen und Coco-Bonds, insbesondere von ausgewählten französischen Emittenten, waren abträglich.

Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2022 abgelaufenen Berichtszeitraum¹
(Forts.)

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Auf HKD lautende Klassen		
M Retail HKD (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 28. Jul. 2017)	(12,27 %)	1,62 %
3 Month HIBOR Index	1,49 %	1,37 %
Auf SGD lautende Klassen		
Institutional SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Jul. 2021)	(11,68 %)	(8,08 %)
Investor SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 23. Mai 2018)	(12,02 %)	1,77 %
Administrative SGD (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 12. Aug. 2022)	—	(2,10 %)
M Retail SGD (Hedged) ausschüttend II (Auflegung 23. Dez. 2013)	(12,53 %)	3,05 %
SORA Singapore Interbank Overnight Rate Average ⁸	1,71 %	1,08 % ²

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

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

³ Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den PIMCO Capital Securities Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 30. Juni 2022: 3-Monats-USD-LIBOR; ab 1. Juli 2022: ICE BofA SOFR Overnight Rate Index.

⁴ Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den PIMCO Capital Securities Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 30. Juni 2022: 3-Monats-USD-LIBOR (CAD Hedged) Index; ab 1. Juli 2022: Canadian Overnight Repo Rate (CORRA).

⁵ Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den PIMCO Capital Securities Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 30. Juni 2021: 3-Monats-USD-LIBOR (Hedged to CHF) Index; ab 1. Juli 2021: ICE BofA SARON Overnight Rate Index.

⁶ Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den PIMCO Capital Securities Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 30. Juni 2021: 3-Monats-Euribor Index; ab 1. Juli 2021: Euro Short-Term Rate (ESTER) Index.

⁷ Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den PIMCO Capital Securities Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 30. Juni 2021: 3-Monats-GBP-LIBOR Index; ab 1. Juli 2021: ICE BofA SONIA Overnight Rate Index.

⁸ Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den PIMCO Capital Securities Fund repräsentiert Folgendes: Auflegungsdatum bis 30. Juni 2022: 3-Monats-GBP-LIBOR Index; ab 1. Juli 2022: SORA Singapore Interbank Overnight Rate Average.

Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2022 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung 23. Sep. 2020)	(12,76 %)	(5,38 %)
Class Z, thesaurierend (Auflegung 23. Sep. 2020)	(12,28 %)	(4,86 %)
Bloomberg MSCI Green Bond Index (USD Hedged)	(17,01 %)	(8,23 %)
Auf CHF lautende Klassen		
Institutional CHF, thesaurierend (Auflegung 13. Nov. 2020)	(15,04 %)	(7,75 %)
Bloomberg MSCI Green Bond Index (CHF Hedged)	(19,42 %)	(10,86 %)
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 23. Sep. 2020)	(14,60 %)	(6,71 %)
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 02. Dez. 2020)	(14,63 %)	(7,72 %)
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 23. Sept. 2020)	(15,37 %)	(7,54 %)
Bloomberg MSCI Green Bond Index (EUR Hedged)	(18,98 %)	(9,64 %) ²
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 23. Sep. 2020)	(13,49 %)	(5,85 %)
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Apr. 2021)	(13,55 %)	(8,11 %)
Bloomberg MSCI Green Bond Index (GBP Hedged)	(18,11 %)	(8,87 %) ²
Auf SEK lautende Klassen		
Institutional SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Juni 2021)	(14,25 %)	(10,09 %)
Administrative SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 08. Okt. 2021)	(14,66 %)	(12,52 %)
Bloomberg MSCI Green Bond Index (SEK Hedged)	(18,86 %)	(13,24 %) ²
Auf SGD lautende Klassen		
Institutional SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 26. Feb. 2021)	(12,90 %)	(6,81 %)
Bloomberg MSCI Green Bond Index (SGD Hedged)	(17,29 %)	(9,76 %)

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

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

Kommentare zum Fonds

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

- » Die Positionierung in Zinssätzen der europäischen Kernländer trug zur absoluten Wertentwicklung bei, da die Renditen stiegen.
- » Es gab keine weiteren Faktoren, die einen wesentlichen Beitrag zu diesem Teilfonds leisteten.
- » Das Long-Engagement in der Duration der Industrieländer belastete die absolute Wertentwicklung, insbesondere in den USA, da die Renditen stiegen.
- » Ein Long-Engagement bei Unternehmenskreditrisiken minderte die Wertentwicklung, da sich die Spreads erweiterten.
- » Ein Long-Engagement bei Auslandsschulden von Schwellenländern belastete die Wertentwicklung, da sich die Spreads erweiterten.

Commodity Real Return Fund

Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2022 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 31. Aug. 2006)	10,79 %	(0,22 %)
Investor, thesaurierend (Auflegung: 11. Aug. 2011)	10,49 %	(1,60 %)
Class E, thesaurierend (Auflegung: 21. Sep. 2007)	9,82 %	(1,53 %)
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 29. Apr. 2022)	—	(15,40 %)
Bloomberg Commodity Index Total Return	16,09 %	(1,54 %) ²
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 08. Jun. 2010)	8,55 %	(0,50 %)
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 07. Mrz. 2012)	7,63 %	(3,00 %)
Bloomberg Commodity Index Total Return (EUR Hedged)	13,76 %	(1,71 %) ²
Auf EUR lautende Klassen (nicht abgesichert)		
Institutional EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 11. Juni 2021)	18,14 %	20,40 %
Bloomberg Commodity Index Total Return (EUR Unhedged)	23,78 %	22,84 %
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 01. Mrz. 2017)	9,66 %	4,83 %
Bloomberg Commodity Index Total Return (GBP Hedged)	14,96 %	4,09 %
Auf GBP lautende Klassen (nicht abgesichert)		
Institutional GBP (Unhedged), ausschüttend (Auflegung 11. Nov. 2022)	—	(5,01 %)
Bloomberg Commodity Index Total Return (GBP Unhedged)	—	(4,96 %)
Auf SGD lautende Klassen		
Class E SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 17. Dez. 2021)	9,59 %	12,59 %
Bloomberg Commodity Index Total Return (SGD Hedged)	15,56 %	18,06 %

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

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

Kommentare zum Fonds

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

- » Ein Engagement in breiten Rohstoffkategorien trug zur absoluten Wertentwicklung bei, da breite Rohstoffkategorien, gemessen am Bloomberg Commodity Index Total Return, positive Renditen verbuchten.
- » Die strukturelle Allokation auf globale kurzfristige inflationsgebundene Anleihen (ILBs) als Sicherheiten zur Deckung des Rohstoffengagements des Fonds belasteten die absolute Wertentwicklung, da globale kurzfristige ILBs, gemessen am Bloomberg Barclays World Government Inflation-Linked Bond 1-5 Year Index (USD Hedged), Verluste verbuchten.
- » Ein untergewichtetes Engagement in nominalen US-amerikanischen Zinsen trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die nominalen US-Renditen stiegen.
- » Ein untergewichtetes Engagement in nominalen europäischen Zinsen trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die nominalen Renditen in der Eurozone stiegen.
- » Ein übergewichtetes Engagement in nominalen britischen Zinsen schmälerte die relative Wertentwicklung, da die nominalen Renditen im Vereinigten Königreich stiegen.
- » Ein Engagement bei Non-Agency-MBS war der relativen Wertentwicklung abträglich, da sich die Spreads auf diese Wertpapiere erweiterten.

PIMCO Credit Opportunities Bond Fund

Durchschnittliche jährliche Gesamterrendite für den am 31. Dezember 2022 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 14. Okt. 2011)	(3,62 %)	2,76 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 21. Dez. 2012)	(4,52 %)	1,14 %
ICE BofA SOFR Overnight Rate Index ³	1,78 %	0,97 % ²
Auf CHF lautende Klassen		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 17. Dez. 2012)	(6,14 %)	0,25 %
ICE BofA SARON Overnight Rate Index ⁴	(0,24 %)	(0,75 %)
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 14. Okt. 2011)	(5,61 %)	1,47 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 21. Dez. 2012)	(6,43 %)	(0,25 %)
Euro Short-Term Rate (ESTER) Index ⁵	(0,02 %)	(0,06 %) ²

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

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

³ Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den PIMCO Credit Opportunities Bond Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 30. Juni 2022: 3-Monats-USD-LIBOR Index; ab 1. Juli 2022: ICE BofA SOFR Overnight Rate Index.

⁴ Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den PIMCO Credit Opportunities Bond Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 30. Juni 2021: 3-Monats-USD-LIBOR (Hedged to CHF) Index; ab 1. Juli 2021: ICE BofA SARON Overnight Rate Index.

⁵ Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den PIMCO Credit Opportunities Bond Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 30. Juni 2021: 3-Monats-Euribor Index; ab 1. Juli 2021: Euro Short-Term Rate (ESTER) Index.

Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

Kommentare zum Fonds

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

- » Die Positionierung bei Finanzwerten mit Investment Grade trug zur Wertentwicklung bei, da ein ausgewählter Emittent überdurchschnittlich gut abschnitt.
- » Die Titelauswahl bei Telekommunikationstiteln mit Investment Grade trug zur Wertentwicklung bei, da sich ausgewählte Emittenten im zweiten Halbjahr vor dem Hintergrund einer Spreadverengung sehr gut entwickelten, wie Staatsanleihen mit Duration.
- » Ein Engagement in Duration belastete die Wertentwicklung, da die Zinsen abverkauft wurden.
- » Das Engagement in Schwellenländern war der Wertentwicklung abträglich, da ausgewählte chinesische Immobilienentwickler zurückblieben.
- » Das Engagement in verbrieften Wertpapieren belastete die Wertentwicklung, da ausgewählte Non-Agency-RMBS schwach abschnitten.

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2005)	(16,30 %)	5,01 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 08. Sep. 2008)	(16,28 %)	4,98 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 30. Apr. 2013)	(16,64 %)	1,83 %
Investor, ausschüttend (Auflegung: 30. Apr. 2013)	(16,57 %)	1,83 %
Administrative, ausschüttend (Auflegung: 21. Jul. 2011)	(16,76 %)	2,90 %
BM Retail, ausschüttend II (Auflegung: 28. Apr. 2022)	—	(6,15 %)
BN Retail, ausschüttend II (Auflegung: 28. Apr. 2022)	—	(6,15 %)
Class E, thesaurierend (Auflegung: 11. Sep. 2006)	(17,04 %)	4,00 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 31. Jul. 2006)	(17,04 %)	4,08 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 08. Jun. 2011)	(16,48 %)	3,23 %
H Institutional, ausschüttend (Auflegung: 14. Mai 2020)	(16,55 %)	(2,49 %)
M Retail, ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2010)	(17,07 %)	2,78 %
M Retail, ausschüttend II (Auflegung: 23. Dez. 2013)	(17,06 %)	1,81 %
N Retail, ausschüttend II (Auflegung: 30. Okt. 2020)	(17,15 %)	(6,71 %)
Class T, thesaurierend (Auflegung: 16. Okt. 2014)	(17,38 %)	1,09 %
Class T, ausschüttend (Auflegung: 16. Okt. 2014)	(17,35 %)	1,09 %
Class W, thesaurierend (Auflegung: 12. Aug. 2020)	(16,15 %)	(5,58 %)
Class W, ausschüttend (Auflegung: 12. Aug. 2020)	(16,22 %)	(5,59 %)
jeweils 1/3 Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets, USD Hedged; ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index, USD Hedged; und JPMorgan EMBI Global, USD Hedged ³	(13,42 %)	4,81 % ²
Auf AUD lautende Klassen		
Administrative AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 22. Mai 2019)	(17,80 %)	(2,55 %)
M Retail AUD (Hedged) ausschüttend (Auflegung: 19. Dez. 2012)	(18,19 %)	1,91 %
jeweils 1/3 Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets, AUD Hedged; ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index, AUD Hedged; und JPMorgan EMBI Global, AUD Hedged ³	(14,86 %)	2,86 % ²
Auf CAD lautende Klassen		
Institutional CAD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 20. Feb. 2019)	(16,60 %)	(0,65 %)
jeweils 1/3 Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets, CAD Hedged; ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index, CAD Hedged; und JPMorgan EMBI Global, CAD Hedged ³	(13,92 %)	(0,23 %)
Auf CHF lautende Klassen		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 24. Jun. 2011)	(18,61 %)	1,62 %
Institutional CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 31. Aug. 2012)	(18,57 %)	0,83 %
Class E CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 11. Sept. 2019)	(19,36 %)	(5,38 %)
Class W CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 12. Aug. 2020)	(18,55 %)	(7,32 %)
Class W CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 12. Aug. 2020)	(18,50 %)	(7,29 %)
jeweils 1/3 Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets, CHF Hedged; ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index, CHF Hedged; und JPMorgan EMBI Global, CHF Hedged ³	(15,99 %)	1,73 % ²
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 14. Feb. 2007)	(18,31 %)	3,75 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 17. Okt. 2007)	(18,30 %)	3,75 %
Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 05. Jul. 2007)	(18,60 %)	3,53 %
Investor EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 15. Feb. 2013)	(18,58 %)	0,49 %
Administrative EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 20. Jul. 2007)	(18,72 %)	3,38 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 03. Jul. 2007)	(19,03 %)	3,00 %
Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 16. Okt. 2009)	(19,08 %)	2,35 %
Class T EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Sep. 2014)	(19,35 %)	(0,77 %)

Der Diversified Income Fund ist bemüht, einen höchstmöglichen Gesamtertrag bei umsichtiger Anlageverwaltung zu erreichen, indem er mindestens zwei Drittel seines Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio mit Renteninstrumenten (wie im Verkaufsprospekt definiert) mit unterschiedlichen Laufzeiten anlegt.

Kommentare zum Fonds

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

- » Die Titelauswahl bei hochverzinslichen Industrierwerten trug zur Wertentwicklung bei, insbesondere das Engagement in einem bestimmten Emittenten aus dem Gesundheitswesen, der eine unterdurchschnittliche Entwicklung aufwies.
- » Die Titelauswahl bei Versorgern mit Investment Grade-Rating trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Kreditspreads im Sektor ausweiteten.
- » Das Engagement in ausgewählten chinesischen Bauträgern war der Wertentwicklung abträglich, da bestimmte Immobilienemittenten angesichts des anhaltenden Liquiditätsdrucks eine unterdurchschnittliche Entwicklung aufwiesen.
- » Die Titelauswahl bei hochverzinslichen Finanzwerten belastete die Wertentwicklung, insbesondere das Engagement in einem ausgewählten europäischen Immobilienwert, der eine unterdurchschnittliche Entwicklung aufwies.
- » Die Zinspositionierung schmälerte die Wertentwicklung, da eine erhöhte Volatilität zu einer größeren Streuung der Wertentwicklung der physischen und derivativen Zinsmärkte führte.

Diversified Income Fund (Forts.)

Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2022 abgelaufenen Berichtszeitraum¹
(Forts.)

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Class T EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Sep. 2014)	(19,31 %)	(0,77 %)
Class W EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung 12. Aug. 2020)	(18,21 %)	(7,05 %)
Class W EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung 12. Aug. 2020)	(18,29 %)	(7,07 %)
jeweils 1/3 Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets, EUR Hedged; ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index, EUR Hedged; und JPMorgan EMBI Global, EUR Hedged ³	(15,66 %)	3,35 % ²
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 16. Mai 2006)	(17,20 %)	4,68 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 14. Feb. 2006)	(17,22 %)	4,62 %
Administrative GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 21. Jul. 2011)	(17,67 %)	2,22 %
Class W GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung 12. Aug. 2020)	(17,18 %)	(6,22 %)
Class W GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung 12. Aug. 2020)	(17,09 %)	(6,18 %)
jeweils 1/3 Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets, GBP Hedged; ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index, GBP Hedged; und JPMorgan EMBI Global, GBP Hedged ³	(14,65 %)	4,30 % ²
Auf JPY lautende Klassen		
Administrative JPY (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 08. Okt. 2021)	(19,08 %)	(15,74 %)
jeweils 1/3 Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets, JPY Hedged; ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index, JPY Hedged; und JPMorgan EMBI Global, JPY Hedged ³	(16,30 %)	(13,06 %)
Auf MXN lautende Klassen		
Institutional MXN (Hedged), thesaurierend (Auflegung 09. Dez. 2020)	(10,71 %)	(2,79 %)
jeweils 1/3 Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets, MXN Hedged; ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index, MXN Hedged; und JPMorgan EMBI Global, MXN Hedged ³	(7,65 %)	(0,77 %)
Auf SEK lautende Klassen		
Institutional SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)	(17,96 %)	4,12 %
Administrative SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung 30. Dez. 2020)	(18,39 %)	(10,15 %)
jeweils 1/3 Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets, SEK Hedged; ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index, SEK Hedged; und JPMorgan EMBI Global, SEK Hedged ³	(15,51 %)	3,72 % ²
Auf SGD lautende Klassen		
Institutional SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 07. Nov. 2019)	(16,57 %)	(3,04 %)
Administrative SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 01. Mai 2019)	(16,95 %)	(1,84 %)
Class E SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung 1. Okt. 2019)	(17,32 %)	(3,84 %)
Class W SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung 12. Aug. 2020)	(16,40 %)	(5,63 %)
jeweils 1/3 Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets, SGD Hedged; ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index, SGD Hedged; und JPMorgan EMBI Global, SGD Hedged ³	(13,88 %)	(0,68 %) ²

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

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

³ Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Diversified Income Fund repräsentiert Folgendes: Von der Auflegung bis zum 9. November 2015 jeweils 1/3 Bloomberg Global Aggregate Credit Component (USD Hedged), ICE BofA Merrill Lynch Global High Yield BB-B Rated Constrained (USD Hedged) und JPMorgan EMBI Global; seit dem 10. November 2015 jeweils 1/3 Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets (USD Hedged), ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index (USD Hedged) und JPMorgan EMBI Global (USD Hedged).

Durchschnittliche jährliche Gesamtrendite für den am 31. Dezember 2022 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 31. Mai 2011)	(4,13 %)	3,18 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 18. Feb. 2014)	(4,47 %)	2,06 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 16. Aug. 2013)	(5,03 %)	1,69 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 31. Mai 2011)	(4,99 %)	2,29 %
jeweils 1/3 Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets, USD Hedged; ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index, USD Hedged; und JPMorgan EMBI Global, USD Hedged ³	(2,11 %)	2,97 % ²
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 16. Aug. 2011)	(6,20 %)	2,13 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 01. Okt. 2013)	(6,09 %)	1,00 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 11. Aug. 2011)	(6,96 %)	1,33 %
Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung 07. Mai 2013)	(7,03 %)	(0,16 %)
jeweils 1/3 Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets, EUR Hedged; ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index, EUR Hedged; und JPMorgan EMBI Global, EUR Hedged ³	(4,29 %)	2,09 % ²
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 23. Aug. 2011)	(4,72 %)	2,96 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 22. Jan. 2013)	(4,78 %)	1,65 %
jeweils 1/3 Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets, GBP Hedged; ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index, GBP Hedged; und JPMorgan EMBI Global, GBP Hedged ³	(2,98 %)	2,79 % ²

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

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

³ Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Diversified Income Duration Hedged Fund repräsentiert Folgendes: Von der Auflegung bis zum 9. November 2015: Bogley 4309 (Eine Mischung aus folgenden drei Indizes bei konstanter Duration von 25 Jahren: jeweils 1/3 Bloomberg Global Aggregate Credit (USD Hedged), ICE BofA Merrill Lynch High Yield BB-B Rated Developed Markets Constrained (USD Hedged), JPMorgan EMBI Global; seit dem 10. November 2015: Eine Mischung aus folgenden drei Indizes bei konstanter Duration von 25 Jahren: jeweils 1/3 Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets (USD Hedged), ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index (USD Hedged) und JPMorgan EMBI Global (USD Hedged).

Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

Kommentare zum Fonds

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

- » Die Titelauswahl bei hochverzinslichen Industrierwerten trug zur Wertentwicklung bei, insbesondere das Engagement in einem bestimmten Emittenten aus dem Gesundheitswesen, der eine unterdurchschnittliche Entwicklung aufwies.
- » Die Titelauswahl bei Versorgern mit Investment Grade-Rating trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Kreditspreads im Sektor ausweiteten.
- » Das Engagement in ausgewählten chinesischen Bauträgern war der Wertentwicklung abträglich, da bestimmte Immobilienemittenten angesichts des anhaltenden Liquiditätsdrucks eine unterdurchschnittliche Entwicklung aufwiesen.
- » Die Titelauswahl in verbrieften Vermögenswerten, insbesondere das Engagement in Non-Agency-RMBS, belastete die Wertentwicklung.
- » Die Titelauswahl bei hochverzinslichen Finanzwerten belastete die Wertentwicklung, insbesondere das Engagement in einem ausgewählten europäischen Immobilienwert, der eine unterdurchschnittliche Entwicklung aufwies.

Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2022 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 27. Jul. 2022)	—	(1,10 %)
Class E, thesaurierend (Auflegung: 27. Jul. 2022)	—	(1,50 %)
jeweils 1/3 Bloomberg Global Aggregate Credit ex-Emerging Markets, ICE BofAML BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained ESG Tilt Index und JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index Global Diversified	—	(1,07 %)
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 27. Jul. 2022)	—	(2,40 %)
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 27. Jul. 2022)	—	(2,80 %)
jeweils 1/3 Bloomberg Global Aggregate Credit ex-Emerging Markets (EUR Hedged), ICE BofAML BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained ESG Tilt Index (EUR Hedged) und JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index Global Diversified (EUR Hedged)	—	(2,51 %)
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 27. Jul. 2022)	—	(1,70 %)
jeweils 1/3 Bloomberg Global Aggregate Credit ex-Emerging Markets (GBP Hedged), ICE BofAML BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained ESG Tilt Index (GBP Hedged) und JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index Global Diversified (GBP Hedged)	—	(2,00 %)

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Diversified Income ESG Fund beabsichtigt, seine Erträge mit umsichtiger Anlageverwaltung zu maximieren. Der Fonds investiert mindestens zwei Drittel seines Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio aus Rentenwerten mit unterschiedlichen Laufzeiten. Der Fonds verfolgt das Ziel, unter normalen Marktbedingungen auf verschiedene Weise ökologische und soziale Eigenschaften zu bewerten, wie in der Ergänzung für den Fonds dargelegt, und beabsichtigt, einen Teil seines Vermögens in nachhaltige Anlagen zu investieren.

Der Fonds nahm seine Tätigkeit am 27. Juli 2022 auf.

Kommentare zum Fonds

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

- » Die Titelauswahl bei hochverzinslichen Industrierenten trug zur Wertentwicklung bei, insbesondere das übergewichtete Engagement in einem bestimmten Emittenten aus dem Medienbereich, der eine überdurchschnittliche Entwicklung aufwies.
- » Makrostrategien trugen wegen einer Untergewichtung der Duration von Industrieländern zur Wertentwicklung bei.
- » Die Titelauswahl bei Finanzwerten mit Investment Grade kam der Wertentwicklung zugute, insbesondere das übergewichtete Engagement bei ausgewählten Finanzdienstleistern und europäischen Banken, die überdurchschnittlich gut abschnitten.
- » Die Titelauswahl bei den Auslandsschuldentiteln von Schwellenländern war der Wertentwicklung abträglich, insbesondere das untergewichtete Engagement bei ausgewählten osteuropäischen Emittenten, die sich gut entwickelten.
- » Die Auswahl hochverzinslicher Titel im Gesundheitssektor belastete die Wertentwicklung, insbesondere das übergewichtete Engagement in einem bestimmten Gesundheitsdienstleister, der unterdurchschnittlich abschnitt.

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 15. Dez. 2008)	(8,00 %)	2,20 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 22. Feb. 2010)	(7,99 %)	1,82 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 24. Sep. 2010)	(8,39 %)	1,12 %
Investor, ausschüttend (Auflegung: 24. Sep. 2010)	(8,35 %)	1,11 %
Administrative, thesaurierend (Auflegung: 21. Jan. 2010)	(8,42 %)	1,30 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 11. Mai 2010)	(8,86 %)	0,76 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 11. Mai 2010)	(8,82 %)	0,78 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 12. Dez. 2018)	(8,21 %)	0,42 %
H Institutional, ausschüttend (Auflegung: 14. Feb. 2020)	(8,23 %)	(1,22 %)
Class R, thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	(8,13 %)	1,01 %
Class Z, thesaurierend (Auflegung: 15. Sep. 2021)	(7,15 %)	(6,09 %)
ICE BofA SOFR Overnight Rate Index ³	1,69 %	0,71 % ²
Auf AUD lautende Klassen		
Class Z AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 18. Mrz. 2014)	(8,00 %)	2,64 %
Bloomberg AusBond Bank Bills Index	1,25 %	1,52 %
Auf CAD lautende Klassen		
Institutional CAD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 21. Sep. 2018)	(8,20 %)	0,19 %
Canadian Overnight Repo Rate (CORRA) ⁴	1,83 %	0,99 %
Auf CHF lautende Klassen		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 08. Sep. 2010)	(10,39 %)	(0,07 %)
Class E CHF (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 18. Apr. 2011)	(11,22 %)	(1,03 %)
ICE BofA SARON Overnight Rate Index ⁵	(0,24 %)	(0,45 %) ²
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 21. Mai 2009)	(9,95 %)	1,25 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 23. Dez. 2009)	(9,99 %)	0,82 %
Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Jan. 2011)	(10,24 %)	0,07 %
Administrative EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 21. Jan. 2010)	(10,40 %)	0,25 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 20. Nov. 2009)	(10,76 %)	(0,08 %)
G Retail EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 14. Dez. 2010)	(10,77 %)	(0,43 %)
Euro Short-Term Rate (ESTER) Index ⁶	(0,02 %)	0,01 % ²
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 15. Dez. 2009)	(8,64 %)	1,45 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 27. Feb. 2012)	(8,74 %)	1,03 %
Class E GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 18. Mrz. 2010)	(9,44 %)	0,42 %
ICE BofA SONIA Overnight Rate Index ⁷	1,42 %	0,54 % ²
Auf NOK lautende Klassen		
Institutional NOK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 11. Apr. 2011)	(8,63 %)	1,62 %
1 Month NIBOR Rate Index	1,59 %	1,28 %
Auf SEK lautende Klassen		
Administrative SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 18. Nov. 2011)	(9,91 %)	0,23 %
ICE BofA SOFR Overnight Rate Index (SEK Hedged) ³	0,45 %	0,21 %

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

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

³ Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Dynamic Bond Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 30. Juni 2022: 1-Monats-USD-LIBOR Index; ab 1. Juli 2021: ICE BofA SOFR Overnight Rate Index.

⁴ Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Dynamic Bond Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 30. Juni 2022: 1-Monats-LIBOR Index (CAD Hedged); ab 1. Juli 2022: Canadian Overnight Repo Rate (CORRA).

⁵ Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Dynamic Bond Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 30. Juni 2021: 1-Monats-CHF-LIBOR Index; ab 1. Juli 2021: ICE BofA SARON Overnight Rate Index.

⁶ Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Dynamic Bond Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 30. Juni 2021: 1-Monats-Euribor Index; ab 1. Juli 2021: Euro Short-Term Rate (ESTER) Index.

⁷ Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Dynamic Bond Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 30. Juni 2021: 1-Monats-GBP-LIBOR Index; ab 1. Juli 2021: SONIA ICE BofA SONIA Overnight Rate Index.

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

Kommentare zum Fonds

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

- » Ein Short-Engagement in britischer Duration trug zur Wertentwicklung bei, da die Zinsen im Vereinigten Königreich stiegen.
- » Short-Engagements gegenüber dem Euro trugen zur Wertentwicklung bei, da er gegenüber dem US-Dollar an Wert verlor.
- » Long-Engagements gegenüber dem Brasilianischem Real trugen zur Wertentwicklung bei, da er gegenüber dem US-Dollar an Wert gewann.
- » Ein Long-Engagement in US-amerikanischer Duration schmälerte die Wertentwicklung, da die US-Zinsen stiegen.
- » Ein Long-Engagement in italienischer Duration belastete die Wertentwicklung, da die italienischen Zinsen stiegen.
- » Beteiligungen an Unternehmensanleihen mit Investment Grade waren dem Ergebnis abträglich, da sich die Spreads auf diese Wertpapiere erweiterten.

Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2022 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 25. Feb. 2016)	(14,17 %)	2,61 %
Institutional, ausschüttend II (Auflegung: 25. Feb. 2016)	(14,12 %)	2,62 %
Investor, thesaurierend (Auflegung 14. Aug. 2020)	(14,42 %)	(2,91 %)
Class E, thesaurierend (Auflegung: 25. Feb. 2016)	(14,98 %)	1,56 %
Class E, ausschüttend (Auflegung 10. Sep. 2020)	(14,90 %)	(3,32 %)
Class T, thesaurierend (Auflegung: 20. Okt. 2016)	(15,35 %)	0,42 %
Class Z, thesaurierend (Auflegung: 01. Aug. 2019)	(13,38 %)	2,14 %
Euro Short-Term Rate (ESTER) Index ³	(0,02 %)	(0,37 %) ²
Auf AUD lautende Klassen		
BM Retail AUD (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 28. Apr. 2022)	—	(6,88 %)
M Retail AUD (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 8. Apr. 2021)	(14,25 %)	(8,24 %)
Bloomberg AusBond Bank Bills Index	1,25 %	0,74 % ²
Auf CHF lautende Klassen		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 14. Mrz. 2018)	(14,59 %)	0,62 %
ICE BofA SARON Overnight Rate Index ⁴	(0,24 %)	(0,67 %)
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 25. Feb. 2016)	(13,09 %)	3,44 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Jan. 2019)	(13,06 %)	2,85 %
ICE BofA SONIA Overnight Rate Index ⁵	1,42 %	0,53 % ²
Auf ILS lautende Klassen		
Institutional ILS (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 27. Sep. 2022)	—	(0,60 %)
SHIR Shekel Overnight Risk Free Rate	—	0,74 %
Auf SGD lautende Klassen		
Institutional SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Jul. 2021)	(12,40 %)	(8,89 %)
M Retail SGD (Hedged), ausschüttend II (Auflegung 18. Dez. 2020)	(13,27 %)	(5,94 %)
SORA Singapore Interbank Overnight Rate Average	1,57 %	0,86 % ²
Auf USD lautende Klassen		
Institutional USD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 25. Feb. 2016)	(12,27 %)	4,66 %
Institutional USD (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 30. Apr. 2021)	(12,28 %)	(6,83 %)
Investor USD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 11. Mai 2021)	(12,62 %)	(6,66 %)
BM Retail USD (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 28. Apr. 2022)	—	(6,09 %)
Class E USD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 15. Mrz. 2017)	(13,18 %)	2,49 %
Class E USD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 18. Mrz. 2021)	(13,16 %)	(6,66 %)
Class E USD (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 9. Sep. 2021)	(13,11 %)	(11,21 %)
H Institutional USD (Hedged), thesaurierend (Auflegung 05. Aug. 2020)	(12,44 %)	(1,81 %)
M Retail USD (Hedged), ausschüttend II (Auflegung 08. Jan. 2020)	(13,16 %)	0,67 %
Class T USD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 9. Sep. 2021)	(13,43 %)	(11,59 %)
ICE BofA SOFR Overnight Rate Index ⁶	1,69 %	1,20 % ²

Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

Kommentare zum Fonds

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

- » Ein Long-Engagement in US-amerikanischer, australischer und kanadischer Duration schmälerte die Rendite, da die Renditen auf US-amerikanische, australische und kanadische Staatsanleihen anstiegen.
- » Ein Long-Engagement in chinesischen Aktien belastete die Wertentwicklung, da die Kurse fielen.
- » Ein Long-Engagement in taiwanesischen Aktien schmälerte die Wertentwicklung, da die Kurse fielen.
- » Ein Long-Engagement in Schwellenlandwährungen trug zu den Renditen bei, da diese gegenüber dem Euro aufwerteten.
- » Ein Short-Engagement in der Duration der Eurozone im zweiten Halbjahr war der Rendite förderlich, da die Anleihezinsen stiegen.

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

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

³ Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Dynamic Multi-Asset Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 30. Juni 2021: 1-Monats-Euribor Index; ab 1. Juli 2021: Euro Short-Term Rate (ESTER) Index.

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

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

⁶ Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Dynamic Multi-Asset Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 30. Juni 2022: 1-Monats-USD-LIBOR Index; ab 1. Juli 2021: ICE BofA SOFR Overnight Rate Index.

Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2022 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 11. Dez. 2007)	(6,58 %)	1,56 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 18. Apr. 2008)	(6,52 %)	1,34 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 18. Aug. 2010)	(6,84 %)	(0,39 %)
Class E, thesaurierend (Auflegung: 19. Nov. 2008)	(7,49 %)	2,32 %
Class E, ausschüttend (Auflegung 08. Jul. 2010)	(7,40 %)	(0,66 %)
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 26. Feb. 2021)	(6,61 %)	(6,12 %)
Class Z, ausschüttend (Auflegung: 18. Nov. 2008)	(5,74 %)	4,18 %
JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (Unhedged)	(11,69 %)	1,41 % ²
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 16. Apr. 2010)	(0,46 %)	2,12 %
Institutional EUR (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 23. Jun. 2010)	(0,47 %)	1,54 %
Investor EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 20. Dez. 2019)	(0,75 %)	(2,47 %)
Class E EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 02. Jul. 2009)	(1,39 %)	2,63 %
Class E EUR (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 12. Dez. 2018)	(1,46 %)	1,56 %
JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (EUR Unhedged)	(5,90 %)	3,44 % ²
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 27. Jun. 2008)	5,23 %	5,16 %
JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (GBP Unhedged)	(0,56 %)	4,96 %

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

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Emerging Local Bond Fund beabsichtigt, seine Erträge mithilfe umsichtiger Anlageverwaltung zu maximieren. Der Fonds legt grundsätzlich mindestens 80 % seiner Vermögenswerte in Rentenwerte (wie im Verkaufsprospekt definiert) an, die auf Währungen von Ländern mit Schwellenwertpapiermärkten lauten, die Terminkontrakte oder Derivate wie Optionen, Futures oder Swap-Vereinbarungen enthalten können.

Kommentare zum Fonds

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

- » Die Positionierung in russischer lokaler Duration trug zur Wertentwicklung bei, da die russischen lokalen Renditen stiegen, als der Fonds untergewichtetes Engagement hatte, und fielen, als der Fonds leicht übergewichtet war.
- » Ein untergewichtetes Engagement in der lokalen Duration in Polen trug zur Wertentwicklung bei, da die lokalen Renditen in Polen stiegen.
- » Das untergewichtete Engagement im ägyptischen Pfund war der Wertentwicklung zuträglich, da die ägyptische Währung abwertete.
- » Ein übergewichtetes Engagement in der lokalen Duration in Brasilien schmälerte die Wertentwicklung, da die lokalen Renditen in Brasilien stiegen.
- » Ein Untergewichtung Engagement in der lokalen Duration in der Türkei schmälerte die Wertentwicklung, da die lokalen Renditen in der Türkei sanken.

Emerging Local Bond ESG Fund

Durchschnittliche jährliche Gesamtrendite für den am 31. Dezember 2022 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 27. Jul. 2022)	—	5,70 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 27. Jul. 2022)	—	5,71 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 27. Jul. 2022)	—	5,60 %
Investor, ausschüttend (Auflegung: 27. Jul. 2022)	—	5,55 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 27. Jul. 2022)	—	5,30 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 27. Jul. 2022)	—	5,26 %
Class Z, thesaurierend (Auflegung 23. Sep. 2022)	—	7,70 %
JPMorgan ESG Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index	—	5,62 % ²
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 27. Juli 2002)	—	0,20 %
Institutional EUR (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 27. Juli 2022)	—	0,28 %
Investor EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 27. Dez. 2022)	—	0,10 %
Investor EUR (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 27. Juli 2022)	—	0,13 %
Class E EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 27. Juli 2022)	—	(0,20 %)
Class E EUR (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 27. Juli 2022)	—	(0,25 %)
JPMorgan ESG Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (EUR Unhedged)	—	0,16 %

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

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Emerging Local Bond ESG Fund beabsichtigt, seine Erträge mithilfe umsichtiger Anlageverwaltung zu maximieren. Der Fonds investiert normalerweise mindestens 80 % seines Vermögens in festverzinsliche Instrumente, die auf Währungen von Ländern mit Schwellenland-Wertpapiermärkten lauten. Der Fonds verfolgt das Ziel, unter normalen Marktbedingungen auf verschiedene Weise ökologische und soziale Eigenschaften zu bewerben, wie in der Ergänzung für den Fonds dargelegt, und beabsichtigt, einen Teil seines Vermögens in nachhaltige Anlagen zu investieren.

Der Fonds nahm seine Tätigkeit am 27. Juli 2022 auf.

Kommentare zum Fonds

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

- » Das untergewichtete Engagement im ägyptischen Pfund war der Wertentwicklung zuträglich, da die Währung abwertete.
- » Das übergewichtete Engagement im Malaysischen Ringgit war der Wertentwicklung zuträglich, da die Währung aufwertete.
- » Das übergewichtete Engagement im Taiwanesischen Dollar war der Wertentwicklung zuträglich, da die Währung aufwertete.
- » Ein Untergewichtung Engagement in der lokalen Duration in der Türkei schmälerte die Wertentwicklung, da die lokalen Renditen in der Türkei sanken.
- » Das untergewichtete Engagement im polnischen Zloty war der Wertentwicklung abträglich, da die Währung an Wert gewann.

Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2022 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 31. Jul. 2001)	(17,05 %)	7,29 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 13. Dez. 2001)	(17,06 %)	6,66 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 25. Apr. 2002)	(17,33 %)	5,92 %
Administrative, thesaurierend (Auflegung: 29. Mai 2003)	(17,46 %)	4,83 %
BM Retail, ausschüttend II (Auflegung: 28. Apr. 2022)	—	(5,91 %)
Class E, thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)	(17,80 %)	3,50 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 28. Okt. 2005)	(17,80 %)	3,66 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 17. Okt. 2002)	(17,18 %)	6,81 %
H Institutional, ausschüttend (Auflegung 03. Sep. 2020)	(17,21 %)	(7,42 %)
M Retail, ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2010)	(17,84 %)	2,05 %
M Retail, ausschüttend II (Auflegung: 23. Dez. 2013)	(17,78 %)	1,15 %
Class Z, ausschüttend (Auflegung: 18. Nov. 2008)	(16,39 %)	6,76 %
JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global	(16,45 %)	6,56 % ²
Auf AUD lautende Klassen		
M Retail AUD (Hedged) ausschüttend (Auflegung 19. Dez. 2012)	(18,86 %)	0,62 %
JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global (AUD Hedged)	(18,03 %)	1,54 %
Auf CHF lautende Klassen		
Institutional CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 16. Dez. 2005)	(19,33 %)	2,54 %
JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global (CHF Hedged)	(19,03 %)	2,75 %
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 17. Dez. 2002)	(19,05 %)	5,27 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 20. Dez. 2010)	(19,06 %)	1,69 %
Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 20. Dez. 2019)	(19,29 %)	(6,49 %)
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)	(19,78 %)	2,23 %
JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global (EUR Hedged)	(18,80 %)	5,18 % ²
Auf EUR lautende Klassen (nicht abgesichert)		
Institutional EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 09. Feb. 2018)	(11,63 %)	2,44 %
JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global (EUR Unhedged)	(10,98 %)	2,37 %
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 05. Feb. 2004)	(17,97 %)	4,92 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Dez. 2005)	(18,01 %)	3,89 %
JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global (GBP Hedged)	(17,79 %)	5,16 % ²
Auf SGD lautende Klassen		
Institutional SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 02. Jul. 2018)	(17,32 %)	(0,27 %)
Class E SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 15. Feb. 2007)	(18,03 %)	2,60 %
JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global (SGD Hedged)	(17,01 %)	3,90 % ²

Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

Kommentare zum Fonds

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

- » Ein untergewichtetes Engagement in russischen Schuldtiteln trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Spreads erweiterten.
- » Ein untergewichtetes Engagement in US-amerikanischen Zinsen trug zur Wertentwicklung bei, da die US-Renditen stiegen.
- » Ein übergewichtetes Engagement bei ukrainischen Schuldtiteln schmälerte die Wertentwicklung, da sich die ukrainischen Spreads erweiterten.
- » Ein untergewichtetes Engagement in Schwellenländer-Spreads belastete die Wertentwicklung, da sich die Spreads im vierten Quartal verengten.
- » Ein übergewichtetes Engagement bei ghanaischen Staatsanleihen schmälerte die Wertentwicklung, da sich die ghanaischen Spreads erweiterten.

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

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

Durchschnittliche jährliche Gesamtrendite für den am 31. Dezember 2022 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 16. Apr. 2010)	(19,57 %)	2,76 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 10. Jul. 2019)	(19,56 %)	(3,99 %)
Administrative, thesaurierend (Auflegung: 10. Juli 2019)	(20,06 %)	(4,47 %)
Administrative, ausschüttend (Auflegung: 10. Juli 2019)	(20,06 %)	(4,48 %)
Class E, thesaurierend (Auflegung: 5. Feb. 2021)	(20,35 %)	(12,78 %)
Class E, ausschüttend (Auflegung: 5. Feb. 2021)	(20,28 %)	(12,78 %)
JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified ³	(18,92 %)	3,28 % ²
Auf CHF lautende Klassen		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 9. Apr. 2021)	(21,78 %)	(13,19 %)
JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified (CHF Hedged) ³	(21,46 %)	(12,61 %)
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 16. Okt. 2013)	(21,61 %)	(0,31 %)
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Okt. 2017)	(21,62 %)	(3,64 %)
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Aug. 2018)	(22,27 %)	(3,73 %)
JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified (EUR Hedged) ³	(21,25 %)	0,27 % ²
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 12. Dez. 2019)	(20,55 %)	(6,22 %)
JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified (GBP Hedged) ³	(20,28 %)	(6,38 %)
Auf GBP lautende Klassen (nicht abgesichert)		
Institutional GBP (Unhedged), ausschüttend (Auflegung 11. Dez. 2020)	(9,45 %)	(6,71 %)
JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified (GBP Unhedged) ³	(8,71 %)	(6,15 %)
Auf NOK lautende Klassen		
Investor NOK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 17. Mrz. 2014)	(20,97 %)	0,45 %
JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified (NOK Hedged) ³	(20,61 %)	1,06 %
Auf SEK lautende Klassen		
Investor SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 06. Feb. 2014)	(21,47 %)	(0,57 %)
Administrative SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 08. Okt. 2021)	(21,61 %)	(18,60 %)
JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified (SEK Hedged) ³	(21,18 %)	0,27 % ²

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

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

³ Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Emerging Markets Bond ESG Fund repräsentiert Folgendes: Von der Auflegung bis zum 1. August 2019: JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global, bereinigt um den Socially Responsible Investment (SRI) Filter; seit dem 2. August 2019: JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified.

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Emerging Markets Bond ESG Fund möchte bei gleichzeitigem Kapitalerhalt und umsichtiger Anlageverwaltung und nachhaltigen Investitionen (durch explizite Integration von Umwelt-, Sozial- und Governance-Faktoren in den Anlageprozess, wie im Nachtrag genauer dargelegt) den maximal möglichen Gesamtertrag erzielen, indem er mindestens 80 % seines Vermögens in ein aktiv verwaltetes, diversifiziertes Portfolio aus Rentenwerten (wie im Verkaufsprospekt definiert) anlegt, die wirtschaftlich mit Schwellenmarktländern verbunden sind. Die Beteiligung an solchen Emittenten lässt sich über die direkte Anlage in Rentenpapiere (wie im Verkaufsprospekt definiert) oder über den Einsatz von derivativen Finanzinstrumenten (wie im Fondsnachtrag näher definiert) erreichen. Alle Wertpapiere werden gemäß dem internen verantwortungsbezogenen Auswahlverfahren der Anlageberatungsgesellschaft ausgewählt, das darauf ausgelegt ist, ESG-Faktoren (Umwelt, Soziales und Governance) zu berücksichtigen, und das unter anderem ein ethisches Auswahlverfahren umfasst, das die sozial verantwortliche Anlageberatungsgesellschaft (wie im Verkaufsprospekt definiert) von Zeit zu Zeit vorgibt.

Kommentare zum Fonds

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

- » Ein untergewichtetes Engagement in russischen Schuldtiteln trug zur Wertentwicklung bei, da sich die russischen Spreads erweiterten.
- » Ein untergewichtetes Engagement in US-amerikanischen Zinsen trug zur Wertentwicklung bei, da die US-Renditen stiegen.
- » Ein übergewichtetes Engagement bei ukrainischen Schuldtiteln schmälerte die Wertentwicklung, da sich die ukrainischen Spreads erweiterten.
- » Die Titelauswahl bei chinesischen Unternehmen war der Wertentwicklung abträglich, da ausgewählte Immobilienwerte unter Kursrückgängen litten.
- » Der Verzicht auf ein Engagement in Saudi-Arabien belastete die Wertentwicklung, da sich die saudi-arabischen Spreads verengten.

Emerging Markets Corporate Bond Fund

Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2022 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 12. Nov. 2009)	(13,42 %)	3,38 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 27. Feb. 2012)	(14,22 %)	1,46 %
JPMorgan Corporate Emerging Markets Bond Index Diversified (CEMBI)	(12,92 %)	4,62 % ²
Auf CHF lautende Klassen		
Class E CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 25. Mai 2012)	(16,29 %)	(0,33 %)
JPMorgan Corporate Emerging Markets Bond Diversified Index (CHF Hedged)	(15,37 %)	1,73 %
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 19. Feb. 2010)	(15,30 %)	2,03 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 02. Mrz. 2010)	(16,10 %)	1,00 %
JPMorgan Corporate Emerging Markets Bond Diversified Index (EUR Hedged)	(15,07 %)	3,20 % ²

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

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

Kommentare zum Fonds

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

- » Ein untergewichtetes Engagement in US-amerikanischen Zinsen trug zur Wertentwicklung bei, da die US-Renditen stiegen.
- » Ein übergewichtetes Engagement bei brasilianischen Unternehmensanleihen trug zur Wertentwicklung bei, da brasilianischen Unternehmensanleihen die Wertentwicklung des Index übertrafen.
- » Die Titelauswahl bei chinesischen Unternehmen war der Wertentwicklung abträglich, da ausgewählte chinesische Immobilienwerte unter Kursrückgängen litten.
- » Ein übergewichtetes Engagement bei russischen Unternehmensanleihen schmälerte die Wertentwicklung, da russischen Unternehmensanleihen hinter der Wertentwicklung des Index zurückblieben.
- » Die Titelauswahl bei ukrainischen Unternehmensanleihen belastete die Wertentwicklung, da ausgewählte ukrainische Papiere unter Kursrückgängen litten.

PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund

Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2022 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 04. Jun. 2019)	(7,66 %)	0,67 %
Class Z, thesaurierend (Auflegung: 8. Juni 2022)	—	0,20 %
50 % JPMorgan EMBI Global Index / 50 % JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (USD) Unhedged	(14,07 %)	(2,44 %)²
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Partially Hedged), thesaurierend (Auflegung: 04. Jun. 2019)	(9,24 %)	(0,76 %)
Class E EUR (Partially Hedged), thesaurierend (Auflegung: 19. Apr. 2022)	—	(6,50 %)
50 % JPMorgan EMBI Global Index (EUR Hedged) / 50 % JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (EUR Unhedged)	(12,47 %)	(2,70 %)²
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Partially Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. März 2022)	—	(4,37 %)
50 % JPMorgan EMBI Global Index (GBP Hedged) / 50 % JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (GBP Unhedged)	—	(3,09 %)

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

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

Kommentare zum Fonds

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

- » Ein untergewichtetes Engagement in US-amerikanischer Duration trug zur Wertentwicklung bei, da die US-Renditen stiegen.
- » Die Positionierung in russischer lokaler Duration trug zur Wertentwicklung bei, da die russischen lokalen Renditen stiegen, als der Fonds untergewichtetes Engagement hatte, und fielen, als der Fonds leicht übergewichtet war.
- » Ein untergewichtetes Engagement in der lokalen Duration in Polen trug zur Wertentwicklung bei, da die Renditen in Polen stiegen.
- » Das untergewichtete Engagement im mexikanischen Peso war der Wertentwicklung abträglich, da die Währung an Wert gewann.
- » Eine übergewichtete Spread-Position bei chinesischen Schuldtiteln schmälerte die Wertentwicklung, da sich die Spreads erweiterten.

Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2022 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Class E, thesaurierend (Auflegung: 19. Nov. 2008)	(5,05 %)	1,03 %
JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (Unhedged)	(7,14 %)	0,96 %
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 20. Jan. 2010)	2,03 %	2,68 %
Class E EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 02. Jul. 2009)	1,21 %	2,17 %
JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (EUR Unhedged)	(1,05 %)	2,80 % ²

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

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

Kommentare zum Fonds

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

- » Der Verzicht auf ein Engagement in lokaler russischer Duration trug zur Wertentwicklung bei, da die lokalen Renditen in Russland stiegen.
- » Ein untergewichtetes Engagement in der lokalen Duration in Polen trug zur Wertentwicklung bei, da die lokalen Renditen in Polen stiegen.
- » Das untergewichtete Engagement im ägyptischen Pfund war der Wertentwicklung zuträglich, da die ägyptische Währung abwertete.
- » Das übergewichtete Engagement im chilenischen Peso war der Wertentwicklung abträglich, da die Währung abwertete.
- » Das übergewichtete Engagement im kolumbianischen Peso belastete die Wertentwicklung, da die Währung an Wert verlor.

Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2022 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 29. Apr. 2021)	(6,73 %)	(3,51 %)
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 29. Apr. 2021)	(6,77 %)	(3,53 %)
Class E, thesaurierend (Auflegung: 29. Apr. 2021)	(7,57 %)	(4,37 %)
Class E, ausschüttend (Auflegung: 29. Apr. 2021)	(7,51 %)	(4,38 %)
Bloomberg U.S. Aggregate Index	(13,01 %)	(7,35 %)
Auf AUD lautende Klassen		
Institutional AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 19. Nov. 2021)	(7,67 %)	(6,68 %)
Class R AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Jan. 2021)	(7,90 %)	(4,37 %)
Bloomberg U.S. Aggregate (AUD Hedged) Index	(14,24 %)	(8,20 %) ²
Auf CHF lautende Klassen		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 29. Apr. 2021)	(9,17 %)	(5,42 %)
Class E CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Apr. 2021)	(9,93 %)	(6,22 %)
Bloomberg U.S. Aggregate (CHF Hedged) Index	(15,62 %)	(9,42 %)
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 29. Apr. 2021)	(8,67 %)	(5,04 %)
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 21. Mai 2021)	(8,67 %)	(5,29 %)
Class E EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 25. Juni 2021)	(9,56 %)	(6,77 %)
Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Apr. 2021)	(9,48 %)	(5,89 %)
Bloomberg U.S. Aggregate (EUR Hedged) Index	(15,19 %)	(9,06 %) ²
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Apr. 2021)	(7,41 %)	(4,15 %)
Bloomberg U.S. Aggregate (GBP Hedged) Index	(14,06 %)	(8,09 %)
Auf SEK lautende Klassen		
Institutional SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung 29. Okt. 2021)	(8,24 %)	(7,08 %)
Administrative SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 12. Mai 2022)	—	(2,77 %)
Bloomberg U.S. Aggregate (SEK Hedged) Index	(14,88 %)	(12,94 %) ²
Auf SGD lautende Klassen		
Institutional SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Apr. 2021)	(6,87 %)	(3,59 %)
Bloomberg U.S. Aggregate (SGD Hedged) Index	(13,32 %)	(7,50 %)

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der PIMCO ESG Income Fund strebt gleichzeitig mit einer umsichtigen Anlageverwaltung und nachhaltige Investitionen (durch explizite Integration von Umwelt-, Sozial- und Governance-Faktoren („ESG“) in den Anlageprozess, wie im Nachtrag näher erläutert) hohe laufende Erträge an. Der langfristige Kapitalzuwachs gilt als sekundäres Anlageziel.

Kommentare zum Fonds

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

- » Ein Short-Engagement in britischer Duration trug zur Wertentwicklung bei, da die Zinsen im Vereinigten Königreich stiegen.
- » Eine Short-Position in japanischer Duration trug zur Wertentwicklung bei, da die japanischen Renditen stiegen.
- » Ein Long-Engagement in US-amerikanischer Duration schmälerte die Wertentwicklung, da die US-Zinsen stiegen.
- » Ein Long-Engagement bei Investment Grade- und hochverzinslichen Unternehmensanleihen war der Wertentwicklung abträglich, da sich die Spreads erweiterten.
- » Positionen in verbrieften Krediten, darunter Agency- und Non-Agency-MBS-Anleihen und Commercial Mortgage-Backed Securities, belasteten die Wertentwicklung.

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

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

Durchschnittliche jährliche Gesamterrendite für den am 31. Dezember 2022 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 31. Dez. 1998)	(17,41 %)	3,26 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 07. Jan. 2003)	(17,38 %)	2,89 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 08. Mai 2002)	(17,70 %)	2,83 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)	(18,18 %)	1,50 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 10. Okt. 2005)	(18,16 %)	1,29 %
FTSE Euro Broad Investment-Grade Index	(17,17 %)	3,06 % ²
Auf CHF lautende Klassen		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2006)	(17,91 %)	1,66 %
FTSE Euro Broad Investment-Grade (CHF Hedged) Index	(17,60 %)	1,70 %

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

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

Kommentare zum Fonds

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

- » Das untergewichtete Engagement in der Duration des Euro-Blocks trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die Zinsen des Euro-Blocks stiegen.
- » Ein Short-Engagement in US-amerikanischer Duration trug zur Wertentwicklung bei, da die US-amerikanischen Zinsen stiegen.
- » Long-Positionen in französischen und italienischen Breakevens stärkten die relative Wertentwicklung, da die Inflationserwartungen stiegen.
- » Das Long-Engagement in verbrieften Krediten, hauptsächlich über Non-Agency Residential Mortgage Backed Securities („RMBS“) und hochwertige europäische Collateralized Loan Obligations („CLOs“), war der relativen Wertentwicklung abträglich, da sich die Spreads ausweiteten.
- » Short-Positionen in britischen Breakevens waren der relativen Wertentwicklung abträglich, da die Inflationserwartungen stiegen.
- » Ein übergewichtetes Engagement in Unternehmensanleihen aus dem Finanzsektor, sowohl über vorrangige Schuldtitel als über Bankkapitalpapiere, belastete die relative Wertentwicklung, da sich die Spreads weiteten.

Durchschnittliche jährliche Gesamterrendite für den am 31. Dezember 2022 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 31. Jan. 2008)	(16,69 %)	2,39 %
Institutional, ausschüttend II (Auflegung: 01. Okt. 2013)	(16,69 %)	0,73 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 25. Mai 2010)	(17,43 %)	0,89 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 07. Jun. 2019)	(16,62 %)	(4,20 %)
H Institutional, ausschüttend II (Auflegung: 07. Jun. 2019)	(16,60 %)	(4,21 %)
Bloomberg Euro-Aggregate Credit Index	(15,56 %)	2,29 % ²

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

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

Kommentare zum Fonds

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

- » Makrostrategien und insbesondere eine Untergewichtung von europäischer Duration trugen zur Wertentwicklung bei, da die Zinsen stiegen.
- » Eine Untergewichtung des staatsnahen Sektors, der in diesem Jahr eine unterdurchschnittliche Entwicklung aufwies, trug zur Wertentwicklung bei.
- » Die Übergewichtung und die Titelauswahl bei Immobilieninvestmentgesellschaften (REITs) beeinträchtigten die Wertentwicklung, da der Sektor aufgrund von Bedenken über die Auswirkungen steigender Zinsen schlechter abschnitt als der breitere Markt.
- » Die Titelauswahl im Bankensektor war der Wertentwicklung abträglich, da ein ausgewählter übergewichtiger Emittent nach der Ankündigung eines Restrukturierungsplans eine unterdurchschnittliche Entwicklung aufwies.
- » Die Titelauswahl bei Auslandsschuldtiteln von Schwellenländern belastete die Wertentwicklung, da sich die Position in russischen Schuldtiteln vor dem Hintergrund der Ankündigung von Sanktionen unterdurchschnittlich entwickelte.

Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2022 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 28. Feb. 2011)	(12,03 %)	2,81 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 28. Feb. 2011)	(11,94 %)	2,83 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 13. Dez. 2019)	(12,38 %)	(3,68 %)
Investor, ausschüttend (Auflegung: 29. Mai 2012)	(12,26 %)	2,39 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 28. Feb. 2011)	(12,78 %)	1,90 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 28. Feb. 2011)	(12,77 %)	1,89 %
Class T, thesaurierend (Auflegung: 30. Sep. 2014)	(13,19 %)	(0,48 %)
Class T, ausschüttend (Auflegung: 30. Sep. 2014)	(13,13 %)	(0,48 %)
Bloomberg Euro Aggregate 1-10 Year Bond Index	(12,06 %)	1,46 % ²

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

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

Kommentare zum Fonds

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

- » Eine Short-Position in japanischer Duration trug zur Wertentwicklung bei, da die Renditen stiegen.
- » Ein moderates Short-Engagement in britischer Duration trug zur Wertentwicklung bei, da die Zinsen stiegen.
- » Das Long-Engagement gegenüber dem mexikanischen Peso trug zur Wertentwicklung bei, da er gegenüber dem US-Dollar an Wert gewann.
- » Positionen in Auslandsschulden von Schwellenländern belastete die Wertentwicklung, da sich die Spreads erweiterten.
- » Ein Long-Engagement in europäischen Zinsen minderte die Wertentwicklung, da die Zinsen stiegen.
- » Ein Long-Engagement bei hochverzinslichen Unternehmensanleihen belastete die Wertentwicklung, da sich die Spreads erweiterten.

Euro Long Average Duration Fund

Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2022 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 21. Apr. 2006)	(35,71 %)	3,93 %
Bloomberg Euro Government (Germany, France, Netherlands) over 15 years Index ²	(36,21 %)	2,87 %

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

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

Kommentare zum Fonds

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

- » Eine Untergewichtung in der Duration der Euro-Kernländer trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die Renditen in der Eurozone stiegen.
- » Ein untergewichtetes Engagement in nomineller US-amerikanischer Duration trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die nominellen Renditen stiegen.
- » Ein übergewichtetes Engagement in verbrieften Vermögenswerten, insbesondere in europäischen mit Wohnungsbauhypotheken besicherten Wertpapieren (Residential Mortgage-Backed Securities), war der relativen Wertentwicklung abträglich, da sich die Spreads ausweiteten.
- » Eine übergewichtete Engagement bei US-Breakevens war der relativen Wertentwicklung abträglich, da die Inflationserwartungen sanken.

Durchschnittliche jährliche Gesamtertritte für den am 31. Dezember 2022 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 31. Jan. 2006)	(1,17 %)	0,99 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)	(1,98 %)	0,23 %
Euro Short-Term Rate (ESTER) Index ³	(0,02 %)	0,70 % ²

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

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

³ Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Euro Short-Term Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 30. Juni 2021: 1-Monats-Euribor Index; ab 1. Juli 2021: Euro Short-Term Rate (ESTER) Index.

Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

Kommentare zum Fonds

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

- » Ein Short-Engagement in der Duration der Eurozone im ersten Halbjahr war der Wertentwicklung förderlich, da die Zinsen stiegen.
- » Das Engagement im positiven europäischen Barzinssatz trug zur Wertentwicklung bei.
- » Ein Long-Engagement in britischer Duration schmälerte die Wertentwicklung, da die Zinsen stiegen.
- » Ein Long-Engagement in Investment Grade-Unternehmensanleihen belastete die Wertentwicklung, da sich die Spreads erweiterten.
- » Ein Long-Engagement in Auslandsschulden von Schwellenländern belastete die Wertentwicklung, da sich die Spreads erweiterten.

Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2022 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 31. Jan. 2020)	(9,82 %)	(0,93 %)
Class E, thesaurierend (Auflegung: 22. Dez. 2022)	—	0,00 %
Class Z, thesaurierend (Auflegung: 31. Jan. 2020)	(9,36 %)	(0,41 %)
ICE BofA Merrill Lynch BB-B European Currency High Yield Constrained Index	(11,36 %)	(2,43 %) ²

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

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

Kommentare zum Fonds

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

- » Die Titelauswahl im Energiesektor trug zur Wertentwicklung bei, da sich im Portfolio fehlende Emittenten unterdurchschnittlich entwickelten.
- » Die Übergewichtung und Titelauswahl im Gesundheitssektor waren positiv für die Wertentwicklung, da der Sektor und ein ausgewählter übergewichteter Emittent überdurchschnittlich gut abschnitten.
- » Die Titelauswahl im bei nicht zyklischen Konsumgütern trug zur Wertentwicklung bei, da ein ausgewählter Emittent sehr gut abschnitt.
- » Die Titelauswahl in den Sektoren Forstprodukte, Papier und Verpackungen belastete die Wertentwicklung, da ausgewählte übergewichtige Emittenten zurückblieben.
- » Die Titelauswahl im Transportsektor war der Wertentwicklung abträglich, da sich ein ausgewählter übergewichteter Emittent unterdurchschnittlich entwickelte.

Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2022 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 05. Jul. 2011)	(3,08 %)	0,83 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 25. Mrz. 2013)	(3,58 %)	(0,61 %)
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 08. Jan. 2020)	(3,24 %)	(1,53 %)
Euro Short-Term Rate (ESTER) Index ³	(0,01 %)	0,98 % ²

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

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

³ Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den PIMCO European Short-Term Opportunities Fund repräsentiert Folgendes: Von der Auflegung bis zum 29. September 2012: PIMCO European Advantage Government 1-3 Year Bond Index; vom 30. September 2012 bis zum 16. Januar 2020: Bloomberg Euro Aggregate ex Treasury 1-3 Year Index; seit dem 17. Januar 2020: Euro Short-Term Rate (ESTER). Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem 30. Juni 2011 berechnet.

Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

Kommentare zum Fonds

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

- » Ein Short-Engagement in US-amerikanischer Duration trug zur Wertentwicklung bei, da die Zinsen stiegen.
- » Eine Long-Positionen in dänischen gedeckten Anleihen trug wegen der Auswahl zur Wertentwicklung bei.
- » Short-Engagements in europäischen Peripherieländern im zweiten Halbjahr, insbesondere in Italien, trugen zur Wertentwicklung bei, da sich die BTP-Bund-Spreads ausweiteten.
- » Ein Long-Engagement in Investment Grade-Unternehmensanleihen belastete die Wertentwicklung, da sich die Spreads erweiterten.
- » Ein Long-Engagement bei hochverzinslichen Unternehmensanleihen belastete die Wertentwicklung, da sich die Spreads erweiterten.

Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2022 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 09. Jun. 2009)	(13,32 %)	2,11 %
PIMCO Global Advantage Bond Index (GLADI) (London Close)	(14,10 %)	1,60 %
Auf CHF lautende Klassen		
Institutional CHF (Partially Hedged), ausschüttend (Auflegung: 02. Aug. 2011)	(11,40 %)	1,12 %
PIMCO Global Advantage Bond Index (GLADI) (CHF, Partially Hedged) (London Close)	(12,26 %)	0,60 %
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Partially Hedged), thesaurierend (Auflegung: 24. Mai 2010)	(9,82 %)	2,02 %
Class E EUR (Partially Hedged), thesaurierend (Auflegung: 06. Mai 2010)	(10,76 %)	1,01 %
PIMCO Global Advantage Bond Index (GLADI) (EUR, Partially Hedged) (London Close)	(10,79 %)	1,57 % ²
Auf NOK lautende Klassen		
Institutional NOK (Partially Hedged), thesaurierend (Auflegung: 05. Mrz. 2012)	(7,83 %)	3,22 %
PIMCO Global Advantage Bond Index (GLADI) (NOK, Partially Hedged) (London Close)	(8,72 %)	2,75 %

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

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

Kommentare zum Fonds

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

- » Eine Untergewichtung in US-amerikanischer Duration trug zur Wertentwicklung bei, da die Zinsen stiegen.
- » Eine Untergewichtung in britischer Duration war der Wertentwicklung zuträglich, da die Zinsen stiegen.
- » Der Verzicht auf lokale Duration in Russland trug im ersten Quartal aufgrund der steigenden Zinsen positiv zur Wertentwicklung bei.
- » Die Positionierung innerhalb der Zinssätze des Euro-Blocks war der Wertentwicklung abträglich, da die Zinssätze entlang der gesamten Kurve stiegen und die europäischen Swap-Spreads sich ausweiteten.
- » Das Long-Engagement in verbrieften Krediten, hauptsächlich über US-amerikanische Non-Agency-MBS und Collateralized Loan Obligations, war der Wertentwicklung abträglich, da sich die Spreads ausweiteten.
- » Ein übergewichtetes Engagement bei Finanzwerten schmälerte die Wertentwicklung, da sich die Spreads erweiterten.

Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2022 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 12. Mrz. 1998)	(11,39 %)	4,76 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 18. Apr. 2001)	(11,34 %)	4,40 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 01. Mrz. 1999)	(11,69 %)	4,23 %
Investor, ausschüttend (Auflegung: 23. Jan. 2001)	(11,71 %)	4,05 %
Administrative, thesaurierend (Auflegung: 14. Jun. 2004)	(11,82 %)	3,69 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)	(12,18 %)	3,15 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 28. Okt. 2005)	(12,21 %)	3,12 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 15. Okt. 2002)	(11,55 %)	4,06 %
H Institutional, ausschüttend (Auflegung: 14. Feb. 2020)	(11,48 %)	(2,88 %)
M Retail, ausschüttend II (Auflegung: 26. Apr. 2017)	(12,18 %)	0,13 %
Class T, thesaurierend (Auflegung: 16. Okt. 2014)	(12,44 %)	0,75 %
Class T, ausschüttend (Auflegung: 16. Okt. 2014)	(12,44 %)	0,75 %
Class W, thesaurierend (Auflegung 12. Aug. 2020)	(11,28 %)	(4,45 %)
Class W, ausschüttend (Auflegung 12. Aug. 2020)	(11,27 %)	(4,47 %)
Bloomberg Global Aggregate (USD Hedged) Index ³	(11,22 %)	4,02 % ²
Auf USD lautende Klassen (Währungsrisiko)		
Institutional (Currency Exposure), thesaurierend (Auflegung 13. Dez. 2002)	(16,09 %)	3,66 %
Institutional (Currency Exposure), ausschüttend (Auflegung 23. Mär. 2006)	(16,10 %)	3,20 %
Class E (Currency Exposure), thesaurierend (Auflegung 19. Mai 2010)	(16,87 %)	1,17 %
Class E (Currency Exposure), ausschüttend (Auflegung 19. Mai 2010)	(16,84 %)	1,17 %
Institutional (Currency Exposure), thesaurierend (Auflegung 26. Feb. 2021)	(16,21 %)	(10,38 %)
Bloomberg Global Aggregate (USD Unhedged) Index ³	(16,25 %)	2,82 % ²
Auf CAD lautende Klassen		
Institutional CAD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 21. Sep. 2018)	(11,55 %)	0,26 %
Bloomberg Global Aggregate (CAD Hedged) Index ³	(11,53 %)	0,06 %
Auf CHF lautende Klassen		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 08. Mai 2003)	(13,64 %)	2,26 %
Institutional CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 10. Apr. 2003)	(13,61 %)	2,30 %
Investor CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Jun. 2011)	(13,89 %)	1,24 %
Class E CHF (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 13. Juni 2018)	(14,41 %)	(2,50 %)
Class W CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung 12. Aug. 2020)	(13,57 %)	(6,12 %)
Class W CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung 12. Aug. 2020)	(13,57 %)	(6,11 %)
Bloomberg Global Aggregate (CHF Hedged) Index ³	(13,71 %)	1,45 % ²
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 04. Apr. 2003)	(13,25 %)	3,21 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 12. Apr. 2005)	(13,24 %)	3,04 %
Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 02. Feb. 2005)	(13,52 %)	2,69 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)	(13,98 %)	2,23 %
Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Jan. 2016)	(13,98 %)	(1,11 %)
G Retail EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 12. Dez. 2012)	(14,04 %)	(0,10 %)
Class R EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	(13,45 %)	0,53 %
Class T EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Sep. 2014)	(14,22 %)	(0,89 %)
Class W EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung 12. Aug. 2020)	(13,13 %)	(5,81 %)
Class W EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung 12. Aug. 2020)	(13,08 %)	(5,77 %)
Bloomberg Global Aggregate (EUR Hedged) Index ³	(13,27 %)	2,34 % ²
Auf EUR lautende Klassen (Währungsrisiko)		
Institutional EUR (Currency Exposure), thesaurierend (Auflegung: 20. Feb. 2013)	(10,64 %)	2,58 %
Bloomberg Global Aggregate (EUR Unhedged) Index ³	(10,76 %)	2,06 %

Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

Kommentare zum Fonds

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

- » Eine Untergewichtung in US-amerikanischer Duration trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die US-amerikanischen Zinsen stiegen.
- » Eine Untergewichtung in britischer Duration steigerte die relative Wertentwicklung, da die Zinsen im Vereinigten Königreich stiegen.
- » Ein übergewichtetes Engagement in japanischer Duration trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die japanischen Zinsen stiegen.
- » Die Positionierung innerhalb der Zinssätze des Euro-Blocks war der relativen Wertentwicklung abträglich, da die Zinssätze entlang der gesamten Kurve stiegen und die europäischen Swap-Spreads sich ausweiteten.
- » Ein übergewichtetes Engagement bei Unternehmensanleihen mit Investment Grade aus dem Finanzsektor belastete die relative Wertentwicklung, da sich die Spreads erweiterten.
- » Das Long-Engagement in verbrieften Krediten, hauptsächlich über US-amerikanischen Non-Agency Residential Mortgage Backed Securities (RMBS) und britischen Collateralized Loan Obligations, war der Wertentwicklung abträglich, da sich die Spreads ausweiteten.

Durchschnittliche jährliche Gesamterrendite für den am 31. Dezember 2022 abgelaufenen Berichtszeitraum¹
(Forts.)

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 16. Apr. 2003)	(12,05 %)	4,18 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 01. Jun. 2004)	(12,01 %)	4,18 %
Investor GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 14. Apr. 2005)	(12,36 %)	3,53 %
Class W GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung 12. Aug. 2020)	(12,00 %)	(4,90 %)
Class W GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung 12. Aug. 2020)	(12,00 %)	(4,92 %)
Bloomberg Global Aggregate (GBP Hedged) Index ³	(12,15 %)	3,37 % ²
Auf GBP lautende Klassen (Währungsrisiko)		
Institutional GBP (Currency Exposure), thesaurierend (Auflegung: 09. Mrz. 2018)	(5,58 %)	1,36 %
Bloomberg Global Aggregate (GBP Unhedged) Index ³	(5,70 %)	1,11 %
Auf HKD lautende Klassen		
M Retail HKD (Unhedged), ausschüttend II (Auflegung: 26. Apr. 2017)	(12,07 %)	0,17 %
Bloomberg Global Aggregate (HKD Unhedged) Index ³	(11,12 %)	0,73 %
Auf NOK lautende Klassen		
Institutional NOK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2005)	(12,16 %)	4,19 %
Investor NOK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 26. Jul. 2006)	(12,47 %)	4,16 %
Class W NOK (Hedged), thesaurierend (Auflegung 13. Apr. 2021)	(12,06 %)	(6,99 %)
Bloomberg Global Aggregate (NOK Hedged) Index ³	(12,16 %)	3,31 % ²
Auf NZD lautende Klassen		
Institutional NZD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 01. Nov. 2004)	(11,68 %)	6,10 %
Bloomberg Global Aggregate (NZD Hedged) Index ³	(11,75 %)	5,19 %
Auf SEK lautende Klassen		
Institutional SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 08. Nov. 2004)	(12,81 %)	3,36 %
Administrative SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 2. Juli 2021)	(13,25 %)	(9,56 %)
Bloomberg Global Aggregate (SEK Hedged) Index ³	(12,96 %)	2,42 % ²
Auf SGD lautende Klassen		
Institutional SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 07. Aug. 2009)	(11,51 %)	4,10 %
Bloomberg Global Aggregate (SGD Hedged) Index ³	(11,45 %)	2,61 %

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

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

³ Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Global Bond Fund repräsentiert Folgendes: Von der Auflegung bis zum 30. November 2000: JPMorgan GBI Global Index Hedged in USD; seit dem 1. Dezember 2000: Bloomberg Global Aggregate (USD Hedged) Index.

Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2022 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 12. Jan. 2017)	(11,75 %)	0,97 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung 03. Apr. 2020)	(11,68 %)	(2,27 %)
Investor, thesaurierend (Auflegung: 07. Nov. 2018)	(12,10 %)	0,24 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 08. Mrz. 2019)	(12,50 %)	(1,03 %)
Bloomberg Global Aggregate (USD Hedged) Index	(11,22 %)	0,78 % ²
Auf AUD lautende Klassen		
Class Z AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 12. Jan. 2017)	(12,14 %)	1,10 %
Bloomberg Global Aggregate Index (AUD Hedged)	(12,28 %)	0,39 %
Auf CHF lautende Klassen		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 12. Jan. 2017)	(13,96 %)	(1,42 %)
Class E CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 1. Sept. 2022)	—	(3,40 %)
Bloomberg Global Aggregate (CHF Hedged) Index	(13,71 %)	(1,65 %) ²
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 12. Jan. 2017)	(13,52 %)	(1,03 %)
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 12. Jan. 2017)	(13,57 %)	(1,04 %)
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung 09. Feb. 2017)	(14,40 %)	(1,92 %)
Bloomberg Global Aggregate (EUR Hedged) Index	(13,27 %)	(1,24 %) ²
Auf EUR lautende Klassen (Währungsrisiko)		
Institutional EUR (Currency Exposure), thesaurierend (Auflegung: 29. Nov. 2021)	(11,14 %)	(10,62 %)
Bloomberg Global Aggregate (EUR Unhedged) Index	(10,76 %)	(10,64 %)
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung 03. Jun. 2020)	(12,42 %)	(3,88 %)
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 12. Jan. 2017)	(12,44 %)	(0,07 %)
Bloomberg Global Aggregate (GBP Hedged) Index	(12,15 %)	(0,25 %) ²
Auf GBP lautende Klassen (Währungsrisiko)		
Institutional GBP (Currency Exposure), ausschüttend (Auflegung: 4. Aug. 2022)	—	(3,99 %)
Bloomberg Global Aggregate (GBP Unhedged) Index	—	(4,24 %)
Auf GBP lautende Klassen (nicht abgesichert)		
Institutional GBP (Unhedged), ausschüttend (Auflegung 11. Dez. 2020)	(0,56 %)	(1,97 %)
Bloomberg Global Aggregate (GBP Unhedged) Index	(0,03 %)	(1,23 %)
Auf NOK lautende Klassen		
Institutional NOK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 12. Jan. 2017)	(12,47 %)	0,18 %
Bloomberg Global Aggregate (NOK Hedged) Index	(12,16 %)	0,05 %
Auf NZD lautende Klassen		
Institutional NZD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 05. Apr. 2017)	(12,05 %)	0,69 %
Bloomberg Global Aggregate (NZD Hedged) Index	(11,75 %)	0,61 %
Auf SEK lautende Klassen		
Institutional SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung 20. Mai 2021)	(13,16 %)	(8,27 %)
Bloomberg Global Aggregate (SEK Hedged) Index	(12,96 %)	(7,82 %)

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

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Global Bond ESG Fund strebt gleichzeitig mit dem Schutz des Kapitals, einer umsichtigen Anlageverwaltung und nachhaltigen Investitionen (durch explizite Integration von Umwelt-, Sozial- und Governance in den Anlageprozess, wie im Nachtrag näher erläutert) eine Maximierung der Gesamterträge an. Der Fonds versucht, sein Anlageziel zu erreichen, indem er mindestens zwei Drittel seines Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio aus festverzinslichen Wertpapieren (wie im Verkaufsprospekt definiert) anlegt, die auf führende Weltwährungen lauten.

Kommentare zum Fonds

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

- » Eine Untergewichtung in US-amerikanischer Duration trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Zinsstrukturkurve nach oben verschob.
- » Eine Untergewichtung in britischer Duration war der Wertentwicklung zuträglich, da die Zinsen stiegen.
- » Eine Untergewichtung in japanischer Duration war der Wertentwicklung zuträglich, da die Zinsen gegen Jahresende stiegen.
- » Die Positionierung innerhalb der Zinssätze des Euro-Blocks war der Wertentwicklung abträglich, da die Zinssätze entlang der gesamten Kurve stiegen und die europäischen Swap-Spreads sich ausweiteten.
- » Ein übergewichtetes Engagement in Finanztiteln, sowohl in vorrangige Anleihen als auch über Bankkapitalpapiere, belastete die Wertentwicklung, da sich die Spreads ausweiteten.
- » Das Long-Engagement in verbrieften Krediten, hauptsächlich über US-amerikanische Non-Agency-MBS und europäischen hochwertigen Collateral Loan Obligations, war der Wertentwicklung abträglich, da sich die Spreads ausweiteten.

Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2022 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2003)	(9,98 %)	4,16 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 09. Nov. 2005)	(10,00 %)	4,19 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 28. Feb. 2006)	(10,30 %)	3,77 %
Administrative, thesaurierend (Auflegung: 14. Sep. 2004)	(10,44 %)	3,78 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 30. Apr. 2008)	(10,81 %)	3,27 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 12. Dez. 2018)	(10,18 %)	0,15 %
Class Z, thesaurierend (Auflegung: 30. Okt. 2019)	(9,56 %)	(1,41 %)
Bloomberg Global Aggregate ex-USD (USD Hedged) Index ³	(9,76 %)	3,24 % ²
Auf USD lautende Klassen (Währungsrisiko)		
Class E (Currency Exposure), ausschüttend (Auflegung 04. Okt. 2016)	(19,11 %)	(2,71 %)
Bloomberg Global Aggregate ex-USD (USD Unhedged) Index ³	(18,70 %)	(2,42 %)
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 04. Apr. 2006)	(11,75 %)	3,41 %
Bloomberg Global Aggregate ex-USD (EUR Hedged) Index ³	(11,70 %)	2,28 %

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

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

³ Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Global Bond Ex-US Fund repräsentiert Folgendes: Von der Auflegung bis zum 19. Januar 2016: FTSE World Government Bond Ex-U.S. Index (USD Hedged); seit dem 20. Januar 2016: Bloomberg Global Aggregate ex-USD (USD Hedged) Index.

Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

Kommentare zum Fonds

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

- » Eine Untergewichtung in US-amerikanischer Duration trug zur Wertentwicklung bei, da die Zinsen stiegen.
- » Eine Untergewichtung in britischer Duration war der Wertentwicklung zuträglich, da die Zinsen stiegen.
- » Eine Untergewichtung in japanischer Duration war der Wertentwicklung zuträglich, da die Zinsen stiegen.
- » Die Positionierung innerhalb der Zinssätze des Euro-Blocks war der Wertentwicklung abträglich, da die Zinssätze entlang der gesamten Kurve stiegen und die europäischen Swap-Spreads sich ausweiteten.
- » Ein Long-Engagement in verbrieften Vermögenswerten, überwiegend in europäischen Collateralized Loan Obligations und US-amerikanischen Non-Agency Mortgage-Backed Securities, schmälerte die Wertentwicklung, da sich die Spreads ausweiteten.
- » Ein übergewichtetes Engagement bei Finanzwerten schmälerte die Wertentwicklung, da sich die Spreads ausweiteten.

Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2022 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 15. Apr. 2009)	(17,06 %)	5,08 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 24. Sep. 2010)	(17,34 %)	3,15 %
Class E, thesaurierend (Auflegung 22. Jun. 2009)	(18,01 %)	3,59 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 28. Jan. 2011)	(18,06 %)	2,03 %
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 29. Apr. 2022)	—	(5,70 %)
H Institutional, ausschüttend (Auflegung: 29. Apr. 2022)	—	(5,68 %)
Class Z, thesaurierend (Auflegung: 06. Jul. 2016)	(16,27 %)	6,14 %
60 % MSCI All Country World Index/40 % Bloomberg Global Aggregate (USD Hedged)	(15,32 %)	7,26 % ²
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 15. Apr. 2009)	(17,55 %)	4,22 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 22. Jun. 2009)	(18,53 %)	2,73 %
Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung 24. Jun. 2011)	(18,61 %)	1,02 %
60 % MSCI All Country World Index EUR Hedged /40 % Bloomberg Global Aggregate EUR Hedged	(15,91 %)	6,20 % ²
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 07. Apr. 2010)	(16,55 %)	3,38 %
60 % MSCI All Country World Index GBP Hedged /40 % Bloomberg Global Aggregate GBP Hedged	(14,99 %)	5,46 %

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

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

Kommentare zum Fonds

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

- » Die Durationspositionierung in den USA, insbesondere die Untergewichtung im mittleren Bereich der Renditekurve, trug zur relativen Wertentwicklung bei, da sich dieser Teil der Kurve nach oben verschob.
- » Die Relative-Value-Strategien mit börsennotierten Immobilieninvestmentgesellschaften (REITs) trugen zur relativen Wertentwicklung bei, da das Long-Engagement in bestimmten Einzeltiteln das Short-Engagement im breiten Index übertraf.
- » Die Positionierung in Schwellenländer-Duration, insbesondere die untergewichtete Position in ungarischer Duration, trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die Kurve im Laufe des Jahres stieg.
- » Die Positionierung in US-Aktien belastete die relative Wertentwicklung, da wir in der ersten Hälfte des Jahres übergewichtet und in den letzten Monaten des Jahres gegenüber der Benchmark untergewichteter waren.
- » Die Durationspositionierung in der Eurozone, insbesondere die Übergewichtung im langfristigen Bereich der Renditekurve, schmälerte die Wertentwicklung bei, da sich dieser Teil der Kurve nach oben verschob.
- » Die Positionierung in ausgewählten besicherten Krediten, insbesondere die Titelauswahl bei Residential Mortgage-Backed Securities (RMBS), schmälerte die relative Wertentwicklung während des Berichtszeitraums, da diese Wertpapiere negative Renditen verzeichneten.

Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2022 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2005)	(10,28 %)	5,59 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 30. Dez. 2005)	(10,33 %)	5,60 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 22. Jun. 2016)	(10,63 %)	3,08 %
Administrative, thesaurierend (Auflegung: 27. Jun. 2008)	(10,72 %)	5,07 %
Administrative, ausschüttend (Auflegung: 11. Dez. 2015)	(10,68 %)	3,60 %
BM Retail, ausschüttend II (Auflegung: 28. Apr. 2022)	—	(3,86 %)
Class E, thesaurierend (Auflegung: 11. Sep. 2006)	(11,08 %)	4,55 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 31. Jul. 2006)	(11,10 %)	4,62 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 29. Aug. 2008)	(10,43 %)	5,54 %
H Institutional, ausschüttend (Auflegung: 22. Mrz. 2013)	(10,35 %)	3,40 %
M Retail, ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2010)	(11,04 %)	3,88 %
M Retail, ausschüttend II (Auflegung: 23. Dez. 2013)	(11,18 %)	2,49 %
Class R, thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	(10,55 %)	3,57 %
Class T, thesaurierend (Auflegung: 16. Okt. 2014)	(11,43 %)	2,17 %
Class T, ausschüttend (Auflegung: 16. Okt. 2014)	(11,42 %)	2,16 %
ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index Hedged into USD ³	(10,04 %)	5,94 % ²
Auf CHF lautende Klassen		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 16. Feb. 2010)	(12,67 %)	3,68 %
Institutional CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 31. Aug. 2012)	(12,66 %)	2,20 %
ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index Hedged into CHF ³	(12,58 %)	4,05 % ²
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 02. Mai 2008)	(12,28 %)	4,20 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Dez. 2005)	(12,26 %)	4,48 %
Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 05. Jan. 2011)	(12,60 %)	2,93 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)	(13,06 %)	3,45 %
Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Apr. 2016)	(13,10 %)	0,46 %
ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index Hedged into EUR ³	(12,25 %)	4,63 % ²
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 25. Mai 2012)	(11,23 %)	3,71 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Dez. 2005)	(11,08 %)	5,19 %
Class E GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 15. Jun. 2009)	(11,95 %)	5,00 %
ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index Hedged into GBP ³	(11,27 %)	5,37 % ²
Auf SGD lautende Klassen		
Class E SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 25. Apr. 2016)	(11,38 %)	2,24 %
ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index Hedged into SGD ³	(10,46 %)	3,59 %

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Global High Yield Bond Fund beabsichtigt, seine Erträge mithilfe umsichtiger Anlageverwaltung zu maximieren. Der Fonds versucht, sein Anlageziel zu erreichen, indem er mindestens zwei Drittel seines Gesamtvermögens in ein diversifiziertes Portfolio aus hoch verzinslichen Rentenpapieren (wie im Verkaufsprospekt definiert) anlegt, die auf wichtige Währungen lauten, die von Moody's mit niedriger als Baa oder von S&P niedriger als BBB bewertet werden oder von Fitch ein gleichwertiges Rating erhalten haben.

Kommentare zum Fonds

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

- » Eine Untergewichtung des Immobiliensektors trug zur Wertentwicklung bei, da sich der Sektor unterdurchschnittlich entwickelte.
- » Die Titelauswahl im Einzelhandel trug zur Wertentwicklung bei, da ausgewählte Emittenten sehr gut abschnitten.
- » Die Titelauswahl im bei nicht zyklischen Konsumgütern trug zur Wertentwicklung bei, da ein ausgewählter Emittent sehr gut abschnitt.
- » Eine Übergewichtung des Gesundheitssektors schmälerte die Wertentwicklung, da sich der Sektor unterdurchschnittlich entwickelte.
- » Die Titelauswahl im Finanz- und Versicherungssektor war der Wertentwicklung abträglich, da sich ein ausgewählter übergewichtiger Emittent unterdurchschnittlich entwickelte.

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

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

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

Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2022 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 18. Apr. 2008)	(15,52 %)	4,02 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 23. Jul. 2003)	(15,51 %)	4,27 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 15. Feb. 2005)	(15,82 %)	3,64 %
Investor, ausschüttend (Auflegung: 22. Jan. 2009)	(15,77 %)	4,29 %
Administrative, thesaurierend (Auflegung: 21. Jan. 2009)	(15,97 %)	4,12 %
Administrative, ausschüttend (Auflegung: 21. Jan. 2009)	(15,89 %)	4,13 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 10. Dez. 2008)	(16,28 %)	3,91 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 30. Apr. 2008)	(16,29 %)	3,04 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 29. Aug. 2008)	(15,68 %)	3,99 %
H Institutional, ausschüttend (Auflegung: 25. Mai 2018)	(15,61 %)	(0,20 %)
M Retail, ausschüttend (Auflegung: 28. Sep. 2012)	(16,27 %)	1,18 %
M Retail, ausschüttend II (Auflegung: 23. Dez. 2013)	(16,24 %)	1,29 %
Class R, thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	(15,76 %)	1,66 %
Class R, ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	(15,76 %)	1,67 %
Class T, thesaurierend (Auflegung: 16. Okt. 2014)	(16,59 %)	0,31 %
Class W, thesaurierend (Auflegung 12. Aug. 2020)	(15,42 %)	(6,08 %)
Class W, ausschüttend (Auflegung 12. Aug. 2020)	(15,40 %)	(6,03 %)
Bloomberg Global Aggregate Credit Index (USD Hedged)	(14,22 %)	3,59 % ²
Auf USD lautende Klassen (Währungsrisiko)		
Institutional (Currency Exposure), thesaurierend (Auflegung 02. Aug. 2013)	(18,07 %)	0,93 %
Institutional (Currency Exposure), ausschüttend (Auflegung 06. Sep. 2016)	(18,12 %)	(0,50 %)
Institutional (Currency Exposure), thesaurierend (Auflegung 26. Feb. 2021)	(18,17 %)	(11,04 %)
Bloomberg Global Aggregate Credit Index (USD Unhedged)	(16,96 %)	0,91 % ²
Auf AUD lautende Klassen		
Institutional AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung 07. Apr. 2020)	(16,45 %)	(2,79 %)
Investor AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 25. Jun. 2018)	(16,83 %)	(1,11 %)
Bloomberg Global Aggregate Credit Index (AUD Hedged)	(15,50 %)	(0,05 %) ²
Auf CHF lautende Klassen		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 10. Dez. 2009)	(17,73 %)	1,88 %
Institutional CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 06. Feb. 2015)	(17,78 %)	(0,92 %)
Investor CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 10. Mai 2011)	(18,00 %)	0,70 %
Investor CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 22. Jan. 2009)	(17,96 %)	2,70 %
Administrative CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Jan. 2013)	(18,11 %)	(0,47 %)
Class E CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 06. Mrz. 2012)	(18,46 %)	(0,14 %)
Class W CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung 12. Aug. 2020)	(17,65 %)	(7,70 %)
Bloomberg Global Aggregate Credit Index (CHF Hedged)	(16,79 %)	2,30 % ²
Auf CZK lautende Klassen		
Institutional CZK (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 19. Mai 2015)	(12,42 %)	0,66 %
Bloomberg Global Aggregate Credit Index (CZK Hedged)	(11,16 %)	0,93 %
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 15. Sep. 2003)	(17,35 %)	3,35 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 15. Sep. 2008)	(17,34 %)	3,23 %
Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 08. Mai 2006)	(17,66 %)	2,80 %
Investor EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 22. Jan. 2009)	(17,70 %)	3,22 %
Administrative EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 17. Feb. 2009)	(17,79 %)	2,95 %
Administrative EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 17. Feb. 2009)	(17,79 %)	2,95 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)	(18,13 %)	2,19 %

Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

Kommentare zum Fonds

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

- » Makrostrategien trugen wegen einer Untergewichtung der Duration von Industrieländern zur Wertentwicklung bei.
- » Die Titelauswahl im Glücksspielsektor trug zur Wertentwicklung bei, da ausgewählte Emittenten sehr gut abschnitten.
- » Die Titelauswahl bei Auslandsschuldtiteln von Schwellenländern belastete die Wertentwicklung, da sich die Position in russischen Schuldtiteln unterdurchschnittlich entwickelte.
- » Die Übergewichtung und Titelauswahl bei Immobilieninvestmentgesellschaften beeinträchtigte die Wertentwicklung, da sich der Sektor unterdurchschnittlich entwickelte.
- » Die Übergewichtung und Titelauswahl im Bankensektor war der Wertentwicklung abträglich, da das Engagement in ausgewählten vorrangigen und nachrangigen Anleihen zurückblieb.

Durchschnittliche jährliche Gesamterrendite für den am 31. Dezember 2022 abgelaufenen Berichtszeitraum¹
(Forts.)

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 09. Sep. 2010)	(18,13 %)	0,89 %
Class R EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	(17,54 %)	0,18 %
Class T EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Sep. 2014)	(18,46 %)	(1,38 %)
Class W EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung 12. Aug. 2020)	(17,31 %)	(7,46 %)
Class W EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung 12. Aug. 2020)	(17,34 %)	(7,45 %)
Bloomberg Global Aggregate Credit Index (EUR Hedged)	(16,39 %)	2,63 % ²
Auf EUR lautende Klassen (Währungsrisiko)		
Institutional EUR (Currency Exposure), thesaurierend (Auflegung: 16. Aug. 2012)	(12,77 %)	2,33 %
Class E EUR (Currency Exposure), ausschüttend (Auflegung: 12. Dez. 2018)	(13,50 %)	(0,39 %)
Bloomberg Global Aggregate Credit Index (EUR Unhedged)	(11,52 %)	2,51 % ²
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 02. Sep. 2005)	(16,28 %)	3,68 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 11. Jul. 2008)	(16,30 %)	3,82 %
Investor GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 22. Jan. 2009)	(16,59 %)	3,83 %
Administrative GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Jan. 2009)	(16,73 %)	3,65 %
Class E GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 31. Mrz. 2009)	(17,09 %)	3,33 %
Class R GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	(16,46 %)	1,01 %
Class W GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung 12. Aug. 2020)	(16,26 %)	(6,58 %)
Class W GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung 12. Aug. 2020)	(16,15 %)	(6,53 %)
Bloomberg Global Aggregate Credit Index (GBP Hedged)	(15,34 %)	3,13 % ²
Auf HKD lautende Klassen		
Administrative HKD (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 28. Jul. 2017)	(15,91 %)	(0,49 %)
M Retail HKD (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 28. Jul. 2017)	(16,17 %)	(0,87 %)
Bloomberg Global Aggregate Credit Index (USD Hedged) Index, lautend auf HKD	(14,13 %)	0,65 %
Auf NOK lautende Klassen		
Institutional NOK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 18. Jan. 2012)	(16,39 %)	2,69 %
Bloomberg Global Aggregate Credit Index (NOK Hedged)	(15,43 %)	2,53 %
Auf SEK lautende Klassen		
Institutional SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 04. Dez. 2009)	(16,96 %)	2,80 %
Administrative SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 13. Dez. 2012)	(17,35 %)	0,15 %
Bloomberg Global Aggregate Credit Index (SEK Hedged)	(16,16 %)	2,40 % ²
Auf SGD lautende Klassen		
Institutional SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Okt. 2015)	(15,63 %)	1,31 %
Investor SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 23. Mai 2018)	(16,00 %)	(0,67 %)
Administrative SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 22. Sept. 2017)	(16,12 %)	(1,04 %)
Class E SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 18. Jul. 2012)	(16,49 %)	1,19 %
Class W SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung 13. Okt. 2020)	(15,57 %)	(6,80 %)
Bloomberg Global Aggregate Credit Index (SGD Hedged)	(14,57 %)	2,08 % ²

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

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

Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2022 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 28. Sep. 2018)	(14,74 %)	0,95 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 19. Jul. 2019)	(14,77 %)	(1,51 %)
Investor, thesaurierend (Auflegung: 4. Mai 2002)	(15,06 %)	(8,88 %)
Class E, thesaurierend (Auflegung: 28. Feb. 2020)	(15,56 %)	(4,86 %)
Class E, ausschüttend (Auflegung: 28. Feb. 2020)	(15,59 %)	(4,86 %)
Class Z, thesaurierend (Auflegung: 20. Jun. 2019)	(14,34 %)	(0,74 %)
Bloomberg Global Aggregate Credit Index (USD Hedged)	(14,22 %)	0,65 % ²
Auf CHF lautende Klassen		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Sep. 2018)	(17,03 %)	(1,44 %)
Institutional CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 28. Feb. 2020)	(17,05 %)	(5,79 %)
Class E CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Feb. 2020)	(17,88 %)	(6,67 %)
Class E CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 28. Feb. 2020)	(17,81 %)	(6,64 %)
Bloomberg Global Aggregate Credit Index (CHF Hedged)	(16,79 %)	(1,76 %) ²
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Sep. 2018)	(16,67 %)	(1,08 %)
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 28. Feb. 2020)	(16,72 %)	(5,49 %)
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Feb. 2020)	(17,41 %)	(6,35 %)
Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 28. Feb. 2020)	(17,41 %)	(6,35 %)
Bloomberg Global Aggregate Credit Index (EUR Hedged)	(16,39 %)	(1,38 %) ²
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Sep. 2018)	(15,63 %)	(0,16 %)
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 1. Mai 2019)	(15,55 %)	(1,44 %)
Class E GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Feb. 2020)	(16,44 %)	(5,60 %)
Bloomberg Global Aggregate Credit Index (GBP Hedged)	(15,34 %)	(0,43 %) ²
Auf SEK lautende Klassen		
Institutional SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 3. Nov. 2022)	—	3,70 %
Administrative SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 27. Nov. 2019)	(16,71 %)	(4,39 %)
Bloomberg Global Aggregate Credit Index (SEK Hedged)	(16,16 %)	(4,09 %) ²

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

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Global Investment Grade Credit ESG Fund strebt gleichzeitig mit dem Schutz des Kapitals, einer umsichtigen Anlageverwaltung und nachhaltigen Investitionen (durch explizite Integration von Umwelt-, Sozial- und Governance in den Anlageprozess, wie im Nachtrag näher erläutert) eine Maximierung der Gesamterträge an. Der Fonds beabsichtigt, sein Anlageziel zu erreichen, indem er mindestens zwei Drittel seines Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio von Unternehmensanleihen mit Investment Grade (wie im Verkaufsprospekt definiert) anlegt.

Kommentare zum Fonds

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

- » Makrostrategien trugen wegen einer Untergewichtung der Duration von Industrieländern zur Wertentwicklung bei.
- » Das Fehlen eines Engagements in russischen Schuldtiteln war positiv, da russische Schuldtitel hinter dem breiteren Markt zurückblieben.
- » Eine Übergewichtung von Immobilieninvestmentgesellschaften belastete die Wertentwicklung, da der Sektor schwächer abschnitt als der breitere Markt.
- » Eine Übergewichtung im Banken- und Brokerage-Sektor schmälerte die Wertentwicklung, da dieser Sektor schlechter abschnitt als der Gesamtmarkt.
- » Ein untergewichtetes Engagement in den Energie- und Pipelinesektoren beeinträchtigte die Wertentwicklung, da diese Sektoren den Gesamtmarkt übertrafen.

Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2022 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 18. Feb. 2014)	(1,26 %)	1,88 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 05. Okt. 2016)	(1,64 %)	2,15 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 18. Feb. 2014)	(2,24 %)	0,97 %
Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond 1-5 Year Index (USD Hedged)	(1,50 %)	1,87 % ²
Auf CHF lautende Klassen		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 18. Feb. 2014)	(3,61 %)	(0,14 %)
Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond 1-5 Year Index (CHF Hedged)	(3,97 %)	(0,20 %)
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 18. Feb. 2014)	(3,30 %)	0,28 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 17. Jan. 2017)	(3,28 %)	0,43 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 18. Feb. 2014)	(4,15 %)	(0,62 %)
Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond 1-5 Year Index (EUR Hedged)	(3,53 %)	0,28 % ²
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 20. Jan. 2017)	(1,80 %)	1,44 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 18. Feb. 2014)	(1,88 %)	1,18 %
Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond 1-5 Year Index (GBP Hedged)	(2,26 %)	1,17 % ²
Auf SGD lautende Klassen		
Institutional SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 22. Sep. 2022)	—	0,60 %
Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond 1-5 Year Index (SGD Hedged)	—	0,05 %

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

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

Kommentare zum Fonds

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

- » Ein untergewichtetes Engagement in nominalen deutschen Zinsen trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die nominalen Renditen in Deutschland stiegen.
- » Ein untergewichtetes Engagement in nominalen US-amerikanischen Zinsen trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die nominalen US-Renditen stiegen.
- » Ein untergewichtetes Engagement in nominalen italienischen Zinsen trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die nominalen Renditen in Italien stiegen.
- » Das übergewichtete Engagement in dänischen gedeckten Anleihen war der relativen Wertentwicklung abträglich, da sich diese Wertpapiere unterdurchschnittlich entwickelten.
- » Ein übergewichtetes Engagement in US-amerikanischen Non-Agency-MBS schmälerte die relative Wertentwicklung, da sich die Spreads der Non-Agency-MBS in den USA ausweiteten.
- » Ein übergewichtetes Engagement in realen italienischen Zinsen schmälerte die relative Wertentwicklung, da die realen Renditen in Italien stiegen.

Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2022 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 30. Sep. 2003)	(16,19 %)	4,08 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 30. Dez. 2005)	(16,22 %)	3,70 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 04. Mrz. 2004)	(16,47 %)	3,55 %
Investor, ausschüttend (Auflegung: 24. Feb. 2009)	(16,51 %)	3,98 %
Administrative, thesaurierend (Auflegung: 17. Dez. 2004)	(16,61 %)	3,28 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)	(16,94 %)	2,93 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 28. Okt. 2005)	(16,93 %)	2,83 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 21. Mai 2004)	(16,35 %)	3,88 %
Class R, thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	(16,43 %)	1,70 %
Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond USD Hedged Index	(17,00 %)	3,86 % ²
Auf USD lautende Klassen (Währungsrisiko)		
Institutional (Currency Exposure), thesaurierend (Auflegung 01. Sep. 2017)	(20,99 %)	(0,47 %)
Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond USD Unhedged Index	(21,86 %)	(0,72 %)
Auf CHF lautende Klassen		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 16. Mai 2008)	(18,41 %)	1,90 %
Institutional CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Okt. 2015)	(18,44 %)	0,10 %
Investor CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 24. Feb. 2009)	(18,70 %)	2,36 %
Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond CHF Hedged Index	(19,37 %)	1,58 % ²
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Sep. 2003)	(18,11 %)	3,13 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Dez. 2005)	(18,17 %)	2,66 %
Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 07. Apr. 2004)	(18,43 %)	2,65 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)	(18,85 %)	1,92 %
Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond EUR Hedged Index	(18,94 %)	2,87 % ²
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 05. Feb. 2004)	(17,29 %)	4,06 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 27. Apr. 2005)	(17,26 %)	3,60 %
Class R GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	(17,49 %)	1,03 %
Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond GBP Hedged Index	(18,10 %)	3,88 % ²
Auf SGD lautende Klassen		
Institutional SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 29. Feb. 2008)	(16,35 %)	3,14 %
Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond SGD Hedged Index	(17,32 %)	2,99 %

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

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

Kommentare zum Fonds

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

- » Ein untergewichtetes Engagement in britischen realen Zinsen trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die realen Renditen im Vereinigten Königreich stiegen.
- » Ein untergewichtetes Engagement in nominalen deutschen Zinsen trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die nominalen Renditen in Deutschland stiegen.
- » Ein untergewichtetes Engagement in nominalen US-amerikanischen Zinsen trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die nominalen US-Renditen stiegen.
- » Das übergewichtete Engagement in dänischen gedeckten Anleihen war der relativen Wertentwicklung abträglich, da sich diese Wertpapiere unterdurchschnittlich entwickelten.
- » Ein übergewichtetes Engagement in nominalen britischen Zinsen schmälerte die relative Wertentwicklung, da die nominalen Renditen im Vereinigten Königreich stiegen.
- » Ein übergewichtetes Engagement in US-amerikanischen Non-Agency-MBS schmälerte die relative Wertentwicklung, da sich die Spreads der Non-Agency-MBS in den USA ausweiteten.

Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2022 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	(7,49 %)	4,64 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	(7,52 %)	4,65 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 20. Jan. 2015)	(7,82 %)	3,20 %
Investor, ausschüttend (Auflegung: 18. Apr. 2013)	(7,91 %)	3,41 %
Administrative, thesaurierend (Auflegung: 13. Feb. 2017)	(7,93 %)	2,22 %
Administrative, ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	(7,95 %)	4,13 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	(8,38 %)	3,71 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	(8,37 %)	3,70 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 25. Mai 2018)	(7,68 %)	2,21 %
H Institutional, ausschüttend (Auflegung: 25. Mai 2018)	(7,68 %)	2,21 %
Class R, thesaurierend (Auflegung: 07. Nov. 2019)	(7,78 %)	0,60 %
Class R, ausschüttend (Auflegung: 30. Apr. 2015)	(7,77 %)	3,07 %
Class T, thesaurierend (Auflegung: 16. Okt. 2014)	(8,78 %)	2,09 %
Class T, ausschüttend (Auflegung: 16. Okt. 2014)	(8,67 %)	2,11 %
Class Z, thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	(7,02 %)	5,20 %
Bloomberg U.S. Aggregate Index	(13,01 %)	1,03 % ²
Auf AUD lautende Klassen		
Institutional AUD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 17. Jan. 2018)	(8,71 %)	1,17 %
Investor AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 23. Mai 2018)	(8,94 %)	1,14 %
Administrative AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 08. Jun. 2016)	(9,12 %)	2,30 %
Class E AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 16. Feb. 2017)	(9,44 %)	1,19 %
Class Z AUD (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 28. Okt. 2015)	(8,23 %)	3,71 %
Bloomberg U.S. Aggregate (AUD Hedged) Index	(14,24 %)	0,60 % ²
Auf BRL lautende Klassen		
Institutional BRL (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 03. Feb. 2016)	6,53 %	4,67 %
Bloomberg Global Aggregate (BRL Hedged) Index	(2,20 %)	6,83 %
Auf CAD lautende Klassen		
Institutional CAD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 01. Apr. 2016)	(7,83 %)	3,05 %
Institutional CAD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 07. Sep. 2018)	(7,90 %)	2,01 %
Bloomberg U.S. Aggregate (CAD Hedged) Index	(13,39 %)	0,07 % ²
Auf CHF lautende Klassen		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 18. Dez. 2014)	(9,98 %)	1,30 %
Institutional CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Okt. 2015)	(10,01 %)	1,00 %
Class E CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 18. Feb. 2014)	(10,80 %)	0,71 %
Class E CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 18. Feb. 2014)	(10,77 %)	0,71 %
Bloomberg U.S. Aggregate (CHF Hedged) Index	(15,62 %)	(0,92 %) ²
Auf CNH lautende Klassen		
Investor RMB (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 03. Jan. 2018)	(7,53 %)	2,93 %
Class E RMB (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 22. Mai 2013)	(8,05 %)	4,70 %
Bloomberg U.S. Aggregate (CNH Hedged) Index	(12,91 %)	3,36 % ²
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	(9,63 %)	3,10 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	(9,66 %)	3,09 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 29. Jul. 2014)	(9,67 %)	1,65 %
Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 10. Apr. 2015)	(10,00 %)	1,00 %
Investor EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 07. Mai 2015)	(9,99 %)	1,07 %
Investor EUR (Hedged), ausschüttend A (Auflegung: 16. Dez. 2015)	(10,00 %)	1,19 %

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Income Fund ist bestrebt, unter Anwendung einer umsichtigen Anlageverwaltung hohe laufende Erträge zu erzielen, wobei das sekundäre Ziel der langfristige Kapitalzuwachs ist. Der Fonds investiert mindestens zwei Drittel seines Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio aus Rentenwerten (wie im Verkaufsprospekt definiert) mit unterschiedlichen Laufzeiten. Der Fonds strebt hohe Dividendenerträge an, indem er in eine breite Palette von Rentenwertsektoren anlegt, die nach Ansicht der Anlageberatungsgesellschaft typischerweise Erträge auf erhöhtem Niveau einbringen.

Kommentare zum Fonds

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

- » Ein Short-Engagement in britischer Duration trug zur Wertentwicklung bei, da die Zinsen im Vereinigten Königreich stiegen.
- » Eine Short-Position in japanischer Duration trug zur Wertentwicklung bei, da die japanischen Renditen stiegen.
- » Long-Engagements gegenüber dem Brasilianischem Real trugen zur Wertentwicklung bei, da er gegenüber dem US-Dollar an Wert gewann.
- » Ein Long-Engagement in US-amerikanischer Duration schmälerte die Wertentwicklung, da die US-Zinsen stiegen.
- » Positionen in besicherten Krediten wie Agency-MBS schmälerte die Wertentwicklung, da sich die Spreads ausweiteten.
- » Ein Long-Engagement bei hochverzinslichen Unternehmensanleihen belastete die Wertentwicklung, da sich die Spreads ausweiteten.

Durchschnittliche jährliche Gesamterrendite für den am 31. Dezember 2022 abgelaufenen Berichtszeitraum¹
(Forts.)

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Administrative EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 14. Aug. 2015)	(10,05 %)	0,97 %
Administrative EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 08. Jun. 2016)	(10,13 %)	0,68 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	(10,45 %)	2,18 %
Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	(10,47 %)	2,18 %
Class E EUR (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 31. Aug. 2018)	(10,48 %)	(0,53 %)
Class E EUR (Hedged), ausschüttend II Q (Auflegung: 30. Sep. 2019)	(10,47 %)	(1,62 %)
G Retail EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 25. Aug. 2017)	(10,45 %)	(0,95 %)
Class R EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Jan. 2016)	(9,94 %)	1,32 %
Class T EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Sep. 2014)	(10,86 %)	0,31 %
Class T EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Sep. 2014)	(10,88 %)	0,31 %
Bloomberg U.S. Aggregate (EUR Hedged) Index	(15,19 %)	(0,42 %) ²
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 07. Feb. 2019)	(8,41 %)	0,86 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 15. Feb. 2013)	(8,36 %)	3,11 %
Investor GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Jan. 2020)	(8,74 %)	(1,11 %)
Administrative GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 02. Sept. 2016)	(8,79 %)	1,29 %
Class E GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 15. Mrz. 2017)	(9,18 %)	0,49 %
Class R GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	(8,66 %)	3,62 %
Bloomberg U.S. Aggregate (GBP Hedged) Index	(14,06 %)	0,45 % ²
Auf HKD lautende Klassen		
Institutional HKD (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Okt. 2015)	(7,40 %)	3,54 %
Administrative HKD (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 26. Apr. 2017)	(7,82 %)	2,05 %
Class E HKD (Unhedged), ausschüttend (Auflegung 04. Feb. 2013)	(8,32 %)	3,02 %
Bloomberg U.S. Aggregate (HKD Unhedged) Index	(12,91 %)	1,20 % ²
Auf JPY lautende Klassen		
Class E JPY (Hedged), thesaurierend (Auflegung 01. Sep. 2017)	(10,70 %)	(0,76 %)
Class E JPY (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 21. Dez. 2022)	—	(0,80 %)
Bloomberg U.S. Aggregate (JPY Hedged) Index	(15,79 %)	(2,00 %) ²
Auf NOK lautende Klassen		
Institutional NOK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 19. Apr. 2017)	(8,63 %)	1,38 %
Bloomberg U.S. Aggregate (NOK Hedged) Index	(14,12 %)	(0,50 %)
Auf SGD lautende Klassen		
Institutional SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung 14. Jul. 2020)	(7,72 %)	0,65 %
Institutional SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 16. Dez. 2015)	(7,72 %)	3,34 %
Investor SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung 07. Feb. 2020)	(8,04 %)	(0,56 %)
Investor SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 23. Mai 2018)	(8,04 %)	1,67 %
Administrative SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	(8,19 %)	3,97 %
Class E SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 19. Feb. 2013)	(8,53 %)	2,80 %
Bloomberg U.S. Aggregate (SGD Hedged) Index	(13,32 %)	0,96 % ²

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

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

Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2022 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 29. Jan. 2021)	(7,77 %)	(3,28 %)
Class E, ausschüttend (Auflegung: 29. Jan. 2021)	(8,53 %)	(4,13 %)
Bloomberg U.S. Aggregate Index	(13,01 %)	(7,40 %)
Auf AUD lautende Klassen		
Class E AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Jan. 2021)	(9,60 %)	(4,81 %)
Bloomberg U.S. Aggregate (AUD Hedged) Index	(14,24 %)	(8,16 %)
Auf EUR lautende Klassen		
Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 17. Feb. 2021)	(10,70 %)	(5,82 %)
Bloomberg U.S. Aggregate (EUR Hedged) Index	(15,19 %)	(8,87 %)
Auf GBP lautende Klassen		
Class E GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 17. Feb. 2021)	(9,28 %)	(4,77 %)
Bloomberg U.S. Aggregate (GBP Hedged) Index	(14,06 %)	(7,92 %)
Auf HKD lautende Klassen		
E Class HKD (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Jan. 2021)	(8,46 %)	(3,80 %)
Bloomberg U.S. Aggregate (HKD Unhedged) Index	(12,91 %)	(7,08 %)

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Income Fund II ist bestrebt, unter Anwendung einer umsichtigen Anlageverwaltung hohe laufende Erträge zu erzielen, wobei das sekundäre Ziel der langfristige Kapitalzuwachs ist. Der Fonds investiert mindestens zwei Drittel seines Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio aus Rentenwerten (wie im Verkaufsprospekt definiert) mit unterschiedlichen Laufzeiten. Der Teilfonds strebt hohe Dividendenerträge an, indem er in eine breite Palette von Rentenwertsektoren anlegt, die nach Ansicht der Anlageberatungsgesellschaft typischerweise Erträge auf erhöhtem Niveau einbringen.

Kommentare zum Fonds

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

- » Ein Short-Engagement in britischer Duration trug zur Wertentwicklung bei, da die Zinsen im Vereinigten Königreich stiegen.
- » Long-Engagements gegenüber dem Brasilianischem Real trugen zur Wertentwicklung bei, da er gegenüber dem US-Dollar an Wert gewann.
- » Eine Short-Position in japanischer Duration trug zur Wertentwicklung bei, da die japanischen Renditen stiegen.
- » Ein Long-Engagement in US-amerikanischer Duration schmälerte die Wertentwicklung, da die US-Zinsen stiegen.
- » Ein Long-Engagement bei hochverzinslichen Unternehmensanleihen belastete die Wertentwicklung, da sich die Spreads ausweiteten.
- » Ein ausgewähltes Engagement bei Schwellenland-Auslandsschulden belastete die Wertentwicklung, da sich die Spreads ausweiteten.

Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2022 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 14. Feb. 2013)	(5,12 %)	1,09 %
Administrative, ausschüttend II (Auflegung: 22. März 2012)	—	(9,20 %)
Class E, thesaurierend (Auflegung: 14. Feb. 2013)	(6,07 %)	(0,10 %)
Class E, ausschüttend II (Auflegung: 2. Aug. 2022)	—	(5,63 %)
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 23. Aug. 2022)	—	(5,50 %)
M Retail, ausschüttend II (Auflegung: 2. Aug. 2019)	—	(5,66 %)
gewichtet nach 45 % Bloomberg Global Inflation Linked 1-30yrs Index (USD Hedged), 15 % JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (USD Unhedged), 20 % Bloomberg Commodity Total Return Index, 10 % FTSE NAREIT Global Real Estate Developed Total Return Index (USD Unhedged) und 10 % Bloomberg Gold Subindex Total Return Index (USD Hedged) ³	(5,31 %)	1,02 % ²
Auf AUD lautende Klassen		
Class E AUD (Partially Hedged), thesaurierend (Auflegung: 18. Aug. 2022)	—	(6,50 %)
gewichtet nach 45 % Bloomberg Global Inflation Linked 1-30yrs Index (AUD Hedged), 15 % JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (AUD Unhedged), 20 % Bloomberg Commodity Total Return Index (AUD Hedged), 10 % FTSE NAREIT Global Real Estate Developed Total Return Index (AUD Unhedged) und 10 % Bloomberg Gold Subindex Total Return Index (AUD Hedged) ³	—	(5,35 %)
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Partially Hedged), thesaurierend (Auflegung: 18. Nov. 2021)	(5,22 %)	(5,02 %)
Class E EUR (Partially Hedged), thesaurierend (Auflegung: 16. Apr. 2013)	(6,17 %)	(0,77 %)
Class E EUR (Partially Hedged), ausschüttend (Auflegung: 16. Apr. 2013)	(6,23 %)	(0,77 %)
gewichtet nach 45 % Bloomberg Global Inflation Linked 1-30yrs Index (EUR Hedged), 15 % JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (EUR Unhedged), 20 % Bloomberg Commodity Total Return Index (EUR Hedged), 10 % FTSE NAREIT Global Real Estate Developed Total Return Index (EUR Unhedged) und 10 % Bloomberg Gold Subindex Total Return Index (EUR Hedged) ³	(4,56 %)	0,68 % ²
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Partially Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Mai 2014)	(3,03 %)	1,65 %
Class E GBP (Partially Hedged), thesaurierend (Auflegung: 02. Aug. 2022)	—	(5,90 %)
gewichtet nach 45 % Bloomberg Global Inflation Linked 1-30yrs Index (GBP Hedged), 15 % JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (GBP Unhedged), 20 % Bloomberg Commodity Total Return Index (GBP Hedged), 10 % FTSE NAREIT Global Real Estate Developed Total Return Index (GBP Unhedged) und 10 % Bloomberg Gold Subindex Total Return Index (GBP Hedged) ³	(2,38 %)	1,59 % ²
Auf SGD lautende Klassen		
Administrative SGD (Partially Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 22. Feb. 2022)	—	(6,75 %)
Class E SGD (Partially Hedged), thesaurierend (Auflegung: 02. Aug. 2022)	—	(6,40 %)
45 % Bloomberg Global Inflation Linked 1-30yrs Index (SGD Hedged), 15 % JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (SGD Unhedged), 20 % Bloomberg Commodity Total Return Index (SGD Hedged), 10 % FTSE NAREIT Global Real Estate Developed Total Return Index (SGD Unhedged) und 10 % Bloomberg Gold Subindex Total Return Index (SGD Hedged) ³	—	(7,68 %) ²

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

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

³ Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Inflation Multi-Asset Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 31. März 2017: 45 % Global Advantage Inflation-Linked Bond Index (USD Partial Hedged), 30 % FTSE NAREIT Global Real Estate Developed REITS Only Index (USD), 15 % Bloomberg Commodity Total Return Index, 10 % Bloomberg Gold Total Return Index; 1. April 2017 bis 12. April 2022: 45 % Bloomberg Global Inflation Linked 1-30yrs Index (USD Hedged), 15 % Bloomberg Emerging Market Government Inflation-Linked Bond Index (USD Unhedged), 10 % Bloomberg Commodity Total Return Index, 10 % FTSE NAREIT Global Real Estate Developed Total Return Index (USD Unhedged), 15 % Alerian MLP Total Return Index, 5 % Bloomberg Gold Subindex Total Return; Ab 13. April 2022: gewichtet nach 45 % Bloomberg Global Inflation Linked 1-30yrs Index (USD Hedged), 15 % JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (USD Unhedged), 20 % Bloomberg Commodity Total Return Index, 10 % FTSE NAREIT Global Real Estate Developed Total Return Index (USD Unhedged) und 10 % Bloomberg Gold Subindex Total Return Index (USD Hedged).

Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

Kommentare zum Fonds

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

- » Eine Untergewichtung in britischen Zinsen steigerte die relative Wertentwicklung, da die Zinsen im Vereinigten Königreich während des Berichtszeitraums stiegen.
- » Ein übergewichtetes Engagement in europäischer Breakeven-Inflation („BEI“) bzw. der Ertragsdifferenz zwischen nominalem Staatsanleihen aus dem Euroraum und inflationsgebundenen Anleihen mit gleicher Laufzeit trugen zur relativen Wertentwicklung bei, da die europäische BEI aufwärts tendierte.
- » Eine Untergewichtung in deutschen Zinsen steigerte die relative Wertentwicklung, da die Zinsen in Deutschland während des Berichtszeitraums stiegen.
- » Ein übergewichtetes Engagement in dänischen Zinsen über dänische gedeckte Anleihen war der relativen Wertentwicklung abträglich, da die dänischen Zinsen im Berichtszeitraum stiegen.
- » Das übergewichtete Engagement in US-amerikanischen Zinsen (hauptsächlich Realzinsen) war der relativen Wertentwicklung abträglich, da die US-Zinssätze in diesem Zeitraum stiegen.
- » Ein vor allem von Januar bis August ausgeprägtes untergewichtetes Engagement in der britischen BEI belastete die relative Wertentwicklung, weil die britische BEI in diesem Zeitraum aufwärts tendierte.

Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2022 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 05. Dez. 2002)	(4,82 %)	2,24 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 05. Dez. 2002)	(4,84 %)	2,23 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 13. Mai 2004)	(5,19 %)	1,92 %
Investor, ausschüttend (Auflegung: 03. Jul. 2003)	(5,22 %)	1,81 %
Administrative, thesaurierend (Auflegung: 08. Sep. 2004)	(5,32 %)	1,73 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 21. Sep. 2007)	(5,71 %)	1,09 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 28. Okt. 2005)	(5,70 %)	1,39 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 04. Nov. 2009)	(4,95 %)	1,21 %
H Institutional, ausschüttend (Auflegung: 12. Dez. 2018)	(4,94 %)	0,32 %
Class R, thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	(5,17 %)	0,44 %
ICE BofA Merrill Lynch 1-3 Year U.S. Treasury Index	(3,65 %)	1,72 % ²
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Jan. 2012)	(6,81 %)	(0,27 %)
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Dez. 2005)	(6,75 %)	1,34 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 24. Jul. 2009)	(7,52 %)	(0,37 %)
ICE BofA Merrill Lynch 1-3 Year U.S. Treasury Index (EUR Hedged)	(5,66 %)	0,75 % ²
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 20. Jan. 2017)	(5,34 %)	(0,42 %)
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 01. Mrz. 2010)	(5,30 %)	0,89 %
ICE BofA Merrill Lynch 1-3 Year U.S. Treasury Index (GBP Hedged)	(4,27 %)	0,41 % ²

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

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

Kommentare zum Fonds

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

- » Ein untergewichtetes Engagement in der US-Duration im zweijährigen Bereich der Renditekurve trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die Zinsen am vorderen Ende der US-Strukturkurve stiegen.
- » Ein untergewichtetes Engagement in der britischen Duration im zehnjährigen Bereich der Renditekurve trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die britischen Zinsen stiegen.
- » Ausgewählte Positionen innerhalb der Indizes für Credit Default Swaps auf hochverzinsliche Unternehmensanleihen schmälerten die relative Wertentwicklung, da sich die Spreads von hochverzinslichen Unternehmensanleihen im vierten Quartal 2022 verengten.
- » Positionen in Agency-MBS war der relativen Wertentwicklung abträglich, da die Anlageklasse eine negative Gesamterträge lieferte.
- » Ein übergewichtetes Engagement in europäischer Duration in den zwei- und dreijährigen Abschnitten der Renditekurve war der relativen Wertentwicklung abträglich, da die europäischen Zinssätze stiegen.

Low Duration Global Investment Grade Credit Fund

Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2022 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 28. Feb. 2014)	(5,37 %)	1,54 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 22. Juni 2021)	(5,40 %)	(4,35 %)
Bloomberg Global Aggregate Credit 1-5 Years Index (USD Hedged)	(6,00 %)	1,58 % ²
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Feb. 2014)	(7,34 %)	(0,03 %)
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 3. Juni 2021)	(7,31 %)	(5,81 %)
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Feb. 2014)	(8,09 %)	(0,94 %)
Bloomberg Global Aggregate Credit 1-5 Years Index (EUR Hedged)	(8,06 %)	(0,03 %) ²
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Feb. 2014)	(6,02 %)	0,84 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 03. Jun. 2021)	(6,01 %)	(4,73 %)
Bloomberg Global Aggregate Credit 1-5 Years Index (GBP Hedged)	(6,79 %)	0,87 % ²
Auf NOK lautende Klassen		
Institutional NOK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 10. Jul. 2017)	(6,01 %)	0,11 %
Bloomberg Global Aggregate Credit 1-5 Years Index (NOK Hedged)	(6,71 %)	0,40 %

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

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

Kommentare zum Fonds

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

- » Makrostrategien trugen wegen einer Untergewichtung der Duration von Industrieländern zur Wertentwicklung bei.
- » Die Titelauswahl im Glücksspielsektor trug zur Wertentwicklung bei, da ausgewählte Emittenten sehr gut abschnitten.
- » Die Titelauswahl im Bankensektor trug zur Wertentwicklung bei, da ausgewählte Emittenten sehr gut abschnitten.
- » Die Titelauswahl bei Auslandsschuldtiteln von Schwellenländern belastete die Wertentwicklung, da sich die Position in russischen Schuldtiteln unterdurchschnittlich entwickelte.
- » Das Engagement im verbrieften Sektor, der für das Jahr eine negative Gesamterträge verbuchte, war der Wertentwicklung abträglich.

Durchschnittliche jährliche Gesamtrendite für den am 31. Dezember 2022 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 31. Mai 2018)	(3,80 %)	1,88 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 31. Mai 2018)	(3,74 %)	1,90 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 31. Mai 2018)	(4,55 %)	1,03 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 14. Sep. 2018)	(4,59 %)	0,98 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung 03. Sep. 2020)	(3,99 %)	0,47 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 18. Jan. 2022)	—	(3,49 %)
Bloomberg U.S. Aggregate 1-3 Years Index	(3,72 %)	0,93 % ²
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mai 2018)	(5,88 %)	(0,15 %)
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 22. Nov. 2021)	(5,36 %)	(4,76 %)
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mai 2018)	(6,65 %)	(1,02 %)
Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 31. Mai 2018)	(6,69 %)	(1,02 %)
Class Z EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung 03. Jun. 2020)	(5,38 %)	0,81 %
Bloomberg U.S. Aggregate 1-3 Years Index (EUR Hedged)	(5,75 %)	(1,03 %) ²
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mai 2018)	(4,51 %)	0,80 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 31. Mai 2018)	(4,48 %)	0,79 %
Bloomberg U.S. Aggregate 1-3 Years Index (GBP Hedged)	(4,37 %)	0,02 %
Auf SGD lautende Klassen		
Institutional SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung 14. Okt. 2020)	(3,89 %)	0,54 %
Bloomberg U.S. Aggregate 1-3 Years Index (SGD Hedged)	(3,81 %)	(1,82 %)

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

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

Kommentare zum Fonds

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

- » Ein Short-Engagement in britischer Duration trug zur Wertentwicklung bei, da die Zinsen stiegen.
- » Eine Short-Position in japanischer Duration trug zur Wertentwicklung bei, da die Renditen stiegen.
- » Das Long-Engagement gegenüber dem russischen Rubel trug zur Wertentwicklung bei, da er gegenüber dem US-Dollar an Wert gewann.
- » Ein Long-Engagement in US-amerikanischer Duration schmälerte die Wertentwicklung, da die Zinsen stiegen.
- » Ein Long-Engagement bei hochverzinslichen Unternehmensanleihen belastete die Wertentwicklung, da sich die Spreads ausweiteten.
- » Positionen in besicherten Krediten wie Agency-MBS schmälerte die Wertentwicklung, da sich die Spreads ausweiteten.

Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2022 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 29. Jan. 2016)	(7,35 %)	1,33 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 07. Mrz. 2019)	(7,28 %)	(0,12 %)
Class Z, thesaurierend (Auflegung: 15. Sep. 2021)	(6,95 %)	(5,93 %)
ICE BofA SOFR Overnight Rate Index ³	1,69 %	1,19 % ²
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 29. Jan. 2016)	(9,37 %)	(0,62 %)
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 04. Apr. 2018)	(9,31 %)	(1,51 %)
Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Jan. 2018)	(9,64 %)	(1,92 %)
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 20. Okt. 2017)	(9,96 %)	(2,30 %)
Euro Short-Term Rate (ESTER) Index ⁴	(0,02 %)	(0,37 %) ²
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 29. Jan. 2016)	(7,98 %)	0,37 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Jan. 2019)	(7,98 %)	(0,78 %)
ICE BofA SONIA Overnight Rate Index ⁵	1,42 %	0,53 % ²

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

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

³ Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Low Duration Opportunities Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 30. Juni 2022: 1-Monats-USD-LIBOR Index; ab 1. Juli 2021: ICE BofA SOFR Overnight Rate Index.

⁴ Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Low Duration Opportunities Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 30. Juni 2021: 1-Monats-Euribor Index; ab 1. Juli 2021: Euro Short-Term Rate (ESTER) Index.

⁵ Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Low Duration Opportunities Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 30. Juni 2021: 1-Monats-GBP-LIBOR Index; ab 1. Juli 2021: SONIA ICE BofA SONIA Overnight Rate Index.

Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

Kommentare zum Fonds

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

- » Ein Short-Engagement in britischer Duration trug zur Wertentwicklung bei, da die Zinsen im Vereinigten Königreich stiegen.
- » Short-Engagements gegenüber dem Euro trugen zur Wertentwicklung bei, da er gegenüber dem US-Dollar an Wert verlor.
- » Long-Engagements gegenüber dem Brasilianischem Real trugen zur Wertentwicklung bei, da er gegenüber dem US-Dollar an Wert gewann.
- » Ein Long-Engagement in US-amerikanischer Duration schmälerte die Wertentwicklung, da die US-Zinsen stiegen.
- » Ein Long-Engagement in italienischer Duration belastete die Wertentwicklung, da die italienischen Zinsen stiegen.
- » Beteiligungen an Unternehmensanleihen mit Investment Grade waren dem Ergebnis abträglich, da sich die Spreads auf diese Wertpapiere erweiterten.

Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2022 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 27. Jul. 2022)	—	(1,00 %)
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 27. Jul. 2022)	—	(0,94 %)
ICE BofA SOFR Overnight Rate Index	—	1,35 %
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 27. Jul. 2022)	—	(2,20 %)
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 27. Juli 2022)	—	(2,16 %)
Euro Short-Term Rate (ESTER)	—	0,33 %
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 27. Jul. 2022)	—	(1,50 %)
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 27. Jul. 2022)	—	(1,54 %)
ICE BofA SONIA Overnight Rate Index	—	1,00 %

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Low Duration Opportunities ESG Fund möchte die bei Kapitalerhalt und umsichtiger Vermögensverwaltung die langfristige Rendite maximieren. Der Fonds verfolgt sein Anlageziel, indem er unter normalen Umständen mindestens zwei Drittel seiner Vermögenswerte in ein diversifiziertes Portfolio von Renteninstrumenten mit unterschiedlichen Laufzeiten anlegt. Die durchschnittliche Portfolioduration dieses Teilfonds bewegt sich normalerweise zwischen 1 bis 5 Jahren, je nach der Prognose der Anlageverwaltungsgesellschaften für den Zinssatz. Der Fonds verfolgt das Ziel, unter normalen Marktbedingungen auf verschiedene Weise ökologische und soziale Eigenschaften zu bewerben, wie in der Ergänzung für den Fonds dargelegt, und beabsichtigt, einen Teil seines Vermögens in nachhaltige Anlagen zu investieren.

Der Fonds nahm seine Tätigkeit am 27. Juli 2022 auf.

Kommentare zum Fonds

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

- » Ein Short-Engagement in britischer Duration trug zur Wertentwicklung bei, da die Zinsen im Vereinigten Königreich stiegen.
- » Beteiligungen an Unternehmensanleihen mit Investment Grade waren dem Ergebnis zuträglich, da sich die Spreads auf diese Wertpapiere verengten.
- » Ein Long-Engagement in US-amerikanischer Duration schmälerte die Wertentwicklung, da die US-Zinsen stiegen.
- » Ein Long-Engagement in europäischer Duration belastete die Wertentwicklung, da die europäischen Zinsen stiegen.
- » Ein Long-Engagement in kanadischer Duration war der Wertentwicklung abträglich, da die kanadischen Zinsen stiegen.

Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2022 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 25. Nov. 2014)	25,71 %	0,21 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 25. Nov. 2014)	25,65 %	0,20 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 25. Nov. 2014)	24,58 %	(0,97 %)
Class Z, thesaurierend (Auflegung: 07. Jun. 2019)	27,02 %	7,35 %
Alerian MLP Index	30,92 %	(2,39 %) ²
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 25. Nov. 2014)	22,70 %	(1,77 %)
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 25. Nov. 2014)	22,54 %	(1,76 %)
Alerian MLP Index EUR (Hedged)	28,13 %	(4,03 %)
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 25. Nov. 2014)	23,90 %	(1,62 %)
Alerian MLP Index GBP (Hedged)	28,96 %	(3,99 %)

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

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

Kommentare zum Fonds

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

- » Ein Engagement bei Aktien von Midstream-Energieunternehmen trug zur absolute Rendite bei, da der Sektor positive Renditen verzeichnete.
- » Das übergewichtete Engagement im Liquifizierungssektor trug zur relativen Rendite bei, da der Sektor besser abschnitt als der Vergleichsindex.
- » Eine Übergewichtung von Explorations-, Förderungs- und Raffinerieunternehmen trug zur relativen Rendite bei, da der Sektor besser abschnitt als der Vergleichsindex.
- » Die Auswahl im Subsektor Pipeline-Transport von Erdgas und Erdöl schmälerte die relative Rendite, da die Positionen des Fonds eine unterdurchschnittliche Entwicklung aufwiesen.
- » Die Auswahl im Subsektor Sammlung und Aufbereitung schmälerte die relative Rendite, da die Positionen des Fonds eine unterdurchschnittliche Entwicklung aufwiesen.

Durchschnittliche jährliche Gesamrendite für den am 31. Dezember 2022 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 25. Jan. 2017)	(8,52 %)	1,21 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 25. Jan. 2017)	(8,51 %)	1,22 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 12. Mai 2017)	(8,85 %)	0,53 %
Investor, ausschüttend (Auflegung: 25. Jan. 2017)	(8,83 %)	0,87 %
Administrative, ausschüttend (Auflegung: 25. Jan. 2017)	(8,96 %)	0,73 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 25. Jan. 2017)	(9,34 %)	0,32 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 25. Jan. 2017)	(9,40 %)	0,31 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 14. Mai 2020)	(8,68 %)	(0,42 %)
ICE BofA SOFR Overnight Rate Index ³	1,78 %	1,47 % ²
Auf CAD lautende Klassen		
Institutional CAD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 01. Jun. 2021)	(8,68 %)	(4,74 %)
ICE BofA SOFR Overnight Rate Index (CAD Hedged) ³	1,46 %	0,94 %
Auf CHF lautende Klassen		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 25. Jan. 2017)	(10,79 %)	(1,14 %)
Class E CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 09. Aug. 2017)	(11,66 %)	(2,62 %)
ICE BofA SOFR Overnight Rate Index (CHF Hedged) ³	(0,68 %)	(0,91 %) ²
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 25. Jan. 2017)	(10,41 %)	(0,77 %)
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 25. Jan. 2017)	(10,35 %)	(0,76 %)
Class E EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 25. Jan. 2017)	(11,27 %)	(1,67 %)
ICE BofA SOFR Overnight Rate Index (EUR Hedged) ³	(0,11 %)	(0,50 %)
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 25. Jan. 2017)	(9,07 %)	0,20 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 25. Jan. 2017)	(9,15 %)	0,19 %
ICE BofA SOFR Overnight Rate Index (GBP Hedged) ³	1,33 %	0,50 % ²

¹ Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr; ansonsten kumulativ

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

³ Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Mortgage Opportunities Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 30. Juni 2022: 3-Monats-USD-LIBOR Index; ab 1. Juli 2021: ICE BofA SOFR Overnight Rate Index.

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Mortgage Opportunities Fund beabsichtigt, einen höchstmöglichen langfristigen Ertrag bei gleichzeitiger umsichtiger Anlageverwaltung zu erreichen, indem er unter normalen Umständen mindestens 80 % seines Nettovermögens in ein diversifiziertes Portfolio aus mit Hypotheken verbundenen festverzinslichen Instrumenten (wie im Verkaufsprospekt definiert) investiert, zu denen unter anderem Agency- und Non-Agency-RMBS und CMBS sowie Wertpapiere zur Übertragung von Kreditrisiken zählen können.

Kommentare zum Fonds

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

- » Positionen in strukturierten Agency-MBS, insbesondere auf Verzinsung beschränkte Positionen, trugen zur Wertentwicklung bei, da der Sektor positive Renditen erzielte.
- » Ein negatives Engagement in europäischer Duration trug zur Wertentwicklung bei, da die europäischen Zinsen stiegen.
- » Das US-Zinsengagement belastete die Wertentwicklung, da die Zinssätze stiegen.
- » Ein Engagement bei vorrangigen Non-Agency-RMBS belastete die Wertentwicklung, da sich die Spreads ausweiteten.
- » Relative Value-Strategien mit Agency-MBS belasteten die Wertentwicklung, da der Sektor negative Renditen generierte.

Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2022 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 31. Dez. 1998)	(21,95 %)	6,64 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 22. Nov. 2001)	(21,96 %)	7,82 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 07. Jan. 1999)	(22,23 %)	6,14 %
BE Retail, thesaurierend (Auflegung: 28. Apr. 2022)	—	(13,40 %)
Class E, thesaurierend (Auflegung: 11. Sep. 2006)	(22,65 %)	7,85 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 08. Jan. 2020)	(22,05 %)	5,41 %
S&P 500 Index (nach Abzug der Quellensteuer auf Dividenden)	(18,51 %)	6,24 % ²
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Sep. 2012)	(24,30 %)	10,00 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung 02. Aug. 2017)	(24,96 %)	5,61 %
S&P (EUR Hedged) 500 Index (nach Abzug der Quellensteuer auf Dividenden)	(20,98 %)	9,69 % ²
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 17. Jun. 2021)	(23,76 %)	(9,33 %)
S&P (GBP Hedged) 500 Index (nach Abzug der Quellensteuer auf Dividenden)	(20,34 %)	(6,58 %)
Auf SGD lautende Klassen		
Institutional SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 22. Apr. 2022)	—	(12,40 %)
S&P 500 (SGD Hedged) Index (Net Total Return)	—	(11,26 %)

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

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

Kommentare zum Fonds

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

» Das Engagement des Teilfonds bei mit dem S&P 500 Index verbundenen Aktienindexderivaten wirkte sich negativ auf die absolute Rendite aus, da der S&P 500 Net Total Return Index eine Rendite von -18,51 % verbuchte.

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

» Ein moderates Short-Engagement im Euro im Berichtszeitraum von Januar 2022 bis Oktober 2022 trug zur Wertentwicklung bei, da der Euro gegenüber dem US-Dollar an Wert verlor.

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

» Ein Long-Engagement in US-amerikanischen Zinsen schmälerte die Renditen, da die Zinsen zunahmen.

» Positionen in Non-Agency-MBS schmälerte Renditen, da sich die Spreads ausweiteten.

Durchschnittliche jährliche Gesamtrendite für den am 31. Dezember 2022 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 29. Mrz. 2019)	(21,70 %)	9,51 %
S&P 500 Index (nach Abzug der Quellensteuer auf Dividenden)	(18,51 %)	9,71 %
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 17. Jun. 2021)	(23,58 %)	(9,40 %)
S&P (GBP Hedged) 500 Index (nach Abzug der Quellensteuer auf Dividenden)	(20,34 %)	(6,58 %)

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

Kommentare zum Fonds

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

- » Das Engagement des Teilfonds bei mit dem S&P 500 Index verbundenen Aktienindexderivaten wirkte sich negativ auf die absolute Rendite aus, da der S&P 500 Net Total Return Index eine Rendite von -18,51 % verbuchte.
- » Die Alpha-Anleihenstrategie des Portfolios war der Rendite abträglich. Die Wertentwicklung war vor allem auf die folgenden Faktoren zurückzuführen:
 - » Ein Short-Engagement in britischen langfristigen Zinssätzen trug zur Wertentwicklung bei, da die langfristigen britischen Zinssätze stiegen.
 - » Positionen in inflationsgeschützten Staatsanleihen (TIPS) trugen zu den Renditen bei, da der Break-Even-Carry aufgrund der aufgelaufenen Inflation positiv war.
 - » Ein Long-Engagement in US-amerikanischen Zinsen schmälerte die Renditen, da die Zinsen zunahmen.
 - » Beteiligungen an Unternehmensanleihen mit Investment Grade waren der Rendite abträglich, da sich die Spreads ausweiteten.

Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2022 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 14. Mrz. 2018)	(6,50 %)	2,45 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 16. Dez. 2013)	(7,32 %)	3,20 %
Class E, ausschüttend II (Auflegung: 16. Dez. 2013)	(7,40 %)	3,19 %
75 % Bloomberg U.S. Aggregate Bond Index/25 % MSCI ACWI High Dividend Yield Index ³	(12,17 %)	3,46 % ²
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 16. Dez. 2013)	(8,05 %)	2,77 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 16. Dez. 2013)	(8,90 %)	1,82 %
Class E EUR (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 16. Dez. 2013)	(8,90 %)	1,82 %
Class T EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Sep. 2014)	(9,24 %)	0,60 %
Class T EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Sep. 2014)	(9,25 %)	0,61 %
75 % Bloomberg U.S. Aggregate Bond Index (EUR Hedged)/25 % MSCI ACWI High Dividend Yield Index (EUR Hedged) ³	(13,73 %)	2,17 % ²
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Jul. 2022)	—	(1,06 %)
75 % Bloomberg U.S. Aggregate Bond Index (GBP Hedged)/25 % MSCI ACWI High Dividend Yield Index (GBP Hedged) ³	—	(4,48 %)

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

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

³ Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Strategic Income Fund repräsentiert Folgendes: Von der Auflegung bis zum 26. Juli 2016: 75 % Bloomberg Global Aggregate Index Hedged USD / 25 % MSCI All Country World Index; vom 27. Juli 2016 bis zum 28. Juli 2022: 75 % Bloomberg Global Aggregate USD Hedged/25 % MSCI World Index; seit dem 29. Juli 2022: 75 % Bloomberg U.S. Aggregate Bond Index/25 % MSCI ACWI High Dividend Yield Index.

Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

Kommentare zum Fonds

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

Rentenbereich:

- » Ein Short-Engagement in britischer Duration trug zur absoluten Wertentwicklung bei, da die Zinsen im Vereinigten Königreich stiegen.
- » Ein Short-Engagement in japanischer Duration trug zur Wertentwicklung bei, da die Zinsen in Japan stiegen.
- » Long-Engagements gegenüber dem Brasilianischem Real trugen zur absoluten Wertentwicklung bei, da er gegenüber dem US-Dollar an Wert gewann.
- » Ein Long-Engagement in US-amerikanischer Duration schmälerte die absolute Wertentwicklung, da die US-Zinsen stiegen.
- » Beteiligungen an hochverzinslichen Unternehmensanleihen waren dem Ergebnis abträglich, da sich die Spreads auf diese Wertpapiere ausweiteten.
- » Positionen in Non-Agency-MBS waren der absoluten Wertentwicklung abträglich, da sich die Spreads auf diese Wertpapiere ausweiteten.

Aktienbereich:

- » Die Titelauswahl im Energiesektor trug zu den relativen Renditen bei, da die Positionen des Fonds im Energiesektor die Positionen der Benchmark im Energiesektor übertrafen.
- » Ein untergewichtetes Engagement und die Titelauswahl im Informationstechnologiesektor trugen zu den relativen Renditen bei, da der Sektor hinter dem Referenzindex zurückblieb und die Positionen des Fonds im Informationstechnologiesektor die Positionen des Referenzindex im Informationstechnologiesektor übertrafen.
- » Die Titelauswahl im Finanzsektor trug zu den relativen Renditen bei, da die Positionen des Fonds im Finanzsektor die Positionen der Benchmark im Finanzsektor übertrafen.
- » Das übergewichtete Engagement und die Titelauswahl im Sektor Kommunikationsdienstleistungen trugen zu den relativen Renditen bei, da der Sektor den Referenzindex übertraf und die Positionen des Fonds in Kommunikationsdienstleistungen die Positionen des Referenzindex in Kommunikationsdienstleistungen übertrafen.
- » Das untergewichtete Engagement und die Währungspositionierung im Gesundheitssektor belasteten die relative Rendite, da der Sektor den Referenzindex übertraf und die Währungsengagements des Fonds im Gesundheitssektor hinter den Währungsengagements des Referenzindex im Gesundheitssektor zurückblieben.
- » Das Engagement im Immobiliensektor beeinträchtigte die Renditen, da der Sektor negative Renditen lieferte.

Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2022 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 31. Jan. 1998)	(15,26 %)	4,35 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 25. Apr. 2000)	(15,27 %)	4,32 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 28. Jan. 1999)	(15,57 %)	3,79 %
Investor, ausschüttend (Auflegung: 23. Okt. 2000)	(15,55 %)	3,74 %
Administrative, thesaurierend (Auflegung: 16. Mai 2003)	(15,71 %)	2,85 %
Administrative, ausschüttend (Auflegung: 21. Juli 2022)	—	(4,02 %)
Class E, thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)	(16,03 %)	2,58 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 10. Okt. 2005)	(16,07 %)	2,49 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 15. Okt. 2002)	(15,39 %)	3,49 %
H Institutional, ausschüttend (Auflegung: 25. Mai 2018)	(15,40 %)	(0,04 %)
Class T, thesaurierend (Auflegung: 16. Okt. 2014)	(16,34 %)	(0,27 %)
Bloomberg U.S. Aggregate Index	(13,01 %)	3,93 % ²
Auf CAD lautende Klassen		
Institutional CAD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 02. Mai 2013)	(15,52 %)	0,69 %
Bloomberg U.S. Aggregate (CAD Hedged) Index	(13,39 %)	0,90 %
Auf CHF lautende Klassen		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 24. Jun. 2011)	(17,59 %)	(0,18 %)
Investor CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 24. Jun. 2011)	(17,89 %)	(0,53 %)
Class E CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 19. Sept. 2012)	(18,32 %)	(1,75 %)
Bloomberg U.S. Aggregate (CHF Hedged) Index	(15,62 %)	(0,15 %) ²
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Dez. 2003)	(17,20 %)	2,50 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Dez. 2005)	(17,20 %)	2,40 %
Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Dez. 2004)	(17,44 %)	2,01 %
Administrative EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 14. Okt. 2009)	(17,63 %)	0,61 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)	(17,89 %)	1,59 %
Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 07. Mrz. 2012)	(17,90 %)	(0,89 %)
Class R EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	(17,38 %)	(0,80 %)
Class T EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Sep. 2014)	(18,12 %)	(1,89 %)
Bloomberg U.S. Aggregate (EUR Hedged) Index	(15,19 %)	2,08 % ²
Auf EUR lautende Klassen (nicht abgesichert)		
Institutional EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 13. Jun. 2002)	(9,68 %)	3,06 %
Class E EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 03. Mrz. 2021)	(10,52 %)	(2,60 %)
Bloomberg U.S. Aggregate Index (EUR Unhedged) Index	(7,31 %)	2,73 % ²
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 26. Mrz. 2010)	(16,11 %)	1,60 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Dez. 2005)	(16,15 %)	3,21 %
Bloomberg U.S. Aggregate (GBP Hedged) Index	(14,06 %)	2,82 % ²
Auf HKD lautende Klassen		
Class E HKD (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 20. Feb. 2013)	(15,99 %)	0,14 %
M Retail HKD (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 20. Feb. 2013)	(15,97 %)	0,11 %
Bloomberg U.S. Aggregate (HKD Unhedged) Index	(12,91 %)	1,21 %
Auf SGD lautende Klassen		
Institutional SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 11. Jan. 2011)	(15,49 %)	1,65 %
Class E SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 15. Feb. 2007)	(16,22 %)	2,08 %
Bloomberg U.S. Aggregate (SGD Hedged) Index	(13,32 %)	2,61 % ²

Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

Kommentare zum Fonds

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

- » Ein Short-Engagement in britischer Duration leistete einen positiven Beitrag zur relativen Wertentwicklung, insbesondere zu Beginn des Jahres, als die Zinssätze stiegen.
- » Ein Short-Engagement bei japanischer Duration war der relativen Wertentwicklung zuträglich, da die Zinsen stiegen.
- » Es gab keine sonstigen Faktoren, die einen wesentlichen Beitrag zu diesem Teilfonds leisteten.
- » Eine Übergewichtung des Finanzsektors bei Unternehmensanleihen mit Investment Grade belastete die relative Wertentwicklung, da sich die Kreditspreads ausweiteten.
- » Zinsstrategien in der Eurozone, einschließlich der Instrumentenauswahl, schmälerten die relative Wertentwicklung, da sich die Swap-Spreads ausweiteten.
- » Das Engagement in hochverzinslichen Schuldtiteln war der relativen Wertentwicklung abträglich, da sich die Spreads insbesondere in der ersten Jahreshälfte ausweiteten.
- » Positionen in Non-Agency-MBS und anderen verbrieften Vermögenswerten schmälerten die relative Wertentwicklung, insbesondere im Mai, da sich die Spreads ausweiteten.
- » Eine Übergewichtung der US-Duration, insbesondere von Januar bis März, belastete die relative Wertentwicklung, da die Zinsen stiegen.

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

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

Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2022 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2015)	10,75 %	3,32 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 23. Sep. 2022)	—	(5,70 %)
Class E, thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2015)	9,68 %	2,21 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 23. Aug. 2022)	—	1,30 %
Class Z, thesaurierend (Auflegung 15. Dez. 2021)	12,36 %	11,28 %
ICE BofA SOFR Overnight Rate Index ³	1,78 %	1,29 % ²
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2015)	9,40 %	1,63 %
Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 23. Sep. 2022)	—	(6,10 %)
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung 30. Jun. 2015)	8,22 %	0,52 %
ICE BofA SOFR Overnight Rate Index (EUR Hedged) ³	(0,11 %)	(0,36 %) ²
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 18. Nov. 2022)	—	(1,20 %)
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 23. Sep. 2022)	—	(5,81 %)
ICE BofA SOFR Overnight Rate Index (GBP Hedged) ³	—	0,66 % ²

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

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

³ Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 30. Juni 2022: 3-Monats-USD-LIBOR Index; ab 1. Juli 2021: ICE BofA SOFR Overnight Rate Index.

Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

Kommentare zum Fonds

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

- » Short-Positionen im britischen Pfund Sterling, im chinesischen Yuan und im kanadischen Dollar leisteten einen positiven Beitrag zur Wertentwicklung, da die Preise im Vergleich zum US-Dollar zurückgingen.
- » Short-Positionen in britischen und US-amerikanischen Zinssätzen leisteten einen positiven Beitrag zur Wertentwicklung, da die Zinsen stiegen.
- » Die Positionierung in Indien, Polen und Tschechien belastete die Wertentwicklung aufgrund von Kursverlusten.
- » Die Positionierung bei indischen, brasilianischen und US-amerikanischen Aktienindizes belastete die Wertentwicklung aufgrund von Kursverlusten.

Durchschnittliche jährliche Gesamtertritte für den am 31. Dezember 2022 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 28. Sep. 2007)	(18,51 %)	4,04 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 08. Jul. 2016)	(18,56 %)	(0,36 %)
Class Z, thesaurierend (Auflegung: 20. Nov. 2019)	(18,12 %)	(4,94 %)
ICE BofA Merrill Lynch Sterling Non-Gilts Index	(17,75 %)	3,79 % ²

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

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

Kommentare zum Fonds

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

- » Die Titelauswahl im Bankensektor trug zur Wertentwicklung bei, da ausgewählte nachrangige Anleihen sehr gut abschnitten.
- » Die Untergewichtung und Titelauswahl im Transportsektor und insbesondere das fehlende Engagement in einem russischen Emittenten, der eine unterdurchschnittliche Entwicklung aufwies, trugen zur Wertentwicklung bei.
- » Die Übergewichtung und Titelauswahl bei Immobilieninvestmentgesellschaften und im Immobiliensektor beeinträchtigte die Wertentwicklung, da der Sektor hinter dem breiteren Markt zurückblieb.
- » Die Titelauswahl im Finanzunternehmenssektor war der Wertentwicklung abträglich, da sich ein ausgewählter übergewichtiger Emittent unterdurchschnittlich entwickelte.
- » Eine Untergewichtung des Versicherungssektors beeinträchtigte die Wertentwicklung, da dieser Sektor den Gesamtmarkt übertraf.

Durchschnittliche jährliche Gesamtertritte für den am 31. Dezember 2022 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2005)	(29,58 %)	3,93 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 14. Aug. 2008)	(29,54 %)	4,92 %
ICE BofA Merrill Lynch Sterling Non-Gilts 10+ Index ³	(30,00 %)	3,49 % ²

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

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

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

Kommentare zum Fonds

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

- » Makrostrategien und insbesondere eine Durationsuntergewichtung trugen zur Wertentwicklung bei, da die Zinsen während des Berichtszeitraums erheblich stiegen.
- » Eine Übergewichtung des Bankensektors, insbesondere in der zweiten Jahreshälfte, als sich der Sektor erholte, trug zur Wertentwicklung bei.
- » Eine Untergewichtung des Immobiliensektors trug zur Wertentwicklung bei, da der Sektor schlechter abschnitt als der Gesamtmarkt.
- » Die Titelauswahl im Bankensektor war der Wertentwicklung abträglich, da sich ein ausgewählter übergewichtiger Emittent unterdurchschnittlich entwickelte.
- » Die Übergewichtung und Titelauswahl bei Immobilieninvestmentgesellschaften (REITs) beeinträchtigte die Wertentwicklung, da sich ausgewählte übergewichtete Emittenten unterdurchschnittlich entwickelten.

Durchschnittliche jährliche Gesamtrendite für den am 31. Dezember 2022 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 28. Mai 1998)	(12,28 %)	5,32 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 23. Jan. 2001)	(12,20 %)	5,63 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 18. Mrz. 1999)	(12,58 %)	4,96 %
Investor, ausschüttend (Auflegung: 14. Jan. 1999)	(12,51 %)	4,94 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)	(13,04 %)	3,99 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 31. Jul. 2006)	(13,01 %)	4,06 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 15. Okt. 2002)	(12,44 %)	6,34 %
H Institutional, ausschüttend (Auflegung: 14. Feb. 2020)	(12,48 %)	(1,71 %)
M Retail, ausschüttend (Auflegung: 11. Jan. 2012)	(13,08 %)	3,56 %
Class R, thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	(12,48 %)	3,51 %
Class Z, thesaurierend (Auflegung: 29. Jun. 2016)	(11,76 %)	4,00 %
ICE BofA Merrill Lynch US High Yield Constrained Index ³	(11,24 %)	5,53 % ²
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 10. Apr. 2003)	(14,19 %)	4,68 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Dez. 2005)	(14,22 %)	3,88 %
Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 12. Feb. 2003)	(14,56 %)	4,61 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)	(14,95 %)	2,89 %
ICE BofA Merrill Lynch US High Yield Constrained Index (EUR Hedged) ³	(13,41 %)	5,37 % ²
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Sep. 2003)	(13,12 %)	5,26 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 22. Jun. 2016)	(13,13 %)	2,05 %
ICE BofA Merrill Lynch US High Yield Constrained Index (GBP Hedged) ³	(12,46 %)	5,76 % ²

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

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

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

Kommentare zum Fonds

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

- » Eine Untergewichtung des Einzelhandelssektors trug zur Wertentwicklung bei, da sich der Sektor unterdurchschnittlich entwickelte.
- » Die Titelauswahl im Luft- und Raumfahrt- sowie Verteidigungssektor trug zur Wertentwicklung bei, da ein ausgewählter Emittent sehr gut abschnitt.
- » Eine Übergewichtung im Gesundheitswesen schmälerte die Wertentwicklung, da sich der Sektor unterdurchschnittlich entwickelte.
- » Die Titelauswahl im Baustoffsektor war der Wertentwicklung abträglich, da sich ausgewählte übergewichtige Emittenten unterdurchschnittlich entwickelten.
- » Die Titelauswahl im bei nicht zyklischen Konsumgütern trug zur Wertentwicklung bei, da ein ausgewählter Emittent sehr gut abschnitt.

Durchschnittliche jährliche Gesamterrendite für den am 31. Dezember 2022 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 15. Sep. 2016)	(16,80 %)	0,85 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 15. Sep. 2016)	(16,85 %)	0,84 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 07. Nov. 2019)	(17,58 %)	(4,26 %)
Class E, ausschüttend (Auflegung: 08. Mrz. 2019)	(17,53 %)	(1,39 %)
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 23. Aug. 2022)	—	(2,80 %)
Bloomberg U.S. Credit Index	(15,26 %)	0,96 % ²
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 15. Sep. 2016)	(18,77 %)	(1,28 %)
Bloomberg U.S. Credit Index (EUR Hedged)	(17,54 %)	(1,19 %)
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 15. Sep. 2016)	(17,83 %)	(0,39 %)
Bloomberg U.S. Credit Index (GBP Hedged)	(16,46 %)	(0,22 %)

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

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

Kommentare zum Fonds

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

- » Makrostrategien, weil eine Durationsuntergewichtung zur Wertentwicklung beitrug.
- » Die Titelauswahl im Glücksspielsektor trug zur Wertentwicklung bei, da ausgewählte Emittenten sehr gut abschnitten.
- » Die Titelauswahl bei Auslandsschuldtiteln von Schwellenländern belastete die Wertentwicklung, da sich die Position in russischen Schuldtiteln unterdurchschnittlich entwickelte.
- » Die Titelauswahl im Bankensektor belastete die Wertentwicklung, da ein ausgewählter übergewichtiger Emittent nach der Ankündigung eines Restrukturierungsplans eine unterdurchschnittliche Entwicklung aufwies.
- » Die Übergewichtung und Titelauswahl bei Immobilieninvestmentgesellschaften beeinträchtigte die Wertentwicklung, da sich der Sektor unterdurchschnittlich entwickelte.

Durchschnittliche jährliche Gesamterträge für den am 31. Dezember 2022 abgelaufenen Berichtszeitraum¹

	1 Jahr	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2014)	0,00 %	1,51 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 11. Mai. 2020)	0,02 %	0,71 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2014)	(0,27 %)	1,16 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2014)	(0,45 %)	1,12 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 12. Dez. 2018)	(0,19 %)	1,02 %
Class Z, ausschüttend (Auflegung: 07. Aug. 2014)	0,46 %	1,98 %
FTSE 3-Month U.S. Treasury Bill Index	1,50 %	0,87 % ²
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 29. Jan. 2016)	(1,88 %)	(0,13 %)
Class E EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 08. Jun. 2016)	(2,35 %)	(0,70 %)
ICE BofA Merrill Lynch 3-Month U.S. Treasury Bill Index (EUR Hedged)	(0,53 %)	(0,80 %) ²

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

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

Kommentare zum Fonds

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

- » Positionen in Unternehmensanleihen mit Investment Grade trugen zur relativen Wertentwicklung bei, da die Erträge aus Unternehmensanleihen die Auswirkungen der Ausweitung der Kreditspreads ausglich.
- » Es gab keine sonstigen Faktoren, die einen wesentlichen Beitrag zu diesem Teilfonds leisteten.
- » Positionen in Agency-MBS war der relativen Wertentwicklung abträglich, da die Anlageklasse eine negative Gesamterträge lieferte.
- » Eine Übergewichtung in der US-Duration am vorderen Ende der US-Renditekurve schmälerte die relative Wertentwicklung, da die Zinsen am vorderen Ende der US-Strukturkurve stiegen.
- » Positionen in staatsnahen Wertpapieren waren der relativen Wertentwicklung abträglich, da die Anlageklasse eine negative Gesamterträge lieferte.

Beschreibungen der Vergleichsindizes

Offizieller Name des Vergleichsindex	Beschreibung des Index
1 Month NIBOR Rate Index	Der 1 Month NIBOR (Norwegian Interbank Offered Rate) Index ist ein durchschnittlicher Zinssatz, der von der Norges Bank bestimmt wird. Er leitet sich vom Zinssatz eines vergleichbaren Darlehens am US-Dollarmarkt zuzüglich des Zinssatzdifferentials zwischen der norwegischen Krone und dem US-Dollar am Devisenterminmarkt ab. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
jeweils 1/3 Bloomberg Global Aggregate Credit ex-Emerging Markets, ICE BofAML BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained ESG Tilt Index, JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index Global Diversified; alle abgesichert gegen USD	Der Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets Index bietet ein weites Vergleichsspektrum der globalen erstklassigen Rentenmärkte von Industrieländern. Der ICE BofAML BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained ESG Tilt Index bildet die Wertentwicklung von Unternehmensanleihen mit einem Rating unter Investment Grade von Emittenten nach, die in Industrieländern ansässig sind und ein Rating von BB1 bis B3 aufweisen, basierend auf einem Durchschnitt von Moody's, S&P und Fitch, und passt die Wertpapiergewichtungen an, um die Gesamtrisikoscores für Umwelt, Soziales und Unternehmensführung („ESG“) des Index zu verbessern. Der JP Morgan ESG Emerging Markets Bond Index Global Diversified bildet die Gesamtrenditen von auf US-Dollar lautenden Schuldinstrumenten nach, die von staatlichen und quasi-staatlichen Emittenten aus Schwellenländern begeben werden, und bezieht Umwelt-, Sozial- und Governance-Faktoren in die Indexkonstruktion ein.
jeweils 1/3 Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets (USD Hedged), ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index (USD Hedged) und JPMorgan EMBI Global (USD Hedged)	Der Bloomberg Global Aggregate Credit ex-Emerging Markets (USD Hedged) bietet ein weites Vergleichsspektrum der globalen erstklassigen Rentenmärkte von Industrieländern. ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index (USD Hedged) bildet die Wertentwicklung von Anleihen mit einer schlechteren Einstufung als Investment Grade der Emittenten von Industrieschuldverschreibungen nach, die ihren Firmensitz in Industrieländern haben, die über eine erstklassige Bewertung ausländischer langfristiger Währungsverbindlichkeiten verfügen (basierend auf einer Kombination aus Moody's, S&P sowie Fitch). Der Index enthält Anleihen, die auf US-Dollar, kanadische Dollar, Pfund Sterling und Euro (oder eine Euro-Vorgänger-Währung) lauten, schließt jedoch alle auf mehrere Währungen lautenden Anleihen aus. Die Anleihen müssen über eine Bewertung unter Investment Grade, jedoch mindestens über eine Einstufung von B3 basierend auf einer Kombination aus Moody's, S&P, sowie Fitch verfügen. Qualifizierte Anleihen werden anhand der Summe nach Marktkapitalisierung gewichtet, sofern die Gesamtallokation auf einen einzelnen Emittenten (definiert durch Bloomberg Ticker) nicht mehr als 2 % beträgt. Emittenten mit einem Anteil über dem Schwellenwert werden auf 2 % reduziert, und der Nennwert jeder einzelnen ihrer Anleihen wird proportional angepasst. Ebenso erhöht sich der Nennwert von Anleihen aller sonstigen Emittenten unter der 2%-Deckelung entsprechend proportional. Vor dem 25. September 2009 waren die ICE BofA Merrill Lynch Indizes als Merrill Lynch Indizes bekannt. Der JPMorgan EMBI Global (USD Hedged) bildet die absoluten Renditen der auf US-Dollar lautenden Schuldinstrumente ab, die von staatlichen sowie quasi-staatlichen Körperschaften aus Schwellenländern ausgegeben wurden, darunter verbriefte Forderungen aus Umschuldungen, Darlehen, Euro-Anleihen sowie lokale Marktinstrumente. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
3 Month HIBOR Index	Der 3 Month HIBOR (Hong Kong Interbank Offered Rate) Index ist ein Referenzzinssatz, der den durchschnittlichen Zinssatz abbildet, zu dem eine Reihe von Banken, die von der Hong Kong Association of Banks bestimmt wurden, bereit sind, sich untereinander unbesicherte Kredite zu verschiedenen Laufzeiten zu gewähren.
gewichtet nach 45 % Bloomberg Global Inflation Linked 1-30yrs Index (USD Hedged), 15 % JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (USD Unhedged), 20 % Bloomberg Commodity Total Return Index, 10 % FTSE NAREIT Global Real Estate Developed Total Return Index (USD Unhedged) und 10 % Bloomberg Gold Subindex Total Return Index (USD Hedged)	Der Referenzwert ist zusammengestellt aus 45 % Bloomberg Global Inflation Linked 1-30yrs Index (USD Hedged), 15 % JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (USD Unhedged), 20 % Bloomberg Commodity Total Return Index, 10 % FTSE NAREIT Global Real Estate Developed Total Return Index (USD Unhedged) und 10 % Bloomberg Gold Subindex Total Return Index (USD Hedged). Der Bloomberg Global Inflation Linked 1-30yrs Index misst die Wertentwicklung der führenden Märkte für inflationsgekoppelte Staatsanleihen aus Industrieländern. Er ist nach Marktkapitalisierung gewichtet und umfasst Laufzeiten bis zu 30 Jahren. Der JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus bildet die Gesamterträge für auf lokale Währungen lautende Geldmarktinstrumente in 24 Schwellenmarktländern nach. Der Bloomberg Commodity Total Return Index spiegelt die Rendite vollständig besicherter Positionen in den zugrundeliegenden Rohstoffterminkontrakten für eine Reihe physikalischer Rohstoffe wider. Der Index wurde als hoch liquider und diversifizierter Vergleichsindex für Rohstoffe als Vermögensklasse geschaffen. Der FTSE NAREIT Global Real Estate Developed Total Return Index ist ein um Streubesitz bereinigter, marktkapitalisierungsgewichteter Index, der darauf ausgelegt ist, die Wertentwicklung börsennotierter Immobilienunternehmen weltweit abzubilden. Der Bloomberg Gold Subindex Total Return Index spiegelt die Rendite vollständig besicherter Positionen in den zugrundeliegenden Rohstoffterminkontrakten wider. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht anlegen.
50 % JPMorgan EMBI Global Index / 50 % JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (USD) Unhedged	Der Vergleichsindex ist eine Mischung bestehend aus 50 % JPMorgan EMBI Global Index/50 % JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (USD Unhedged). Der JPMorgan EMBI Global Index bildet die absoluten Renditen der auf US-Dollar lautenden Schuldinstrumente ab, die von staatlichen sowie quasi-staatlichen Körperschaften aus Schwellenländern ausgegeben wurden, darunter verbriefte Forderungen aus Umschuldungen, Darlehen und Eurobonds. Der JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (USD Unhedged) ist ein umfassender, internationaler lokaler Schwellenmarktindex, der aus regelmäßig gehandelten, liquiden, festverzinslichen, auf Inlandswährungen lautenden Staatsanleihen besteht, an denen sich ausländische Anleger beteiligen können. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
60 % MSCI All Country World Index/40 % Bloomberg Global Aggregate (USD Hedged)	Der Vergleichsindex ist eine Mischung bestehend aus 60 % MSCI All Country World Index (ACWI) und 40 % Bloomberg Global Aggregate (USD Hedged) Index. Der MSCI All Country World Index ist ein um Streubesitz bereinigter, marktkapitalisierungsgewichteter Index, der dazu gedacht ist, die Wertentwicklung der Aktienmärkte in Industrie- und Schwellenländern zu messen. Der Index besteht aus 47 Länderindizes, von denen 23 Indizes von Industrieländern und 23 Indizes von Schwellenländern sind. Der Bloomberg Global Aggregate (USD Hedged) Index bietet ein weites Vergleichsspektrum der internationalen Rentenmärkte der Kategorie Investment Grade. Die drei Hauptkomponenten dieses Index sind der U.S. Aggregate Index, der Pan-European Aggregate Index sowie der Asian-Pacific Aggregate Index. Des Weiteren beinhaltet der Index Eurodollar- sowie Euro-Yen-Industrieschuldverschreibungen, kanadische Staatsanleihen und US-Dollar-144A-Wertpapiere der Kategorie Investment Grade. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.

Beschreibungen der Vergleichsindizes (Forts.)

Offizieller Name des Vergleichsindex	Beschreibung des Index
75 % Bloomberg U.S. Aggregate Bond Index/25 % MSCI ACWI High Dividend Yield Index	Der MSCI ACWI High Dividend Yield Index basiert auf dem MSCI ACWI (EUR Hedged), seinem Hauptindex, und umfasst Aktien mit hoher und mittlerer Marktkapitalisierung aus 23 Industrieländern und 24 Schwellenländern. Der Index soll die Wertentwicklung von Aktien im Hauptindex (mit Ausnahme von REITs) mit höheren Dividendenträgen und Qualitätsmerkmalen als durchschnittliche Dividendenrenditen widerspiegeln, die sowohl nachhaltig als auch beständig sind. Der Index verwendet auch Qualitätsüberprüfungen und prüft die Wertentwicklung in den vergangenen 12 Monaten, um Aktien mit sich möglicherweise verschlechternden Fundamentaldaten, die sie zu einer Streichung oder Kürzung von Dividenden zwingen könnten, auszuschließen. Der Bloomberg U.S. Aggregate (EUR Hedged) Index bildet Wertpapiere ab, die bei der SEC registriert und steuerpflichtig sind sowie auf Dollar lauten. Der Index deckt den erstklassigen US-Festzinsanleihemarkt ab und beinhaltet Indexkomponenten für Staatstitel sowie Industrieschuldverschreibungen, Hypotheken-Durchlauf-Wertpapiere sowie forderungsbesicherte Wertpapiere. Diese Hauptsektoren unterteilen sich in spezifischere Indizes, die regelmäßig berechnet und veröffentlicht werden. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
Alerian MLP Index	Der Alerian MLP Index ist der führende Maßstab für Master Limited Partnership (MLPs) aus dem Energiesektor mit hoher und mittlerer Marktkapitalisierung. Es handelt sich um einen um Streubesitz bereinigten, marktkapitalisierungsgewichteten Index, der 50 führende Unternehmen umfasst.
Bloomberg AusBond Bank Bills Index	Der Bloomberg AusBond Bank Bills Index ist ein nicht verwalteter Index, der die Gesamtertragsleistung australischer Geldmarktpapiere abbildet. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
Bloomberg Commodity Index Total Return	Der Bloomberg Commodity Index Total Return ist ein nicht verwalteter Index aus Terminkontrakten auf eine Reihe physischer Rohstoffe. Der Index wurde als hoch liquider und diversifizierter Vergleichsindex für Rohstoffe als Vermögensklasse geschaffen. Die Futures-Engagements der Benchmark sind durch US-Schatzwechsel besichert. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
Bloomberg Euro Aggregate 1-10 Year Bond Index	Der Bloomberg Euro Aggregate 1-10 Year Bond Index repräsentiert die Euro Aggregate 1-10-Jahreskomponente des Bloomberg Pan-European Aggregate Index. Der Bloomberg Euro-Aggregate Index besteht aus Anleihen, die in Euro oder den Euro-Vorgängerwährungen der 17 eigenstaatlichen Länder ausgegeben wurden, die an der Europäischen Währungsunion (EWU) teilnehmen. Bei allen Emissionen muss es sich um festverzinsliche Wertpapiere der Kategorie Investment Grade mit einer Restlaufzeit von mindestens einem Jahr handeln. Der Euro-Aggregate Index schließt wandelbare Wertpapiere, variabel verzinsliche Wechsel, Annuitätswechsel, Optionsscheine, gebundene Anleihen und strukturierte Produkte aus. Deutsche Schuldscheine (Quasi-Darlehens-Papiere) sind aufgrund ihrer Handelsbeschränkungen und ihres nicht notierten Status, der zu Illiquidität führt, ebenfalls ausgeschlossen. Das Emissionsland zählt nicht zu den Indexkriterien, und Wertpapiere von Emittenten außerhalb der Eurozone sind inbegriffen, wenn sie die Indexkriterien erfüllen. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
Bloomberg Euro-Aggregate Credit Index	Der Bloomberg Euro-Aggregate Credit Index ist die Anleihekomponekte des Bloomberg Euro-Aggregate Index. Der Bloomberg Euro-Aggregate Index besteht aus Anleihen, die in Euro oder den Euro-Vorgängerwährungen der 17 eigenstaatlichen Länder ausgegeben wurden, die an der Europäischen Währungsunion (EWU) teilnehmen. Bei allen Emissionen muss es sich um festverzinsliche Wertpapiere der Kategorie Investment Grade mit einer Restlaufzeit von mindestens einem Jahr handeln. Der Euro-Aggregate Index schließt wandelbare Wertpapiere, variabel verzinsliche Wechsel, Annuitätswechsel, Optionsscheine, gebundene Anleihen und strukturierte Produkte aus. Deutsche Schuldscheine (Quasi-Darlehens-Papiere) sind aufgrund ihrer Handelsbeschränkungen und ihres nicht notierten Status, der zu Illiquidität führt, ebenfalls ausgeschlossen. Das Emissionsland zählt nicht zu den Indexkriterien, und Wertpapiere von Emittenten außerhalb der Eurozone sind inbegriffen, wenn sie die Indexkriterien erfüllen. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
Bloomberg Euro Government (Germany, France, Netherlands) over 15 years Index	Der Bloomberg Euro Government (Deutschland, Frankreich, Niederlande) +15 Jahre Index repräsentiert Staatsanleihen aus Deutschland, Frankreich und den Niederlanden mit einer Laufzeit von über 15 Jahren und ist Komponente des Bloomberg Euro-Aggregate Index. Dieser besteht wiederum aus Anleihen, die in Euro oder Altwährungen von 17 Mitgliedstaaten der Europäischen Währungsunion (EWU) begeben wurden. Bei allen Emissionen muss es sich um festverzinsliche Wertpapiere der Kategorie Investment Grade mit einer Restlaufzeit von mindestens einem Jahr handeln. Der Euro-Aggregate Index schließt wandelbare Wertpapiere, variabel verzinsliche Wechsel, Annuitätswechsel, Optionsscheine, gebundene Anleihen und strukturierte Produkte aus. Deutsche Schuldscheine (Quasi-Darlehens-Papiere) sind aufgrund ihrer Handelsbeschränkungen und ihres nicht notierten Status, der zu Illiquidität führt, ebenfalls ausgeschlossen. Das Emissionsland zählt nicht zu den Indexkriterien, und Wertpapiere von Emittenten außerhalb der Eurozone sind inbegriffen, wenn sie die Indexkriterien erfüllen.
Bloomberg Global Aggregate (USD Hedged) Index	Der Bloomberg Global Aggregate (USD Hedged) Index bietet ein weites Vergleichsspektrum der internationalen Rentenmärkte der Kategorie Investment Grade. Die drei Hauptkomponenten dieses Index sind der U.S. Aggregate Index, der Pan-European Aggregate Index sowie der Asian-Pacific Aggregate Index. Des Weiteren beinhaltet der Index Eurodollar- sowie Euro-Yen-Industrieschuldverschreibungen, kanadische Staatsanleihen und US-Dollar-144A-Wertpapiere der Kategorie Investment Grade. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
Bloomberg Global Aggregate Credit 1-5 Years Index (USD Hedged)	Bei dem Bloomberg Global Aggregate Credit Index 1-5 Years Index (USD Hedged) handelt es sich um einen nicht gemanagten Index, der ein weites Vergleichsspektrum für die internationalen Rentenmärkte der Kategorie Investment Grade mit einer Laufzeit von mindestens einem 1 Jahr und weniger als 5 Jahren bietet. Die drei Hauptkomponenten dieses Index sind der U.S. Aggregate Index, der Pan-European Aggregate Index sowie der Asian-Pacific Aggregate Index. Dieser Index schließt Staatstitel und verbriefte Wertpapiere aus. Des Weiteren beinhaltet der Index Eurodollar- sowie Euro-Yen-Industrieschuldverschreibungen, kanadische Wertpapiere und US-Dollar-144A-Wertpapiere der Kategorie Investment Grade.

Offizieller Name des Vergleichsindex	Beschreibung des Index
Bloomberg Global Aggregate Credit Index (USD Hedged)	Bei dem Bloomberg Global Aggregate Credit-Index (USD Hedged) handelt es sich um einen nicht gemanagten Index, der ein weites Vergleichsspektrum für die internationalen Rentenmärkte der Kategorie Investment Grade bietet. Die drei Hauptkomponenten dieses Index sind der U.S. Aggregate Index, der Pan-European Aggregate Index sowie der Asian-Pacific Aggregate Index. Dieser Index schließt Staatstitel und verbriefte Wertpapiere aus. Des Weiteren beinhaltet der Index Eurodollar- sowie Euro-Yen-Industrieschuldverschreibungen, kanadische Wertpapiere und US-Dollar-144A-Wertpapiere der Kategorie Investment Grade. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
Bloomberg Global Aggregate ex-USD (USD Hedged) Index	Der Bloomberg Global Aggregate ex-USD (USD Hedged) Index bietet ein weites Vergleichsspektrum der internationalen Rentenmärkte der Kategorie Investment Grade. Die drei Hauptkomponenten dieses Index sind der U.S. Aggregate Index, der Pan-European Aggregate Index sowie der Asian-Pacific Aggregate Index. Der Index enthält auch Eurodollar- und Euro-Yen-Unternehmensanleihen, kanadische Staats-, Agency- und Unternehmenswertpapiere sowie auf USD lautende 144A-Wertpapiere mit Investment-Grade-Rating.
Bloomberg MSCI Green Bond Index (USD Hedged)	Der Bloomberg MSCI Green Bond Index, USD Hedged bietet Anlegern ein objektives und robustes Maß für den globalen Markt für festverzinsliche Wertpapiere, die zur Finanzierung von Projekten mit direktem Umweltnutzen ausgegeben werden. Es wird eine unabhängige, analysegestützte Methodik verwendet, um indexfähige grüne Anleihen zu bewerten und sicherzustellen, dass sie die etablierten Green-Bond-Prinzipien einhalten, und um die Anleihen nach der umweltfreundlichen Verwendung ihrer Erlöse zu klassifizieren. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
Bloomberg U.S. Aggregate Index	Der Bloomberg U.S. Aggregate Index bildet Wertpapiere ab, die bei der SEC registriert und steuerpflichtig sind sowie auf Dollar lauten. Der Index deckt den erstklassigen US-Festzinsanleihemarkt ab und beinhaltet Indexkomponenten für Staatstitel sowie Industrieschuldverschreibungen, Hypotheken-Durchlauf-Wertpapiere sowie forderungsbesicherte Wertpapiere. Diese Hauptsektoren unterteilen sich in spezifischere Indizes, die regelmäßig berechnet und veröffentlicht werden. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
Bloomberg U.S. Aggregate 1-3 Years Index	Der Bloomberg U.S. Aggregate 1-3 Years Index bildet Wertpapiere ab, die bei der SEC registriert und steuerpflichtig sind, auf US-Dollar lauten und eine Laufzeit zwischen ein und drei Jahren haben. Der Index deckt den erstklassigen US-Festzinsanleihemarkt ab und beinhaltet Indexkomponenten für Staatstitel sowie Industrieschuldverschreibungen, Hypotheken-Durchlauf-Wertpapiere sowie forderungsbesicherte Wertpapiere. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
Bloomberg U.S. Credit Index	Bei dem Bloomberg U.S. Credit Index handelt es sich um einen nicht gemanagten Index, der aus öffentlich begebenen Schuldverschreibungen von Unternehmen und bestimmten nicht US-amerikanischen Emittenten sowie besicherten Anleihen besteht, die bestimmten Anforderungen in Bezug auf Laufzeit, Liquidität und Qualität entsprechen. Um für den Index in Frage zu kommen, müssen die Anleihen bei der SEC registriert sein. Dieser Index wurde zuvor als Bloomberg Credit Investment Grade Index bezeichnet. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond (USD Hedged) Index	Der Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond (USD Hedged) Index misst die Wertentwicklung der führenden Märkte für inflationsgekoppelte Staatsanleihen. Der Index umfasst von den folgenden Ländern emittierte, inflationsgekoppelte Schuldtitel: Australien, Kanada, Frankreich, Schweden, das Vereinigte Königreich und die USA. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond 1-5 Year Index (USD Hedged)	Bei dem Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond 1-5 Year Index (USD Hedged) handelt es sich um einen Index, der die Wertentwicklung der weltweiten Märkte für inflationsgekoppelte Staatsanleihen mit einer Laufzeit von mindestens 1 Jahr und weniger als 5 Jahren misst. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
Canadian Overnight Repo Rate (CORRA)	Der Canadian Overnight Repo Rate (CORRA) misst die Kosten für die Finanzierung von allgemeinen Tagesgeldern mit Besicherung in kanadischen Dollar, wobei Staatsanleihen und Anleihen der kanadischen Regierung als Sicherheit für Pensionsgeschäfte verwendet werden.
Euro Short-Term Rate (ESTER) Index	ESTER spiegelt die Kosten für unbesicherte Euro-Übernachtungskredite von Banken im Euroraum wider. ESTER wird an jedem Tag veröffentlicht, an dem das Trans-European Automated Real-time Gross Settlement Express Transfer-Zahlungssystem (oder ein Nachfolgesystem) für die Abwicklung von Zahlungen in Euro geöffnet ist. ESTER beruht auf Transaktionen, die am vorangegangenen Geschäftstag (dem Stichtag „T“) mit einer Fälligkeit von T+1 durchgeführt und abgewickelt wurden und von denen angenommen wird, dass sie zu marktüblichen Bedingungen ausgeführt wurden, so dass sie die Marktzinsen unverzerrt widerspiegeln.
FTSE 3-Month U.S. Treasury Bill Index	Bei dem FTSE 3-Month U.S. Treasury Bill Index handelt es sich um einen nicht gemanagten Index, der die monatliche Ertrags-Äquivalente der Renditedurchschnitte der US-Schatzwechselemissionen der vergangenen drei Monate repräsentiert. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
FTSE Euro Broad Investment-Grade Index	Bei dem FTSE Euro Broad Investment Grade Index handelt es sich um einen Index des auf Euro basierenden Rentenmarkts der Kategorie Investment Grade, der institutionellen Anlegern (in Euro) zugänglich ist. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
ICE BofA Merrill Lynch 1-3 Year U.S. Treasury Index	Bei dem ICE BofA Merrill Lynch 1-3 Year US Treasury Index handelt es sich um einen nicht gemanagten Index, der US Treasuries (ausgenommen inflationsbesicherte Wertpapiere und STRIPS) mit mindestens 1 Milliarde USD umlaufendem Nennwert und einer Restlaufzeit bis zur endgültigen Fälligkeit von mindestens einem und weniger als drei Jahren enthält. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.

Beschreibungen der Vergleichsindizes (Forts.)

Offizieller Name des Vergleichsindex	Beschreibung des Index
ICE BofA Merrill Lynch 3-Month U.S. Treasury Bill Index (EUR Hedged)	Der ICE BofA Merrill Lynch 3-Month U.S. Treasury Bill Index (EUR Hedged) umfasst eine einzige Emission, die zu Monatsbeginn gekauft und für einen vollen Monat gehalten wird. Am Monatsende wird diese Emission verkauft und in eine neu ausgewählte Emission angelegt. Die bei der Neugewichtung am Monatsende jeweils gewählte Emission ist der ausstehende Schatzwechsel, dessen Fälligkeitstermin am nächsten am Datum der Neugewichtung liegt, wobei er jedoch nicht mehr als drei Monate nach diesem Datum liegen darf. Um für die Wahl berücksichtigt zu werden, muss eine Emission am oder vor dem Neugewichtungsdatum am Monatsende abgewickelt worden sein. Der Index hält zwar oft den im Rahmen der jüngsten 3-Monats-Auktion ausgegebenen Schatzwechsel, es kann jedoch auch ein älterer 6-Monats-Wechsel gewählt werden.
ICE BofA Merrill Lynch BB-B European Currency High Yield Constrained Index	Der Index ist so konzipiert, dass er die Wertentwicklung von auf EUR und GBP lautenden Unternehmensanleihen mit einem Rating unterhalb von Investment Grade abbildet, die auf den Eurobond-, GBP- oder EUR-Inlandsmärkten öffentlich begeben wurden. Um für eine Aufnahme in den Index in Frage zu kommen, müssen die Anleihen über eine Bewertung unter Investment Grade, jedoch mindestens über eine Einstufung von B3 basierend auf einem Durchschnitt aus Moody's, S&P sowie Fitch verfügen. Das Engagement gegenüber einzelnen Emittenten im Index ist auf 3 % beschränkt. Nähere Einzelheiten zum Index, einschließlich einer aktuellen Beschreibung seiner Duration, sind auf Anfrage von der Anlageberatungsgesellschaft erhältlich.
ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index Hedged into USD	Der ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index Hedged into USD bildet die Wertentwicklung von Anleihen mit einer schlechteren Einstufung als Investment Grade der Emittenten von Industrieschuldverschreibungen nach, die ihren Firmensitz in Industrieländern haben, die über eine erstklassige Bewertung ausländischer langfristiger Verbindlichkeiten verfügen (basierend auf einer Kombination aus Moody's, S&P sowie Fitch). Der Index beinhaltet auf US-Dollar, kanadische Dollar, Pfund Sterling und Euro (oder eine Euro-Vorgänger-Währung) lautende Anleihen, schließt jedoch alle auf mehrere Währungen lautenden Anleihen aus. Die Anleihen müssen über eine Bewertung unter Investment Grade, jedoch mindestens über eine Einstufung von B3 basierend auf einer Kombination aus Moody's, S&P, sowie Fitch verfügen. Qualifizierte Anleihen müssen kapitalisierungsgewichtet sein, wobei die Gesamtallokation für einen einzelnen Emittenten (vorgegeben durch Bloomberg Tickers) unter 2 % liegen muss. Emittenten mit einem Anteil über dem Schwellenwert werden auf 2 % reduziert, und der Nennwert jeder einzelnen ihrer Anleihen wird proportional angepasst. Ebenso erhöht sich der Nennwert von Anleihen aller sonstigen Emittenten unter der 2%-Deckelung entsprechend proportional. Vor dem 25. September 2009 waren die ICE BofA Merrill Lynch-Indizes als Merrill-Lynch-Indizes bekannt.
ICE BofA Merrill Lynch Sterling Non-Gilts 10+ Index	Der ICE BofA Merrill Lynch Sterling Non-Gilts 10+ Index besteht aus auf Pfund Sterling lautenden Anleihen der Kategorie Investment Grade; ausgenommen sind auf Sterling lautende, von der britischen Regierung begebene Anleihen. Alle im Index vertretenen Anleihen müssen von mindestens einer der großen Ratingagenturen als Anlagen von Investment-Grade eingestuft werden. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
ICE BofA Merrill Lynch Sterling Non-Gilts Index	Der ICE BofA Merrill Lynch Sterling Non-Gilts Index bildet die Wertentwicklung von auf Pfund Sterling lautenden erstklassigen öffentlichen Schuldtiteln von Unternehmens- und quasistaatlichen Emittenten sowie Emittenten außerhalb des Vereinigten Königreichs ab. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
ICE BofA Merrill Lynch U.S. High Yield Constrained Index	Der ICE BofA Merrill Lynch US High Yield Constrained Index bildet die Wertentwicklung von auf US-Dollar lautenden Unternehmensanleihen mit einer schlechteren Einstufung als Investment Grade ab, die am US-Inlandsmarkt öffentlich emittiert werden. Um für eine Aufnahme in den Index in Frage zu kommen, müssen Wertpapiere über ein Rating unterhalb von Investment Grade (basierend auf dem Durchschnitt von Moody's, S&P sowie Fitch) und ein Risikoland mit Investment Grade-Rating (basierend auf dem Durchschnitt von Moody's, S&P sowie Fitch für auf Fremdwährung lautende Staatsanleihen mit langer Laufzeit) verfügen.
ICE BofA SARON Overnight Rate Index	Der ICE BofA SARON Overnight Rate Index bildet die Wertentwicklung eines synthetischen Vermögenswerts nach, der bis zu einer angegebenen Fälligkeit den SARON zahlt. Der Index basiert auf dem angenommenen Kauf eines synthetischen Instruments zum Nennwert, das genau seine angegebene Laufzeit aufweist und dessen Kupon dem Fixing-Satz dieses Tages entspricht. Es wird davon ausgegangen, dass diese Emission am folgenden Geschäftstag verkauft wird (mit einer Rendite, die dem Fixing-Kurs des aktuellen Tages entspricht) und in ein neues Instrument umgeschichtet wird.
ICE BofA SOFR Overnight Rate Index	Der ICE BofA SOFR Overnight Rate Index bildet die Wertentwicklung eines synthetischen Vermögenswerts nach, der bis zu einer angegebenen Fälligkeit den SOFR zahlt. Der Index basiert auf dem angenommenen Kauf eines synthetischen Instruments zum Nennwert, das genau seine angegebene Laufzeit aufweist und dessen Kupon dem Fixing-Satz dieses Tages entspricht. Es wird davon ausgegangen, dass diese Emission am folgenden Geschäftstag verkauft wird (mit einer Rendite, die dem Fixing-Kurs des aktuellen Tages entspricht) und in ein neues Instrument umgeschichtet wird. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
ICE BofA SONIA Overnight Rate Index	Der ICE BofA SONIA Overnight Rate Index bildet die Wertentwicklung eines synthetischen Vermögenswerts nach, der bis zu einer angegebenen Fälligkeit den SONIA zahlt. Der Index basiert auf dem angenommenen Kauf eines synthetischen Instruments zum Nennwert, das genau seine angegebene Laufzeit aufweist und dessen Kupon dem Fixing-Satz dieses Tages entspricht. Es wird davon ausgegangen, dass diese Emission am folgenden Geschäftstag verkauft wird (mit einer Rendite, die dem Fixing-Kurs des aktuellen Tages entspricht) und in ein neues Instrument umgeschichtet wird.
JPMorgan Asia Credit Index	Der JPMorgan Asia Credit Index misst die Wertentwicklung des asiatischen Marktes für auf USD lautende Anleihen ohne Japan. Der Index liefert einen Referenzwert für Anlagegelegenheiten in auf US-Dollar lautenden festverzinslichen Instrumenten, die von staatlichen, quasi-staatlichen und halbstaatlichen Emittenten aus Asien (ohne Japan) begeben werden.
JPMorgan Corporate Emerging Markets Bond Index Diversified (CEMBI)	Bei dem JPMorgan Corporate Emerging Markets Bond Index Diversified (CEMBI) handelt es sich um eine besondere, gewichtete Version des CEMBI-Index. Er beschränkt den Anteil der Indexländer mit umfangreicheren Industrieschuldverschreibungen, indem er nur einen bestimmten Anteil des aktuell bankfähigen Nennwerts der Schulden dieser Länder einbezieht. Der CEMBI Diversified führt zu gut verteilten, ausgeglicheneren Gewichtungen für die im Index enthaltenen Länder. Die vom CEMBI Diversified abgedeckten Länder sind mit den vom CEMBI abgedeckten identisch. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (Unhedged)	Der JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (Unhedged) bildet die Gesamterträge für auf lokale Währungen lautende Geldmarktinstrumente in 22 Schwellenmarktländern mit mindestens 10 Milliarden USD Außenhandel nach. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.

Offizieller Name des Vergleichsindex	Beschreibung des Index
JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global	Der JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global bildet die Gesamterträge der auf US-Dollar lautenden Schuldinstrumente ab, die von staatlichen sowie quasi-staatlichen Körperschaften aus Schwellenländern ausgeben wurden.
JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified	Der JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index Global Diversified bildet die Gesamterträge von auf US-Dollar lautenden Schuldinstrumenten nach, die von staatlichen und quasi-staatlichen Emittenten aus Schwellenländern begeben werden, und bezieht Umwelt-, Sozial- und Governance-Faktoren in die Indexkonstruktion ein.
JPMorgan ESG Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index	Der JPMorgan ESG GBI-EM Global Diversified (JESG GBI-EM) bildet die Wertentwicklung von Anleihen nach, die von Regierungen von Schwellenländern begeben werden und auf die lokale Währung des Emittenten lauten. Der Index wendet eine ESG-Bewertungs- und -Screening-Methode an, um Emittenten mit höherer Einstufung in Bezug auf ESG-Kriterien und Green-Bond-Emissionen zu bevorzugen, und niedriger eingestufte Emittenten geringer zu gewichten oder auszulassen.
JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (Unhedged)	Der JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (Unhedged) ist ein umfassender, internationaler lokaler Schwellenmarktindex, der aus regelmäßig gehandelten, liquiden, festverzinslichen, auf Inlandswährungen lautenden Staatsanleihen besteht, an denen sich ausländische Anleger beteiligen können. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
JPMorgan JACI Composite Total Return (EUR Hedged)	Der JPMorgan Asia Credit Index (EUR) misst die Wertentwicklung des asiatischen Marktes für auf USD lautende Anleihen ohne Japan. Der Index liefert einen Referenzwert für Anlagegelegenheiten in auf US-Dollar lautenden festverzinslichen Instrumenten, die von staatlichen, quasi-staatlichen und halbstaatlichen Emittenten aus Asien (ohne Japan) begeben werden.
JPMorgan JACI Non-Investment Grade	Der JPMorgan JACI Non-IG umfasst festverzinsliche, auf U.S.-Dollar lautende hochverzinsliche Anleihen, die von Staaten, quasi-staatlichen Stellen, Banken und Unternehmen in Asien begeben wurden. Der bestehende JACI Non-IG enthält sowohl fest- als auch variabel verzinsliche Anleihen, die von in Asien ansässigen Körperschaften begeben wurden und einen ausstehenden Nennbetrag von mindestens 150 Mio. USD sowie eine Restlaufzeit von mehr als einem Jahr aufweisen.
PIMCO Global Advantage Bond Index (GLADI) (London Close)	Der PIMCO Global Advantage Bond Index (GLADI) (London Close) ist ein diversifizierter globaler Index, der ein breites Spektrum von Gelegenheiten bei internationalen Rentenpapieren und Sektoren, von Industrieländern zu Schwellenmärkten, nominalem zu realem Vermögen, sowie von Barmitteln zu derivativen Instrumenten abdeckt. Abweichend von den herkömmlichen Indizes, die häufig aus Anleihen bestehen, die entsprechend ihrer Marktkapitalisierung gewertet werden, verwendet der GLADI eine BIP-Gewichtung, die sich auf schneller wachsende Gebiete der Welt konzentriert und so dem Index einen auf die Zukunft ausgerichteten Charakter verleiht. PIMCOs GLADI-Methode ist geistiges Eigentum, das durch das US-Patent Nr. 8.306.892 geschützt ist. GLOBAL ADVANTAGE und GLADI sind Markenzeichen von Pacific Investment Management Company LLC.
S&P 500 Index	Der S&P 500 ist ein nicht gemanagter Marktindex, der allgemein als repräsentativ für den Aktienmarkt insgesamt gilt. Der Index konzentriert sich auf das Large Cap-Segment des US-Aktienmarkts. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
SHIR Shekel Overnight Risk Free Rate	Dieser Index speichert den Shekel-Tagesgeldsatz und entspricht dem Zinssatz der Bank of Israel. Außer an Tagen, an denen der SHIR nicht veröffentlicht wird, wird sein Wert dem Wert entsprechen, den er am letzten Tag der Veröffentlichung hatte. Der Zinssatz der Bank of Israel wird vom Monetary Committee der Bank of Israel acht Mal im Jahr festgelegt, in der Regel montags um 16:00 Uhr. Die Daten der Veröffentlichung und Anwendung der Zinssätze der Bank of Israel werden jährlich auf der Website der Bank of Israel veröffentlicht. Der SHIR wird täglich bis 11:00 Uhr auf der Website der Bank of Israel veröffentlicht, mit Ausnahme von Samstagen, Sonntagen. Außerdem werden jährlich zusätzlichen Daten auf der Website der Bank of Israel veröffentlicht. Diese Daten werden regelmäßig aktualisiert. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
SORA Singapore Interbank Overnight Rate Average	Der Singapore Overnight Rate Average (SORA) ist der volumengewichtete durchschnittliche Zinssatz für Kreditgeschäfte auf dem unbesicherten Tagesgeldmarkt im SGD in Singapur.

Finanzstatus

(Angaben in Tausend)	PIMCO Asia High Yield Bond Fund		Asia Strategic Interest Bond Fund	
	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
Aktiva:				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes				
Finanzvermögen:				
Übertragbare Wertpapiere	\$ 2.652.171	\$ 2.901.911	\$ 276.959	\$ 321.481
Investmentfonds	239.979	330.471	29.746	33.109
Pensionsgeschäfte	20.572	178.712	820	837
Einlagen bei Kreditinstituten	0	0	0	0
Finanzderivate	54.267	21.279	3.700	2.359
Zahlungsmittel	0	1.077	546	406
Einlagen bei Kontrahenten	34.314	29.134	2.017	1.928
Forderungen aus Einkünften	48.231	49.574	3.836	3.671
Forderungen aus verkauften Anlagen	18.600	2.394	0	0
Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen	0	0	0	0
Forderungen aus verkauften Fondsanteilen	5.111	3.765	119	276
Forderungen aus Derivate-Gewinnen	14.965	0	1.946	348
Sonstige Aktiva	0	0	0	0
Summe Aktiva	3.088.210	3.518.317	319.689	364.415
Passiva:				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete				
Finanzverbindlichkeiten:				
Finanzderivate	(27.401)	(7.650)	(1.065)	(1.643)
Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen	(3.578)	(35.667)	0	(520)
Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen	(11.061)	(1.141)	(76)	(40)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr	(1.671)	(1.879)	(164)	(177)
Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften	0	(48.848)	0	(1.024)
Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Aufwendungen	(41)	(111)	0	0
Überziehungskredit	(13.527)	0	0	0
Zu zahlende Dividende	(161)	(441)	0	0
Verbindlichkeiten aus Derivatemargen	(25.632)	(1.505)	(1.842)	0
Einlagen von Kontrahenten	(23.746)	(9.152)	(2.555)	0
Sonstige Verbindlichkeiten	0	0	0	0
Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber	(106.818)	(106.394)	(5.702)	(3.404)
Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber	\$ 2.981.392	\$ 3.411.923	\$ 313.987	\$ 361.011

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

PIMCO Capital Securities Fund		PIMCO Climate Bond Fund		Commodity Real Return Fund		PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	
Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
\$ 6.129.600	\$ 8.423.010	\$ 248.281	\$ 321.810	\$ 1.750.918	\$ 1.554.523	\$ 80.195	\$ 123.472
140	481.206	0	0	120	18	9.649	13.600
10.172	62.523	36.800	0	59.113	2.098	6.910	1.827
0	0	0	0	0	0	0	0
107.561	74.595	8.236	5.077	45.313	69.845	2.563	1.325
2.624	6.410	1.484	1.636	4.491	4.953	177	399
110.882	132.617	8.041	2.349	39.055	10.065	1.533	1.806
66.969	76.123	2.192	2.026	4.250	2.590	1.002	964
33.701	0	0	0	50.448	55	206	66
0	0	0	0	206.413	30.489	1.296	205
3.060	10.758	363	473	5.062	3.576	138	1
54.526	0	1.167	0	17.822	724	1.075	563
0	0	0	0	0	0	0	0
6.519.235	9.267.242	306.564	333.371	2.183.005	1.678.936	104.744	144.228
(86.485)	(60.447)	(5.599)	(516)	(50.044)	(14.384)	(2.137)	(1.331)
0	0	0	0	0	0	0	0
(1)	(17.037)	0	0	0	(495)	(304)	(2.056)
0	0	0	0	(288.321)	(52.442)	(3.587)	(409)
(7.922)	(3.567)	(193)	(38)	(3.460)	(812)	(50)	(600)
(4.729)	(7.145)	(145)	(159)	(1.261)	(1.257)	(89)	(124)
(578.475)	(23.339)	0	0	(425.302)	(22.915)	0	0
0	0	0	0	(17.959)	(80.800)	0	0
(237)	(798)	(24)	(11)	(15)	(19)	0	(4)
0	0	0	0	0	0	0	0
(906)	(1.313)	(157)	0	(336)	0	0	0
(77.568)	(18.973)	(3.321)	(1.086)	(18.239)	0	(833)	0
(41.321)	(24.214)	(4.470)	(3.480)	(8.191)	(61.630)	(591)	0
0	0	0	0	0	0	0	0
(797.644)	(156.833)	(13.909)	(5.290)	(813.128)	(234.754)	(7.591)	(4.524)
\$ 5.721.591	\$ 9.110.409	\$ 292.655	\$ 328.081	\$ 1.369.877	\$ 1.444.182	\$ 97.153	\$ 139.704

Finanzstatus (Forts.)

(Angaben in Tausend)	Diversified Income Fund		Diversified Income Duration Hedged Fund	
	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
Aktiva:				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes				
Finanzvermögen:				
Übertragbare Wertpapiere	\$ 6.620.617	\$ 14.274.019	\$ 401.584	\$ 1.093.527
Investmentfonds	876.630	1.614.943	55.806	126.929
Pensionsgeschäfte	1.746.323	157.316	102.832	58.930
Einlagen bei Kreditinstituten	0	0	0	0
Finanzderivate	132.621	185.600	19.178	40.225
Zahlungsmittel	0	66.783	513	5.706
Einlagen bei Kontrahenten	282.594	386.400	20.323	46.115
Forderungen aus Einkünften	83.844	154.187	5.122	11.642
Forderungen aus verkauften Anlagen	51.445	554	1.998	25
Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen	248.272	0	19.854	0
Forderungen aus verkauften Fondsanteilen	5.685	15.781	98	178
Forderungen aus Derivate-Gewinnen	113.759	0	19.031	0
Sonstige Aktiva	0	0	0	0
Summe Aktiva	10.161.790	16.855.583	646.339	1.383.277
Passiva:				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete				
Finanzverbindlichkeiten:				
Finanzderivate	(150.759)	(69.821)	(5.030)	(10.316)
Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen	(586.220)	(126.270)	(940)	(31.701)
Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen	(549.539)	0	(39.365)	0
Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen	(7.240)	(13.229)	(2.623)	(40)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	(8.022)	(14.404)	(438)	(1.000)
Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften	(6.646)	(81.869)	0	(4.845)
Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Aufwendungen	(148)	(252)	(2)	(10)
Überziehungskredit	(3.465)	0	0	0
Zu zahlende Dividende	(3.841)	(5.238)	(870)	(1.735)
Verbindlichkeiten aus Derivatemargen	(62.209)	(13.641)	(29.190)	(15.275)
Einlagen von Kontrahenten	(31.905)	(83.126)	(3.197)	(12.990)
Sonstige Verbindlichkeiten	0	0	0	0
Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber	(1.409.994)	(407.850)	(81.655)	(77.912)
Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber	\$ 8.751.796	\$ 16.447.733	\$ 564.684	\$ 1.305.365

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

(1) Der Diversified Income ESG Fund wurde am 27. Juli 2022 aufgelegt.

(2) Der Emerging Local Bond ESG Fund wurde am 27. Juli 2022 aufgelegt.

Diversified Income ESG Fund ⁽¹⁾		Dynamic Bond Fund		Dynamic Multi-Asset Fund		Emerging Local Bond Fund		Emerging Local Bond ESG Fund ⁽²⁾	
Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2022
\$ 9.978	\$ 2.712.201	\$ 2.900.066	€ 4.130.924	€ 6.852.548	\$ 1.772.984	\$ 2.324.309		\$ 6.270	
0	348.722	318.072	504.414	450.070	131.643	171.278		0	
0	1.145.692	9.965	124.604	202.276	0	591		0	
0	0	0	0	0	7.054	0		4	
60	74.933	52.162	234.476	63.798	315.328	231.544		269	
108	7.730	9.403	38.251	8.172	35.990	5.660		127	
113	96.997	51.300	395.426	134.947	51.091	42.460		39	
112	16.752	15.754	5.003	5.076	35.522	42.706		122	
0	7.837	116	9.331	3.646	26.063	6.368		0	
603	454.635	526.460	0	0	0	0		0	
0	2.056	13.377	2.321	6.948	4.086	243		0	
27	69.677	39.998	165.342	31.883	102.125	11.602		11	
0	0	0	0	0	17	0		0	
11.001	4.937.232	3.936.673	5.610.092	7.759.364	2.481.903	2.836.761		6.842	
(73)	(160.788)	(75.424)	(236.948)	(62.775)	(313.285)	(205.022)		(215)	
0	(82.152)	(262.976)	0	0	0	0		0	
0	(557.164)	(13.658)	(21.731)	(15.149)	(28.070)	(56.769)		0	
(1.000)	(607.223)	(272.055)	0	0	0	0		0	
0	(600)	(1.936)	(13.813)	(10.657)	(665)	(605)		0	
(6)	(2.772)	(2.657)	(5.575)	(8.203)	(1.496)	(1.725)		(4)	
0	(2.164)	(4.539)	(17.828)	0	(85.313)	(374.743)		0	
0	0	0	0	0	0	0		0	
0	(68)	(203)	(33)	(44)	(206)	(129)		(2)	
0	0	0	0	0	0	0		0	
0	(680)	(1.313)	0	0	0	0		0	
(68)	(28.530)	0	(115.772)	0	(83.123)	0		(12)	
0	(11.490)	(23.915)	(83.222)	(26.586)	(50.077)	(46.639)		0	
0	0	0	0	0	0	0		0	
(1.147)	(1.453.631)	(658.676)	(494.922)	(123.414)	(562.235)	(685.632)		(233)	
\$ 9.854	\$ 3.483.601	\$ 3.277.997	€ 5.115.170	€ 7.635.950	\$ 1.919.668	\$ 2.151.129		\$ 6.609	

Finanzstatus (Forts.)

(Angaben in Tausend)	Emerging Markets Bond Fund		Emerging Markets Bond ESG Fund	
	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
Aktiva:				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes				
Finanzvermögen:				
Übertragbare Wertpapiere	\$ 3.267.661	\$ 4.300.367	\$ 2.422.256	\$ 2.704.270
Investmentfonds	52.797	460.982	0	0
Pensionsgeschäfte	9.160	50.323	44.661	51.143
Einlagen bei Kreditinstituten	2.227	0	1.659	0
Finanzderivate	69.071	44.804	56.599	25.463
Zahlungsmittel	4.943	5.545	2.605	1.402
Einlagen bei Kontrahenten	49.025	22.985	25.425	12.338
Forderungen aus Einkünften	52.462	63.715	37.299	36.117
Forderungen aus verkauften Anlagen	400	0	215	4.033
Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen	26.106	55.110	4.814	6.793
Forderungen aus verkauften Fondsanteilen	714	7.831	10.705	4.975
Forderungen aus Derivate-Gewinnen	25.590	10.646	10.516	0
Sonstige Aktiva	0	0	0	0
Summe Aktiva	3.560.156	5.022.308	2.616.754	2.846.534
Passiva:				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete				
Finanzverbindlichkeiten:				
Finanzderivate	(49.305)	(32.650)	(23.713)	(14.555)
Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen	(10.331)	0	(3.745)	(2.662)
Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen	(49.405)	(82.661)	(7.710)	(10.194)
Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen	(13.371)	(4.978)	(461)	(1.632)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr	(2.521)	(3.579)	(1.929)	(2.040)
Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften	(75.356)	(166.230)	(38.840)	(167.203)
Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Aufwendungen	(12)	(20)	(1)	(1)
Überziehungskredit	0	0	0	0
Zu zahlende Dividende	(276)	(491)	(2.167)	(1.172)
Verbindlichkeiten aus Derivatemargen	(15.372)	0	(9.012)	(676)
Einlagen von Kontrahenten	(38.228)	(16.955)	(36.701)	(10.630)
Sonstige Verbindlichkeiten	0	0	0	0
Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber	(254.177)	(307.564)	(124.279)	(210.765)
Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber	\$ 3.305.979	\$ 4.714.744	\$ 2.492.475	\$ 2.635.769

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

Emerging Markets Corporate Bond Fund		PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund		Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund		PIMCO ESG Income Fund	
Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
\$ 143.387	\$ 197.661	\$ 181.600	\$ 265.258	\$ 15.264	\$ 25.575	\$ 254.108	\$ 122.326
16.518	10.650	14.797	15.188	2.058	2.833	0	0
8.386	487	706	688	2.766	193	44.400	0
0	0	137	0	78	0	0	0
4.439	2.001	34.841	20.931	4.060	2.859	5.555	1.702
262	143	1.447	1.439	185	122	1.533	1.265
1.839	1.115	10.495	5.253	282	302	2.737	2.030
1.915	2.304	1.549	2.910	87	280	1.372	720
1	0	207	0	1	0	80	0
1.285	0	0	0	0	0	78.252	906
55	64	0	80	11	10	221	141
984	563	5.129	1.119	254	0	4.814	0
0	0	0	0	0	0	0	0
179.071	214.988	250.908	312.866	25.046	32.174	393.072	129.090
(618)	(756)	(31.528)	(16.321)	(3.067)	(2.339)	(4.277)	(432)
0	0	0	0	0	0	(2.630)	(204)
(2.163)	0	0	0	(109)	0	(707)	0
(2.563)	0	0	0	0	0	(141.114)	(1.202)
(10)	(20)	(586)	0	(5)	0	(12)	(1.453)
(172)	(228)	(64)	(233)	(25)	(36)	(118)	(66)
0	0	0	0	0	0	0	0
0	0	0	0	0	0	0	0
0	0	(8)	(7)	(1)	(1)	(12)	(2)
0	0	0	0	0	0	0	0
0	0	0	0	0	0	(1)	(1)
(1.872)	0	(10.037)	0	(631)	(28)	(3.190)	(173)
(2.687)	(1.090)	(3.554)	(5.830)	(271)	(10)	(3.050)	(470)
0	0	0	0	0	0	0	0
(10.085)	(2.094)	(45.777)	(22.391)	(4.109)	(2.414)	(155.111)	(4.003)
\$ 168.986	\$ 212.894	\$ 205.131	\$ 290.475	\$ 20.937	\$ 29.760	\$ 237.961	\$ 125.087

Finanzstatus (Forts.)

(Angaben in Tausend)	Euro Bond Fund		Euro Credit Fund	
	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
Aktiva:				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes				
Finanzvermögen:				
Übertragbare Wertpapiere	€ 1.747.790	€ 2.354.423	€ 491.678	€ 902.376
Investmentfonds	181.654	167.438	50.689	63.657
Pensionsgeschäfte	11.515	24.716	44.621	5.883
Einlagen bei Kreditinstituten	0	0	0	0
Finanzderivate	49.805	20.616	9.083	5.333
Zahlungsmittel	3.052	13.039	12.028	3.625
Einlagen bei Kontrahenten	59.589	28.439	26.366	34.520
Forderungen aus Einkünften	8.903	10.706	4.187	7.125
Forderungen aus verkauften Anlagen	13.467	41	2.447	12
Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen	168.280	3.821	1.073	0
Forderungen aus verkauften Fondsanteilen	932	629	242	106
Forderungen aus Derivate-Gewinnen	105.486	25.994	33.489	3.868
Sonstige Aktiva	0	0	0	0
Summe Aktiva	2.350.473	2.649.862	675.903	1.026.505
Passiva:				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete				
Finanzverbindlichkeiten:				
Finanzderivate	(122.819)	(53.814)	(13.081)	(6.300)
Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen	(95)	(9.696)	(7.404)	0
Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen	(264.938)	(5.728)	(13.488)	0
Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen	(405)	(1.665)	(85)	(997)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr	(807)	(1.121)	(252)	(385)
Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften	0	0	0	0
Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Aufwendungen	(5)	(8)	0	0
Überziehungskredit	0	0	0	0
Zu zahlende Dividende	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Derivatemargen	(41.188)	0	(29.619)	0
Einlagen von Kontrahenten	(6.941)	(3.701)	(1.966)	(1.660)
Sonstige Verbindlichkeiten	0	0	0	0
Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber	(437.198)	(75.733)	(65.895)	(9.342)
Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber	€ 1.913.275	€ 2.574.129	€ 610.008	€ 1.017.163

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

Euro Income Bond Fund		Euro Long Average Duration Fund		Euro Short-Term Fund		PIMCO European High Yield Bond Fund	
Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
€ 1.100.441	€ 2.206.773	€ 103.959	€ 155.866	€ 330.698	€ 595.961	€ 157.222	€ 154.011
134.815	176.868	4.940	407	0	0	8.700	9.575
120.458	7.551	1.500	1.236	14.100	26.537	3.700	4.900
0	0	0	0	0	0	0	0
26.003	20.260	3.789	1.769	5.409	1.689	2.007	463
7.361	20.033	397	453	896	890	3.440	1.054
47.460	64.074	4.382	2.569	6.396	4.891	2.986	897
8.869	20.309	1.039	971	1.735	3.177	1.897	1.789
53.521	63	0	7	63	0	32	12
117.074	0	6.332	364	0	4.006	0	0
1.107	1.051	51	0	550	610	71	0
19.325	0	16.625	3.931	5.754	108	1.485	0
0	0	0	0	0	0	0	0
1.636.434	2.516.982	143.014	167.573	365.601	637.869	181.540	172.701
(27.457)	(3.673)	(18.830)	(6.131)	(2.312)	(2.318)	(1.105)	(400)
0	0	0	0	0	0	0	0
(22.578)	(4.987)	0	(111)	0	(706)	(4.181)	(1.789)
(208.728)	0	(11.721)	(546)	0	(4.004)	0	0
(1.033)	(5.348)	0	0	(1.514)	(809)	(1)	(18)
(1.244)	(2.119)	(46)	(64)	(105)	(170)	(13)	(3)
0	(3.195)	0	0	0	0	0	0
0	0	0	0	0	0	0	0
(17)	(28)	0	0	0	0	0	0
0	0	0	0	0	0	0	0
0	0	0	0	0	0	0	0
(18.036)	(7.677)	(2.369)	0	(6.452)	0	(2.078)	(1)
(4.361)	(7.651)	0	(120)	(2.123)	(3)	0	(1)
0	0	0	0	0	0	0	0
(283.454)	(34.678)	(32.966)	(6.972)	(12.506)	(8.010)	(7.378)	(2.212)
€ 1.352.980	€ 2.482.304	€ 110.048	€ 160.601	€ 353.095	€ 629.859	€ 174.162	€ 170.489

Finanzstatus (Forts.)

(Angaben in Tausend)	PIMCO European Short-Term Opportunities Fund		Global Advantage Fund	
	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
Aktiva:				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes				
Finanzvermögen:				
Übertragbare Wertpapiere	€ 193.346	€ 351.206	\$ 443.632	\$ 587.365
Investmentfonds	18.800	26.155	18.242	18.823
Pensionsgeschäfte	4.400	11.681	1.408	206
Einlagen bei Kreditinstituten	0	0	0	0
Finanzderivate	7.774	4.478	25.927	11.543
Zahlungsmittel	640	836	3.907	5.555
Einlagen bei Kontrahenten	4.772	7.109	15.524	10.252
Forderungen aus Einkünften	1.077	1.510	2.702	2.915
Forderungen aus verkauften Anlagen	1.622	1.896	9.551	8.317
Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen	12.293	364	96.161	209.240
Forderungen aus verkauften Fondsanteilen	293	45	3	19
Forderungen aus Derivate-Gewinnen	4.861	0	22.907	1.216
Sonstige Aktiva	0	0	0	0
Summe Aktiva	249.878	405.280	639.964	855.451
Passiva:				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete				
Finanzverbindlichkeiten:				
Finanzderivate	(8.310)	(7.549)	(21.316)	(10.288)
Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere	0	0	(28.813)	(57.191)
Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen	(590)	0	(8.457)	(14.219)
Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen	(23.393)	(546)	(140.479)	(212.883)
Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen	(111)	(186)	(35)	(32)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr	(66)	(120)	(250)	(316)
Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften	0	(611)	(1.504)	(35.450)
Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Aufwendungen	0	0	(17)	(25)
Überziehungskredit	0	0	0	0
Zu zahlende Dividende	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Derivatemargen	(5.044)	(750)	(23.802)	0
Einlagen von Kontrahenten	(1.192)	(27)	(4.832)	(3.980)
Sonstige Verbindlichkeiten	0	0	0	0
Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber	(38.706)	(9.789)	(229.505)	(334.384)
Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber	€ 211.172	€ 395.491	\$ 410.459	\$ 521.067

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

Global Bond Fund		Global Bond ESG Fund		Global Bond Ex-US Fund		PIMCO Global Core Asset Allocation Fund	
Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
\$ 11.361.097	\$ 15.289.653	\$ 2.913.880	\$ 2.374.485	\$ 737.412	\$ 1.081.382	\$ 473.435	\$ 575.784
1.120.979	1.197.100	5.649	6.595	47.322	6.361	251.489	388.149
1.346.970	3.378	1.157.847	38.254	1.625	1.246	18.536	511
0	0	0	0	0	0	0	0
518.391	369.066	94.009	56.798	35.105	13.807	29.087	29.674
32.207	38.469	8.552	8.538	5.507	7.191	12.189	13.516
478.539	275.050	125.721	34.338	39.796	20.245	40.674	61.007
51.007	83.537	10.094	10.524	3.559	6.445	1.307	1.629
279.220	269.817	26.307	25.414	15.805	15.507	4.838	810
4.755.367	4.531.716	450.850	542.093	255.052	399.574	90.163	113.928
77.660	6.862	3.518	1.726	460	31	270	340
658.178	22.127	164.909	4.857	56.123	7.205	35.050	0
0	0	0	0	0	0	0	0
20.679.615	22.086.775	4.961.336	3.103.622	1.197.766	1.558.994	957.038	1.185.348
(859.558)	(368.266)	(151.501)	(39.219)	(63.177)	(22.778)	(43.855)	(9.866)
(721.316)	(1.368.631)	(119.122)	(197.580)	(76.200)	(150.627)	0	(84.769)
(930.760)	(268.606)	(622.586)	(33.767)	(15.641)	(24.164)	(1.870)	(5.707)
(6.231.107)	(4.789.961)	(792.022)	(504.380)	(282.153)	(334.379)	(117.381)	(29.309)
(13.836)	(17.323)	(10.843)	(764)	(75)	(4.342)	(10.695)	(323)
(5.736)	(7.214)	(1.314)	(972)	(342)	(443)	(793)	(1.027)
(1.682)	(1.166.988)	0	0	0	(99.506)	0	0
0	0	0	0	0	(8.467)	0	0
(137)	(164)	(3)	(5)	(7)	(11)	(3)	(3)
0	0	0	0	0	0	0	0
(736)	(866)	(399)	(291)	0	0	(40)	(58)
(407.767)	0	(125.388)	0	(41.421)	0	(18.837)	(12.600)
(86.868)	(59.910)	(31.968)	(23.678)	(2.728)	(2.570)	(13.488)	(6.665)
0	0	0	0	0	0	0	0
(9.259.503)	(8.047.929)	(1.855.146)	(800.656)	(481.744)	(647.287)	(206.962)	(150.327)
\$ 11.420.112	\$ 14.038.846	\$ 3.106.190	\$ 2.302.966	\$ 716.022	\$ 911.707	\$ 750.076	\$ 1.035.021

Finanzstatus (Forts.)

(Angaben in Tausend)	Global High Yield Bond Fund		Global Investment Grade Credit Fund	
	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
Aktiva:				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes				
Finanzvermögen:				
Übertragbare Wertpapiere	\$ 2.850.786	\$ 4.683.221	\$ 9.778.544	\$ 16.283.191
Investmentfonds	201.583	417.716	1.038.326	1.100.873
Pensionsgeschäfte	11.412	0	75.423	4.429
Einlagen bei Kreditinstituten	0	0	0	0
Finanzderivate	36.885	38.557	212.298	191.914
Zahlungsmittel	26	1.537	20.756	50.691
Einlagen bei Kontrahenten	28.611	21.314	275.295	279.019
Forderungen aus Einkünften	40.375	60.659	90.845	142.494
Forderungen aus verkauften Anlagen	23	56	34.506	4.769
Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen	0	0	1.919.603	1.041.946
Forderungen aus verkauften Fondsanteilen	7.615	9.087	30.854	9.657
Forderungen aus Derivate-Gewinnen	788	5.436	180.542	100.355
Sonstige Aktiva	223	175	0	0
Summe Aktiva	3.178.327	5.237.758	13.656.992	19.209.338
Passiva:				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete				
Finanzverbindlichkeiten:				
Finanzderivate	(20.824)	(14.484)	(293.790)	(216.037)
Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere	0	0	(136.255)	(224.962)
Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen	0	(44)	0	(9.522)
Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen	0	0	(2.481.720)	(1.475.711)
Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen	(13.817)	(4.927)	(32.381)	(21.164)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr	(1.960)	(3.102)	(5.738)	(9.073)
Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften	(10.397)	(15.872)	(4.154)	(7.380)
Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Aufwendungen	(123)	(139)	(339)	(553)
Überziehungskredit	0	0	0	0
Zu zahlende Dividende	(4.126)	(7.729)	(6.988)	(16.246)
Verbindlichkeiten aus Derivatemargen	(3.436)	0	(82.017)	0
Einlagen von Kontrahenten	(20.776)	(22.301)	(75.269)	(73.765)
Sonstige Verbindlichkeiten	0	0	0	0
Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber	(75.459)	(68.598)	(3.118.651)	(2.054.413)
Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber	\$ 3.102.868	\$ 5.169.160	\$ 10.538.341	\$ 17.154.925

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

Global Investment Grade Credit ESG Fund		Global Low Duration Real Return Fund		Global Real Return Fund		Income Fund	
Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
\$ 1.489.771	\$ 1.166.597	\$ 1.661.693	\$ 1.420.625	\$ 3.391.396	\$ 4.811.615	\$ 67.246.471	\$ 76.792.728
0	0	12.424	12.363	7.043	192	2.081.428	2.811.875
15.240	962	1.053	1.138	2.245	5.680	3.421.698	6.365.633
0	0	0	0	0	0	0	0
33.293	14.075	50.766	28.567	106.832	70.667	5.163.114	1.770.198
2.079	2.463	9.404	6.245	8.086	15.002	89.931	91.434
30.302	9.154	18.687	12.451	46.251	36.615	1.852.978	1.796.692
11.400	6.974	2.931	2.483	7.667	6.926	354.824	384.924
52.816	120	94.773	68	68.378	402	60.282	65.747
135.728	0	72.965	13.920	191.920	60.107	21.347.671	17.819.516
1.945	2.814	574	7.839	4.737	12.767	88.371	223.885
13.422	1.482	12.290	1.281	27.734	0	1.235.828	0
0	0	0	0	0	0	236	0
1.785.996	1.204.641	1.937.560	1.506.980	3.862.289	5.019.973	102.942.832	108.122.632
(17.969)	(5.914)	(29.733)	(20.118)	(93.426)	(53.145)	(3.649.860)	(725.980)
(5.887)	0	0	0	0	(311)	(734.103)	(484.196)
(8.117)	(1.129)	(30.524)	0	0	0	(205.883)	(3.521.764)
(202.456)	0	(132.585)	(27.180)	(325.573)	(116.048)	(37.310.306)	(28.452.770)
(188)	(411)	(2.607)	(94)	(3.628)	(3.514)	(145.081)	(98.350)
(605)	(468)	(735)	(633)	(1.447)	(2.039)	(45.253)	(56.822)
(75.928)	0	(261.713)	0	(796.152)	(772.701)	(15.867)	(73.072)
(75.925)	0	(79.599)	(250.806)	(9.519)	(335.849)	0	0
(124)	(80)	(2)	(2)	(51)	(77)	(4.925)	(4.993)
0	0	0	0	0	0	0	0
(692)	(806)	(446)	(590)	(2.363)	(2.837)	(2.737)	(2.008)
(13.852)	0	(18.182)	0	(35.345)	(4.981)	(2.473.835)	(789.779)
(14.363)	(6.270)	(17.059)	(8.481)	(22.923)	(25.092)	(374.655)	(333.172)
0	0	0	0	0	0	0	0
(416.106)	(15.078)	(573.185)	(307.904)	(1.290.427)	(1.316.594)	(44.962.505)	(34.542.906)
\$ 1.369.890	\$ 1.189.563	\$ 1.364.375	\$ 1.199.076	\$ 2.571.862	\$ 3.703.379	\$ 57.980.327	\$ 73.579.726

Finanzstatus (Forts.)

(Angaben in Tausend)	Income Fund II		Inflation Multi-Asset Fund ⁽¹⁾	
	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
Aktiva:				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes				
Finanzvermögen:				
Übertragbare Wertpapiere	\$ 56.970	\$ 26.514	\$ 320.121	\$ 142.619
Investmentfonds	1.740	2.701	68.975	20.447
Pensionsgeschäfte	0	0	40.720	500
Einlagen bei Kreditinstituten	0	0	0	0
Finanzderivate	718	138	14.716	4.126
Zahlungsmittel	644	507	0	958
Einlagen bei Kontrahenten	1.022	155	8.179	2.360
Forderungen aus Einkünften	384	155	688	236
Forderungen aus verkauften Anlagen	5	1	13	779
Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen	8.075	3.539	10.546	8.837
Forderungen aus verkauften Fondsanteilen	4.020	0	100	1.262
Forderungen aus Derivate-Gewinnen	637	0	7.201	1.707
Sonstige Aktiva	0	49	0	0
Summe Aktiva	74.215	33.759	471.259	183.831
Passiva:				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete				
Finanzverbindlichkeiten:				
Finanzderivate	(406)	(87)	(10.695)	(3.745)
Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen	(182)	(204)	(2.206)	(284)
Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen	(15.917)	(5.616)	(43.111)	(13.222)
Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen	0	0	(1.769)	(99)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	(48)	(15)	(445)	(176)
Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften	0	0	0	0
Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Aufwendungen	0	(50)	(5)	0
Überziehungskredit	0	0	(980)	0
Zu zahlende Dividende	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Derivatemargen	(1.036)	(17)	(6.644)	0
Einlagen von Kontrahenten	0	0	(2.326)	(1.960)
Sonstige Verbindlichkeiten	(3)	0	0	0
Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber	(17.592)	(5.989)	(68.181)	(19.486)
Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber	\$ 56.623	\$ 27.770	\$ 403.078	\$ 164.345

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

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

⁽²⁾ Der Global LIBOR Plus Bond Fund wurde am 13. April 2022 in Low Duration Opportunities Fund umbenannt.

Low Average Duration Fund		Low Duration Global Investment Grade Credit Fund		Low Duration Income Fund		Low Duration Opportunities Fund ⁽²⁾	
Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
\$ 1.235.606	\$ 1.057.626	\$ 691.422	\$ 734.742	\$ 1.213.608	\$ 1.446.972	\$ 1.216.746	\$ 2.786.796
85.631	113.421	643	78.479	106.140	132.416	133.056	312.142
956	24.177	1.604	892	98.831	7.961	118.800	72.663
0	0	0	0	0	0	0	0
7.284	2.332	13.518	8.643	79.359	23.761	55.664	71.141
2.692	2.927	390	1.433	6.374	5.269	3.357	6.686
24.403	8.182	10.136	9.961	34.272	28.872	57.806	29.781
6.394	2.367	5.082	4.266	7.264	7.379	7.718	13.094
723	23	202	3	2.215	766	12.795	60
380.707	193.244	69.997	71.010	367.632	252.242	282.511	507.359
976	602	2.763	443	2.070	3.175	542	3.583
7.914	4.218	11.170	2.906	21.540	0	45.871	23.070
0	0	0	0	0	0	0	0
1.753.286	1.409.119	806.927	912.778	1.939.305	1.908.813	1.934.866	3.826.375
(14.403)	(5.784)	(11.395)	(5.547)	(64.082)	(12.736)	(109.833)	(49.450)
(76.949)	(38.058)	(14.029)	(15.770)	(5.209)	(213)	(94.108)	(253.414)
(2.924)	0	(1.062)	0	(9.219)	(14.668)	(12.575)	(3.929)
(427.587)	(183.803)	(97.540)	(76.434)	(724.143)	(501.622)	(347.541)	(261.219)
(1.987)	(477)	(422)	(621)	(185)	(176)	(139)	(491)
(495)	(527)	(289)	(350)	(565)	(661)	(542)	(1.274)
(144.857)	0	(12.776)	0	0	0	0	(1.088)
(4.077)	0	(1.409)	(2.682)	0	0	0	0
(10)	(13)	0	0	(24)	(26)	(8)	(4)
0	0	0	0	0	0	0	0
(13)	(7)	(20)	(65)	(247)	(370)	(1.377)	(1.545)
(3.315)	0	(4.014)	0	(28.430)	(288)	(19.443)	0
(3.911)	(1.312)	(9.222)	(4.440)	(22.821)	(10.578)	(3.519)	(36.701)
0	0	0	0	0	0	0	0
(680.528)	(229.981)	(152.178)	(105.909)	(854.925)	(541.338)	(589.085)	(609.115)
\$ 1.072.758	\$ 1.179.138	\$ 654.749	\$ 806.869	\$ 1.084.380	\$ 1.367.475	\$ 1.345.781	\$ 3.217.260

Finanzstatus (Forts.)

(Angaben in Tausend)	Low Duration Opportunities ESG Fund ⁽¹⁾		PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	
	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021	Zum 31. Dez. 2021
Aktiva:				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes Finanzvermögen:				
Übertragbare Wertpapiere	\$ 5.070	\$ 106.959	\$ 91.234	
Investmentfonds	0	11.833	9.531	
Pensionsgeschäfte	0	811	0	
Einlagen bei Kreditinstituten	0	0	0	
Finanzderivate	22	1.447	602	
Zahlungsmittel	122	552	128	
Einlagen bei Kontrahenten	31	2.870	0	
Forderungen aus Einkünften	16	104	62	
Forderungen aus verkauften Anlagen	0	13	2.074	
Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen	274	0	0	
Forderungen aus verkauften Fondsanteilen	0	59	400	
Forderungen aus Derivate-Gewinnen	51	0	0	
Sonstige Aktiva	0	0	274	
Summe Aktiva	5.586	124.648	104.305	
Passiva:				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Finanzverbindlichkeiten:				
Finanzderivate	(67)	(237)	(207)	
Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere	0	0	0	
Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen	0	(2.379)	(2.114)	
Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen	(545)	0	0	
Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen	0	(834)	(23)	
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr	(2)	(109)	(83)	
Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften	0	0	0	
Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	0	0	0	
Verbindlichkeiten aus Aufwendungen	0	0	0	
Überziehungskredit	0	0	0	
Zu zahlende Dividende	0	0	0	
Verbindlichkeiten aus Derivatemargen	(44)	0	0	
Einlagen von Kontrahenten	0	(952)	(1.340)	
Sonstige Verbindlichkeiten	0	0	0	
Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber	(658)	(4.511)	(3.767)	
Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber	\$ 4.928	\$ 120.137	\$ 100.538	

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

⁽¹⁾ Der Low Duration Opportunities ESG Fund wurde am 27. Juli 2022 aufgelegt.

Mortgage Opportunities Fund		StocksPLUS™ Fund		PIMCO StocksPLUS™ AR Fund		Strategic Income Fund	
Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
\$ 1.724.999	\$ 2.954.598	\$ 711.694	\$ 2.342.626	\$ 7.750	\$ 9.467	\$ 610.560	\$ 758.311
23	93.049	92.742	342.388	904	1.103	29.661	15.171
17.318	2.125	156.445	1.471.512	1.374	1.432	781	476
0	0	0	0	0	0	0	0
44.003	52.801	12.661	110.152	258	305	53.205	12.361
167	2.246	2.178	1.676	11	35	4.623	5.076
11.602	31.320	85.945	119.116	861	231	11.922	15.351
4.660	5.923	2.660	4.915	21	16	2.787	3.698
1.901	165	255	49.250	0	649	4.738	345
1.781.393	1.981.607	0	0	1.240	1.357	224.967	279.954
412	8.485	1.226	8.655	0	0	385	824
17.755	0	33.144	0	115	39	14.864	4.458
0	0	0	0	0	0	0	0
3.604.233	5.132.319	1.098.950	4.450.290	12.534	14.634	958.493	1.096.025
(17.225)	(15.508)	(30.319)	(40.872)	(293)	(110)	(36.766)	(12.272)
(518.212)	(640.730)	0	0	(583)	(305)	(13.092)	(32.833)
(194.452)	(577)	(37.060)	(500.740)	(583)	0	(741)	(9.686)
(1.654.287)	(1.834.460)	0	0	(1.310)	(1.802)	(367.853)	(413.907)
(596)	(87)	(1.097)	(10.062)	0	0	(539)	(570)
(547)	(942)	(656)	(1.891)	(6)	(7)	(585)	(706)
(316.493)	(363.919)	0	0	0	0	0	0
0	0	0	0	0	0	0	(1.841)
(8)	(18)	(5)	(7)	0	0	(17)	(12)
0	0	0	0	0	0	0	0
(21)	(18)	0	0	0	0	0	0
(18.210)	(21.268)	(15.583)	(23.105)	(231)	0	(21.409)	0
(35.034)	(16.368)	(5.491)	(112.457)	0	(800)	(10.934)	(4.270)
0	0	0	0	0	0	0	0
(2.755.085)	(2.893.895)	(90.211)	(689.134)	(3.006)	(3.024)	(451.936)	(476.097)
\$ 849.148	\$ 2.238.424	\$ 1.008.739	\$ 3.761.156	\$ 9.528	\$ 11.610	\$ 506.557	\$ 619.928

Finanzstatus (Forts.)

(Angaben in Tausend)	Total Return Bond Fund		PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	
	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
Aktiva:				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes				
Finanzvermögen:				
Übertragbare Wertpapiere	\$ 4.770.861	\$ 5.405.196	\$ 335.879	\$ 87.130
Investmentfonds	292.421	423.494	41.693	4.572
Pensionsgeschäfte	170.895	7.152	27.452	800
Einlagen bei Kreditinstituten	0	0	600	0
Finanzderivate	110.789	54.310	42.556	12.654
Zahlungsmittel	15.733	19.769	3.994	1.523
Einlagen bei Kontrahenten	120.293	91.011	28.858	8.749
Forderungen aus Einkünften	25.541	23.708	1.601	77
Forderungen aus verkauften Anlagen	51.883	7	134	4
Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen	2.180.028	800.505	25.221	0
Forderungen aus verkauften Fondsanteilen	12.045	859	11.015	42
Forderungen aus Derivate-Gewinnen	77.114	0	17.270	0
Sonstige Aktiva	0	0	0	0
Summe Aktiva	7.827.603	6.826.011	536.273	115.551
Passiva:				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete				
Finanzverbindlichkeiten:				
Finanzderivate	(106.644)	(52.693)	(44.109)	(7.768)
Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere	(68.457)	0	0	0
Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen	(6.344)	(1)	(523)	(21)
Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen	(3.304.650)	(1.565.309)	(30.301)	0
Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen	(3.734)	(12.407)	(3.552)	0
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr	(2.652)	(3.292)	(453)	(121)
Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften	(1.745)	(225.851)	0	0
Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	(76.810)	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Aufwendungen	(210)	(205)	0	0
Überziehungskredit	0	0	0	0
Zu zahlende Dividende	(186)	(241)	(317)	0
Verbindlichkeiten aus Derivatemargen	(72.167)	(16.432)	(16.064)	(5.102)
Einlagen von Kontrahenten	(33.287)	(4.682)	(5.030)	(750)
Sonstige Verbindlichkeiten	0	0	0	0
Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber	(3.676.886)	(1.881.113)	(100.349)	(13.762)
Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber	\$ 4.150.717	\$ 4.944.898	\$ 435.924	\$ 101.789

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

UK Corporate Bond Fund		UK Long Term Corporate Bond Fund		US High Yield Bond Fund		US Investment Grade Corporate Bond Fund	
Zum	Zum	Zum	Zum	Zum	Zum	Zum	Zum
31. Dez. 2022	31. Dez. 2021	31. Dez. 2022	31. Dez. 2021	31. Dez. 2022	31. Dez. 2021	31. Dez. 2022	31. Dez. 2021
£ 372.745	£ 571.865	£ 309.110	£ 403.042	\$ 1.895.465	\$ 3.607.920	\$ 346.399	\$ 881.526
5.370	208	0	0	39.162	255.818	38.657	6.571
177	526	269	442	9.269	1.473	15.383	686
0	0	0	0	0	0	0	0
4.161	1.924	8.017	4.147	12.684	9.373	8.390	13.601
1.084	4.094	1.809	4.588	550	291	796	2.568
7.199	9.544	10.123	12.076	10.449	12.192	12.615	16.731
4.405	5.804	4.594	4.416	31.884	53.960	3.400	7.911
1.522	333	0	43	3.204	1.958	27.549	5
0	0	0	0	0	0	21.983	25.425
61	1.701	0	0	1.390	1.806	2.561	41
7.000	2.540	15.391	0	270	2.079	5.621	2.575
0	0	0	0	186	137	0	0
403.724	598.539	349.313	428.754	2.004.513	3.947.007	483.354	957.640
(1.718)	(2.838)	(3.697)	(1.533)	(1.517)	(1.240)	(7.500)	(5.861)
0	0	0	0	0	0	(2.035)	(3.780)
0	(803)	0	(47)	(4.262)	(12.576)	0	(998)
0	0	0	0	0	0	(39.829)	(34.064)
(70)	(116)	0	0	(2.743)	(1.122)	(58)	(58)
(127)	(198)	(131)	(168)	(1.173)	(2.175)	(182)	(384)
0	(513)	0	(513)	0	0	0	0
0	0	0	0	0	0	(38.655)	(26.510)
0	0	0	(1)	(148)	(204)	0	0
0	0	0	0	0	0	0	0
(1.865)	(1.718)	(371)	(332)	(20)	(84)	(156)	(325)
(10.440)	0	(19.583)	(264)	(1.779)	0	(4.541)	0
(331)	(189)	(511)	(148)	(7.949)	(5.820)	(1.876)	(7.560)
0	0	0	0	0	0	0	0
(14.551)	(6.375)	(24.293)	(3.006)	(19.591)	(23.221)	(94.832)	(79.540)
£ 389.173	£ 592.164	£ 325.020	£ 425.748	\$ 1.984.922	\$ 3.923.786	\$ 388.522	\$ 878.100

Finanzstatus (Forts.)

(Angaben in Tausend)

	US Short-Term Fund		Summe der Gesellschaft*	
	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
Aktiva:				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes				
Finanzvermögen:				
Übertragbare Wertpapiere	\$ 1.891.711	\$ 2.807.383	\$ 158.067.452	\$ 208.816.756
Investmentfonds	226.018	269.578	7.205.963	10.683.404
Pensionsgeschäfte	154.472	1.571	10.455.165	8.915.653
Einlagen bei Kreditinstituten	0	0	11.759	0
Finanzderivate	10.584	4.662	8.087.908	3.900.473
Zahlungsmittel	1.993	2.849	369.095	477.055
Einlagen bei Kontrahenten	18.130	19.585	4.733.599	4.042.726
Forderungen aus Einkünften	12.016	8.627	1.097.303	1.382.643
Forderungen aus verkauften Anlagen	4.313	997	1.035.370	468.689
Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen	0	0	36.037.151	29.486.811
Forderungen aus verkauften Fondsanteilen	6.106	383	405.829	373.677
Forderungen aus Derivate-Gewinnen	5.389	9.832	3.520.113	338.656
Sonstige Aktiva	0	0	662	635
Summe Aktiva	2.330.732	3.125.467	231.032.136	268.887.178
Passiva:				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete				
Finanzverbindlichkeiten:				
Finanzderivate	(5.824)	(16.054)	(7.088.064)	(2.398.130)
Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere	0	0	(2.699.152)	(3.816.550)
Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen	(1.430)	(531)	(3.353.495)	(4.750.126)
Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen	0	0	(57.317.614)	(41.265.351)
Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen	(2.669)	(3.131)	(417.932)	(233.829)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr	(722)	(770)	(108.234)	(146.545)
Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften	0	(215.091)	(2.874.391)	(3.878.191)
Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	0	(237.755)	(303.953)	(944.710)
Verbindlichkeiten aus Aufwendungen	(4)	(7)	(7.630)	(4.687)
Überziehungskredit	0	0	(17.972)	0
Zu zahlende Dividende	0	0	(30.796)	(48.748)
Verbindlichkeiten aus Derivatemargen	(4.603)	0	(4.103.581)	(934.871)
Einlagen von Kontrahenten	(5.365)	(1.930)	(1.182.210)	(1.122.642)
Sonstige Verbindlichkeiten	0	0	(3)	0
Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber	(20.617)	(475.269)	(79.507.617)	(59.544.380)
Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber	\$ 2.310.115	\$ 2.650.198	\$ 151.524.519	\$ 209.342.798

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

* Die Summe der Gesellschaft zum 31. Dezember 2022 und zum 31. Dezember 2021 wurde bereinigt, um Überkreuzinvestitionen und Salden im Namen der Gesellschaft zu eliminieren. Nähere Einzelheiten zu Überkreuzinvestitionen sind Erläuterung 14 in den Erläuterungen zum Abschluss zu entnehmen.

Für den Verwaltungsrat:

Verwaltungsratsmitglied: Craig A. Dawson

Verwaltungsratsmitglied: David M. Kennedy

Datum: 25. April 2023

(Diese Seite wurde absichtlich freigelassen.)

Betriebsergebnisrechnung

(Angaben in Tausend)

	PIMCO Asia High Yield Bond Fund		Asia Strategic Interest Bond Fund	
	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2021	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2021
Erträge				
Zins- und Dividendenerträge	\$ 215.235	\$ 119.728	\$ 15.190	\$ 11.211
Sonstige Erträge	0	0	0	0
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	(437.831)	(54.488)	(25.277)	(2.299)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten	(75.534)	(32.648)	(12.295)	(7.916)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung	333	(439)	152	126
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	(288.652)	(334.955)	(26.718)	(20.528)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten	15.038	13.399	2.022	767
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus Fremdwährung	(22)	(33)	0	(3)
Gesamtanlageertrag/(-verlust)	(571.433)	(289.436)	(46.926)	(18.642)
Betriebskosten				
Verwaltungsgebühr	(19.675)	(13.097)	(1.966)	(1.554)
Servicegebühr	(570)	(885)	0	0
Bestandspflegegebühr	(167)	(211)	0	0
Sonstige Aufwendungen	(3)	(9)	0	0
Gesamtaufwendungen	(20.415)	(14.202)	(1.966)	(1.554)
Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft	17	17	4	4
Betriebskosten, netto	(20.398)	(14.185)	(1.962)	(1.550)
Anlageerträge/(-verluste), netto	(591.831)	(303.621)	(48.888)	(20.192)
Finanzierungskosten				
Zinsaufwendungen	(165)	0	(17)	0
Aufwand für Kreditfazilitäten	0	0	0	0
Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber	(42.838)	(34.319)	(7.980)	(5.451)
Nettoausgleichskredite und -gebühren	(557)	1.785	(49)	571
Summe Finanzierungskosten	(43.560)	(32.534)	(8.046)	(4.880)
Gewinne/(Verluste) im Geschäftsjahr vor Steuern	(635.391)	(336.155)	(56.934)	(25.072)
Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge	23	(146)	3	(30)
Kapitalertragsteuer	0	(5)	0	1
Gewinne/(Verluste) im Geschäftsjahr nach Steuern	(635.368)	(336.306)	(56.931)	(25.101)
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit	\$ (635.368)	\$ (336.306)	\$ (56.931)	\$ (25.101)

Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter tausend liegt. Alle Beträge ergeben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

PIMCO Capital Securities Fund		PIMCO Climate Bond Fund		Commodity Real Return Fund		PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	
Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2021	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2021	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2021	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2021
\$ 321.673	\$ 349.919	\$ 6.811	\$ 3.914	\$ 118.558	\$ 37.235	\$ 4.895	\$ 5.261
0	0	0	0	0	0	0	0
(339.637)	214.686	(21.894)	(693)	(70.911)	3.321	(5.524)	3.351
281.327	84.747	(3.655)	(13.640)	302.706	109.320	(2.140)	(2.961)
(92.745)	(43.553)	(3)	(928)	(8.645)	3.489	(53)	(7)
(1.370.283)	(465.338)	(49.332)	(9.793)	(183.928)	(24.168)	(9.050)	(7.074)
9.513	29.115	(1.924)	4.118	(59.310)	47.720	350	(1.617)
473	38.100	35	(19)	701	(40)	(9)	19
(1.189.679)	207.676	(69.962)	(17.041)	99.171	176.877	(11.531)	(3.028)
(63.252)	(84.848)	(1.683)	(1.460)	(18.878)	(10.222)	(1.271)	(1.511)
(1.606)	(2.208)	(9)	(1)	(252)	(159)	0	0
(1.243)	(1.687)	0	0	0	0	0	0
(656)	(842)	(15)	(10)	(2)	(1)	(3)	(4)
(66.757)	(89.585)	(1.707)	(1.471)	(19.132)	(10.382)	(1.274)	(1.515)
302	2.370	0	0	0	0	1	1
(66.455)	(87.215)	(1.707)	(1.471)	(19.132)	(10.382)	(1.273)	(1.514)
(1.256.134)	120.461	(71.669)	(18.512)	80.039	166.495	(12.804)	(4.542)
(10.267)	(2.046)	(6)	(13)	(6.180)	(57)	(155)	(56)
0	0	0	0	0	0	0	0
(84.957)	(82.677)	(2.206)	(961)	(336)	0	0	0
(2.829)	1.719	40	(72)	41	0	0	0
(98.053)	(83.004)	(2.172)	(1.046)	(6.475)	(57)	(155)	(56)
(1.354.187)	37.457	(73.841)	(19.558)	73.564	166.438	(12.959)	(4.598)
(609)	(961)	3	(6)	0	(2)	5	(9)
0	0	0	0	0	0	0	0
(1.354.796)	36.496	(73.838)	(19.564)	73.564	166.436	(12.954)	(4.607)
\$ (1.354.796)	\$ 36.496	\$ (73.838)	\$ (19.564)	\$ 73.564	\$ 166.436	\$ (12.954)	\$ (4.607)

Betriebsergebnisrechnung (Forts.)

(Angaben in Tausend)	Diversified Income Fund		Diversified Income Duration Hedged Fund	
	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2021	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2021
Erträge				
Zins- und Dividenderträge	\$ 423.503	\$ 569.476	\$ 32.188	\$ 50.014
Sonstige Erträge	0	0	0	0
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	(732.205)	164.764	(78.712)	25.312
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten	(1.031.422)	(60.829)	(20.394)	(2.784)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung	(127.348)	(75.567)	(3.436)	1.763
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	(1.569.253)	(960.696)	(92.998)	(87.262)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten	(137.498)	(177.480)	(15.985)	5.204
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus Fremdwährung	(2.364)	5.769	(189)	32
Gesamtanlageertrag/(-verlust)	(3.176.587)	(534.563)	(179.526)	(7.721)
Betriebskosten				
Verwaltungsgebühr	(117.086)	(192.927)	(7.323)	(13.779)
Servicegebühr	(575)	(721)	(27)	(49)
Bestandspflegegebühr	(945)	(1.383)	0	0
Sonstige Aufwendungen	(488)	(663)	(11)	(7)
Gesamtaufwendungen	(119.094)	(195.694)	(7.361)	(13.835)
Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft	1.707	3.244	94	266
Betriebskosten, netto	(117.387)	(192.450)	(7.267)	(13.569)
Anlageerträge/(-verluste), netto	(3.293.974)	(727.013)	(186.793)	(21.290)
Finanzierungskosten				
Zinsaufwendungen	(520)	(91)	(82)	(11)
Aufwand für Kreditfazilitäten	0	0	0	0
Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber	(139.762)	(191.274)	(9.289)	(12.331)
Nettoausgleichskredite und -gebühren	(5.667)	(2.570)	(645)	(71)
Summe Finanzierungskosten	(145.949)	(193.935)	(10.016)	(12.413)
Gewinne/(Verluste) im Geschäftsjahr vor Steuern	(3.439.923)	(920.948)	(196.809)	(33.703)
Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge	175	(159)	12	(11)
Kapitalertragsteuer	0	0	0	0
Gewinne/(Verluste) im Geschäftsjahr nach Steuern	(3.439.748)	(921.107)	(196.797)	(33.714)
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit	\$ (3.439.748)	\$ (921.107)	\$ (196.797)	\$ (33.714)

Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter tausend liegt. Alle Beträge ergeben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

Diversified Income ESG Fund		Dynamic Bond Fund		Dynamic Multi-Asset Fund		Emerging Local Bond Fund		Emerging Local Bond ESG Fund							
Berichtszeitraum vom 27. Jul. 2022 bis 31. Dez. 2022		Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022		Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2021		Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022		Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2021		Berichtszeitraum vom 27. Jul. 2022 bis 31. Dez. 2022					
\$	226	\$	97.066	\$	89.693	€	54.199	€	41.589	\$	110.813	\$	150.390	\$	151
	0		0		0		0		0		0		0		0
	12		(49.022)		51.206		(10.017)		410.924		(295.703)		(75.996)		4
	(135)		(160.148)		(60.484)		(164.295)		(242.369)		64.889		31.014		73
	15		(14.875)		6.100		21.614		(5.876)		(13.501)		(9.225)		(13)
	(176)		(262.668)		(143.628)		(805.632)		(36.545)		18.064		(225.952)		151
	(13)		(63.001)		(12.734)		5.000		(40.357)		(19.913)		(79.723)		62
	2		(254)		337		(7.889)		(267)		488		23.074		1
	(69)		(452.902)		(69.510)		(907.020)		127.099		(134.863)		(186.418)		429
	(30)		(29.354)		(34.662)		(78.669)		(92.725)		(18.109)		(24.923)		(20)
	0		(197)		(234)		(38)		(34)		(95)		(112)		0
	0		(178)		(242)		0		0		0		0		0
	0		(147)		(166)		(395)		(446)		(3)		(3)		0
	(30)		(29.876)		(35.304)		(79.102)		(93.205)		(18.207)		(25.038)		(20)
	0		462		472		1.243		1.272		0		46		0
	(30)		(29.414)		(34.832)		(77.859)		(91.933)		(18.207)		(24.992)		(20)
	(99)		(482.316)		(104.342)		(984.879)		35.166		(153.070)		(211.410)		409
	0		(482)		(64)		(354)		(3.102)		(6.817)		(7.947)		0
	0		0		0		0		0		0		0		0
	0		(7.206)		(9.091)		(6.983)		(9.431)		(11.526)		(18.810)		(1)
	0		(584)		210		555		(178)		95		(890)		0
	0		(8.272)		(8.945)		(6.782)		(12.711)		(18.248)		(27.647)		(1)
	(99)		(490.588)		(113.287)		(991.661)		22.455		(171.318)		(239.057)		408
	(1)		12		(84)		(10.191)		(5.882)		(681)		(1.142)		(4)
	0		(41)		0		0		0		(201)		717		(2)
	(100)		(490.617)		(113.371)		(1.001.852)		16.573		(172.200)		(239.482)		402
\$	(100)	\$	(490.617)	\$	(113.371)	€	(1.001.852)	€	16.573	\$	(172.200)	\$	(239.482)	\$	402

Betriebsergebnisrechnung (Forts.)

(Angaben in Tausend)	Emerging Markets Bond Fund		Emerging Markets Bond ESG Fund	
	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2021	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2021
Erträge				
Zins- und Dividendenerträge	\$ 190.399	\$ 246.715	\$ 120.478	\$ 103.739
Sonstige Erträge	0	0	0	0
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	(411.715)	42.422	(132.949)	11.849
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten	(197.333)	(146.684)	(169.322)	(112.702)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung	(5.189)	(2.177)	(2.769)	(1.185)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	(486.975)	(369.547)	(496.113)	(172.069)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten	6.524	(25.567)	23.079	2.768
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus Fremdwährung	(79)	(182)	(644)	572
Gesamtanlageertrag/(-verlust)	(904.368)	(255.020)	(658.240)	(167.028)
Betriebskosten				
Verwaltungsgebühr	(31.503)	(45.749)	(21.416)	(20.619)
Servicegebühr	(30)	(42)	(8)	(7)
Bestandspflegegebühr	(146)	(183)	(6)	(7)
Sonstige Aufwendungen	(5)	(5)	(3)	(2)
Gesamtaufwendungen	(31.684)	(45.979)	(21.433)	(20.635)
Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft	0	0	0	0
Betriebskosten, netto	(31.684)	(45.979)	(21.433)	(20.635)
Anlageerträge/(-verluste), netto	(936.052)	(300.999)	(679.673)	(187.663)
Finanzierungskosten				
Zinsaufwendungen	(2.019)	(863)	(719)	(851)
Aufwand für Kreditfazilitäten	0	0	0	0
Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber	(45.471)	(62.778)	(28.379)	(21.696)
Nettoausgleichskredite und -gebühren	(690)	2.438	482	3.785
Summe Finanzierungskosten	(48.180)	(61.203)	(28.616)	(18.762)
Gewinne/(Verluste) im Geschäftsjahr vor Steuern	(984.232)	(362.202)	(708.289)	(206.425)
Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge	(171)	(873)	24	(172)
Kapitalertragsteuer	0	0	0	0
Gewinne/(Verluste) im Geschäftsjahr nach Steuern	(984.403)	(363.075)	(708.265)	(206.597)
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit	\$ (984.403)	\$ (363.075)	\$ (708.265)	\$ (206.597)

Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter tausend liegt. Alle Beträge ergeben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

Emerging Markets Corporate Bond Fund		PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund		Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund		PIMCO ESG Income Fund	
Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2021	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2021	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2021	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Berichtszeitraum vom 29. Apr. 2021 bis 31. Dez. 2021
\$ 7.612	\$ 10.278	\$ 9.073	\$ 11.487	\$ 630	\$ 749	\$ 4.921	\$ 908
0	0	0	0	0	0	0	0
(10.629)	(28.584)	(34.162)	(661)	(1.875)	(183)	(1.520)	(168)
(12.531)	(12.707)	(446)	(14.635)	296	(572)	(1.583)	(2.704)
(101)	(63)	410	(4)	32	(43)	(62)	(579)
(25.227)	18.185	(11.867)	(18.475)	(922)	(1.021)	(20.930)	(1.493)
2.628	(2.385)	(811)	(599)	480	156	91	1.346
5	(16)	24	233	(16)	27	(46)	(6)
(38.243)	(15.292)	(37.779)	(22.654)	(1.375)	(887)	(19.129)	(2.696)
(2.073)	(3.001)	(1.565)	(2.712)	(361)	(450)	(1.005)	(302)
0	0	0	0	0	0	0	0
0	0	0	0	0	0	(4)	0
0	0	0	(8)	0	0	(8)	(2)
(2.073)	(3.001)	(1.565)	(2.720)	(361)	(450)	(1.017)	(304)
0	0	2	2	7	7	0	0
(2.073)	(3.001)	(1.563)	(2.718)	(354)	(443)	(1.017)	(304)
(40.316)	(18.293)	(39.342)	(25.372)	(1.729)	(1.330)	(20.146)	(3.000)
(18)	(6)	(9)	(68)	(5)	(8)	0	(5)
0	0	0	0	0	0	0	0
0	0	(20)	0	0	0	(1.282)	(157)
0	0	(1)	0	0	0	40	14
(18)	(6)	(30)	(68)	(5)	(8)	(1.242)	(148)
(40.334)	(18.299)	(39.372)	(25.440)	(1.734)	(1.338)	(21.388)	(3.148)
(3)	(22)	(78)	(160)	(3)	(22)	(9)	(3)
0	0	(2)	(6)	0	(1)	0	0
(40.337)	(18.321)	(39.452)	(25.606)	(1.737)	(1.361)	(21.397)	(3.151)
\$ (40.337)	\$ (18.321)	\$ (39.452)	\$ (25.606)	\$ (1.737)	\$ (1.361)	\$ (21.397)	\$ (3.151)

Betriebsergebnisrechnung (Forts.)

(Angaben in Tausend)	Euro Bond Fund		Euro Credit Fund	
	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2021	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2021
Erträge				
Zins- und Dividendenerträge	€ 33.483	€ 26.715	€ 12.380	€ 14.395
Sonstige Erträge	0	0	0	0
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	(99.204)	19.962	(37.541)	5.800
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten	(79.983)	(42.057)	(74.566)	(19.646)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung	423	9.559	2.974	(478)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	(209.845)	(29.859)	(64.593)	(5.119)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten	(36.654)	(47.819)	(2.141)	(4.036)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus Fremdwährung	2.140	(15.569)	711	1.601
Gesamtanlageertrag/(-verlust)	(389.640)	(79.068)	(162.776)	(7.483)
Betriebskosten				
Verwaltungsgebühr	(11.086)	(15.500)	(3.957)	(4.932)
Servicegebühr	(66)	(98)	0	0
Bestandspflegegebühr	(9)	(16)	0	0
Sonstige Aufwendungen	(3)	(3)	(1)	(1)
Gesamtaufwendungen	(11.164)	(15.617)	(3.958)	(4.933)
Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft	625	854	179	123
Betriebskosten, netto	(10.539)	(14.763)	(3.779)	(4.810)
Anlageerträge/(-verluste), netto	(400.179)	(93.831)	(166.555)	(12.293)
Finanzierungskosten				
Zinsaufwendungen	(204)	(280)	(179)	(48)
Aufwand für Kreditfazilitäten	0	0	0	0
Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber	(969)	(1.018)	(1.172)	(1.588)
Nettoausgleichskredite und -gebühren	7	(180)	(99)	20
Summe Finanzierungskosten	(1.166)	(1.478)	(1.450)	(1.616)
Gewinne/(Verluste) im Geschäftsjahr vor Steuern	(401.345)	(95.309)	(168.005)	(13.909)
Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge	(2)	216	4	(2)
Kapitalertragsteuer	0	0	0	0
Gewinne/(Verluste) im Geschäftsjahr nach Steuern	(401.347)	(95.093)	(168.001)	(13.911)
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit	€ (401.347)	€ (95.093)	€ (168.001)	€ (13.911)

Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter tausend liegt. Alle Beträge ergeben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

Euro Income Bond Fund		Euro Long Average Duration Fund		Euro Short-Term Fund		PIMCO European High Yield Bond Fund	
Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2021	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2021	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2021	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2021
€ 40.277	€ 58.295	€ 1.889	€ 1.528	€ 5.127	€ 2.644	€ 6.062	€ 5.677
0	0	0	0	0	0	0	0
(93.499)	28.700	(7.406)	496	(11.983)	1.076	(4.104)	4.538
(26.595)	(22.526)	(10.447)	(776)	8.148	(8.680)	(2.508)	(1.742)
9.992	8.008	(10)	805	1.505	267	192	(116)
(166.879)	(23.298)	(32.163)	(9.864)	(12.596)	7.618	(16.840)	(2.394)
(14.850)	(15.249)	(10.591)	(5.638)	3.715	(2.780)	1.089	(175)
2.773	(16.940)	150	(799)	(257)	245	38	3
(248.781)	16.990	(58.578)	(14.248)	(6.341)	390	(16.071)	5.791
(18.349)	(29.149)	(597)	(774)	(1.714)	(2.538)	(54)	(44)
(73)	(91)	0	0	0	0	0	0
0	0	0	0	0	0	0	0
(156)	(219)	0	0	(1)	(1)	0	(4)
(18.578)	(29.459)	(597)	(774)	(1.715)	(2.539)	(54)	(48)
313	154	17	8	0	0	28	35
(18.265)	(29.305)	(580)	(766)	(1.715)	(2.539)	(26)	(13)
(267.046)	(12.315)	(59.158)	(15.014)	(8.056)	(2.149)	(16.097)	5.778
(102)	(121)	(14)	(13)	(84)	(227)	(33)	(44)
0	0	0	0	0	0	0	0
(14.923)	(17.281)	0	0	0	0	0	0
(1.288)	(1.291)	0	0	0	0	0	0
(16.313)	(18.693)	(14)	(13)	(84)	(227)	(33)	(44)
(283.359)	(31.008)	(59.172)	(15.027)	(8.140)	(2.376)	(16.130)	5.734
4	3	0	0	(6)	(1)	0	0
0	0	0	0	0	0	0	0
(283.355)	(31.005)	(59.172)	(15.027)	(8.146)	(2.377)	(16.130)	5.734
€ (283.355)	€ (31.005)	€ (59.172)	€ (15.027)	€ (8.146)	€ (2.377)	€ (16.130)	€ 5.734

Betriebsergebnisrechnung (Forts.)

(Angaben in Tausend)	PIMCO European Short-Term Opportunities Fund		Global Advantage Fund	
	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2021	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2021
Erträge				
Zins- und Dividenderträge	€ 5.046	€ 3.844	\$ 19.358	\$ 14.187
Sonstige Erträge	0	0	0	0
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	(22.144)	567	(15.302)	6.980
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten	20.693	(5.157)	(16.446)	(5.241)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung	383	258	(143)	(55)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	(16.574)	(1.990)	(65.430)	(34.287)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten	2.641	(1.724)	2.911	(6.245)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus Fremdwährung	123	(1.434)	(46)	2.286
Gesamtanlageertrag/(-verlust)	(9.832)	(5.636)	(75.098)	(22.375)
Betriebskosten				
Verwaltungsgebühr	(1.114)	(1.503)	(3.204)	(3.733)
Servicegebühr	0	0	0	0
Bestandspflegegebühr	0	0	0	0
Sonstige Aufwendungen	0	0	(7)	(4)
Gesamtaufwendungen	(1.114)	(1.503)	(3.211)	(3.737)
Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft	90	129	0	0
Betriebskosten, netto	(1.024)	(1.374)	(3.211)	(3.737)
Anlageerträge/(-verluste), netto	(10.856)	(7.010)	(78.309)	(26.112)
Finanzierungskosten				
Zinsaufwendungen	(52)	(48)	(311)	(41)
Aufwand für Kreditfazilitäten	0	0	0	0
Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber	0	0	(3.851)	(3.124)
Nettoausgleichskredite und -gebühren	0	0	19	0
Summe Finanzierungskosten	(52)	(48)	(4.143)	(3.165)
Gewinne/(Verluste) im Geschäftsjahr vor Steuern	(10.908)	(7.058)	(82.452)	(29.277)
Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge	(1)	0	(28)	(17)
Kapitalertragsteuer	0	0	4	40
Gewinne/(Verluste) im Geschäftsjahr nach Steuern	(10.909)	(7.058)	(82.476)	(29.254)
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit	€ (10.909)	€ (7.058)	\$ (82.476)	\$ (29.254)

Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter tausend liegt. Alle Beträge ergeben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

Global Bond Fund		Global Bond ESG Fund		Global Bond Ex-US Fund		PIMCO Global Core Asset Allocation Fund	
Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2021	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2021	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2021	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2021
\$ 280.279	\$ 303.297	\$ 45.557	\$ 26.313	\$ 18.377	\$ 21.309	\$ 15.505	\$ 11.584
0	241	0	0	0	0	0	0
(472.968)	113.592	(191.964)	(4.030)	(26.490)	18.541	(53.006)	2.624
64.670	(143.992)	(1.708)	(39.838)	36.891	8.090	(108.236)	26.741
(37.039)	5.853	(6.537)	5.084	(2.783)	(1.997)	(849)	(2.110)
(1.518.236)	(920.990)	(179.201)	(95.675)	(98.263)	(69.872)	(30.206)	5.931
(349.556)	(118.386)	(74.875)	(5.207)	(19.836)	(1.298)	(34.286)	8.726
3.275	43.211	1.827	1.725	820	5.168	567	425
(2.029.575)	(717.174)	(406.901)	(111.628)	(91.284)	(20.059)	(210.511)	53.921
(73.778)	(96.239)	(11.828)	(9.410)	(4.332)	(5.259)	(10.327)	(10.596)
(1.350)	(1.868)	(38)	(51)	(29)	(65)	(31)	(34)
(118)	(90)	(3)	(11)	(57)	(58)	0	0
(149)	(219)	(3)	(2)	(4)	(1)	(2)	(1)
(75.395)	(98.416)	(11.872)	(9.474)	(4.422)	(5.383)	(10.360)	(10.631)
3.016	3.305	0	0	2	2	352	232
(72.379)	(95.111)	(11.872)	(9.474)	(4.420)	(5.381)	(10.008)	(10.399)
(2.101.954)	(812.285)	(418.773)	(121.102)	(95.704)	(25.440)	(220.519)	43.522
(1.977)	(1.103)	(463)	(16)	(268)	(61)	(235)	(24)
0	0	0	0	0	0	0	0
(28.813)	(31.940)	(7.667)	(5.279)	(1.708)	(1.880)	(2.897)	(3.010)
2.479	(554)	624	317	(133)	85	(516)	(231)
(28.311)	(33.597)	(7.506)	(4.978)	(2.109)	(1.856)	(3.648)	(3.265)
(2.130.265)	(845.882)	(426.279)	(126.080)	(97.813)	(27.296)	(224.167)	40.257
(366)	846	(45)	9	(10)	12	(721)	(96)
(9)	0	0	0	0	0	0	1
(2.130.640)	(845.036)	(426.324)	(126.071)	(97.823)	(27.284)	(224.888)	40.162
\$ (2.130.640)	\$ (845.036)	\$ (426.324)	\$ (126.071)	\$ (97.823)	\$ (27.284)	\$ (224.888)	\$ 40.162

Betriebsergebnisrechnung (Forts.)

(Angaben in Tausend)	Global High Yield Bond Fund		Global Investment Grade Credit Fund	
	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2021	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2021
Erträge				
Zins- und Dividenderträge	\$ 188.614	\$ 235.977	\$ 390.373	\$ 610.025
Sonstige Erträge	0	0	0	1.291
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	(169.761)	79.208	(661.979)	467.996
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten	(171.171)	(22.901)	(643.008)	(60.532)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung	(11.131)	2.640	(47.103)	(46.775)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	(601.507)	(217.798)	(1.965.880)	(1.518.257)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten	(8.034)	(46.486)	(65.555)	(342.238)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus Fremdwährung	432	(309)	3.046	6.325
Gesamtanlageertrag/(-verlust)	(772.558)	30.331	(2.990.106)	(882.165)
Betriebskosten				
Verwaltungsgebühr	(27.465)	(38.713)	(75.989)	(133.352)
Servicegebühr	(59)	(56)	(2.500)	(5.403)
Bestandspflegegebühr	(335)	(434)	(1.462)	(2.868)
Sonstige Aufwendungen	(62)	(80)	(154)	(276)
Gesamtaufwendungen	(27.921)	(39.283)	(80.105)	(141.899)
Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft	0	0	900	919
Betriebskosten, netto	(27.921)	(39.283)	(79.205)	(140.980)
Anlageerträge/(-verluste), netto	(800.479)	(8.952)	(3.069.311)	(1.023.145)
Finanzierungskosten				
Zinsaufwendungen	(436)	(44)	(2.270)	(683)
Aufwand für Kreditfazilitäten	(704)	(891)	0	0
Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber	(60.236)	(71.243)	(98.678)	(178.622)
Nettoausgleichskredite und -gebühren	(866)	620	(5.052)	(12.191)
Summe Finanzierungskosten	(62.242)	(71.558)	(106.000)	(191.496)
Gewinne/(Verluste) im Geschäftsjahr vor Steuern	(862.721)	(80.510)	(3.175.311)	(1.214.641)
Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge	0	0	(425)	(277)
Kapitalertragsteuer	0	0	(18)	0
Gewinne/(Verluste) im Geschäftsjahr nach Steuern	(862.721)	(80.510)	(3.175.754)	(1.214.918)
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit	\$ (862.721)	\$ (80.510)	\$ (3.175.754)	\$ (1.214.918)

Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter tausend liegt. Alle Beträge ergeben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

Global Investment Grade Credit ESG Fund		Global Low Duration Real Return Fund		Global Real Return Fund		Income Fund	
Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2021	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2021	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2021	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2021
\$ 38.525	\$ 13.337	\$ 88.002	\$ 44.076	\$ 281.845	\$ 120.963	\$ 2.324.046	\$ 2.333.029
0	0	0	0	0	0	0	1.183
(94.471)	456	(45.666)	15.275	(335.981)	72.666	(2.773.433)	535.116
(58.018)	(30.377)	14.927	(34.370)	206.342	(42.970)	1.069.480	331.534
(6.533)	2.946	(5.085)	3.055	(30.133)	4.703	(158.142)	(180.834)
(242.999)	(33.373)	(130.314)	(44.559)	(810.716)	(140.144)	(7.858.396)	(2.128.398)
7.204	6.412	14.994	3.426	862	22.146	491.740	(852.155)
327	(49)	(113)	(73)	(1.087)	(30)	(36.840)	47.526
(355.965)	(40.648)	(63.255)	(13.170)	(688.868)	37.334	(6.941.545)	87.001
(6.912)	(3.597)	(7.358)	(6.093)	(19.357)	(20.556)	(558.064)	(669.409)
(1)	0	(24)	(16)	(434)	(475)	(14.853)	(19.236)
(1.331)	(538)	0	0	(283)	(305)	(29.379)	(32.981)
(1)	0	(1)	(1)	(4)	(3)	(3.771)	(4.536)
(8.245)	(4.135)	(7.383)	(6.110)	(20.078)	(21.339)	(606.067)	(726.162)
0	0	0	0	0	0	1.010	1.032
(8.245)	(4.135)	(7.383)	(6.110)	(20.078)	(21.339)	(605.057)	(725.130)
(364.210)	(44.783)	(70.638)	(19.280)	(708.946)	15.995	(7.546.602)	(638.129)
(1.223)	(7)	(3.723)	(174)	(12.708)	(651)	(5.028)	(6.576)
0	0	0	0	0	0	0	0
(11.513)	(3.788)	(7.400)	(4.436)	(35.436)	(19.918)	(1.522.465)	(1.385.869)
707	765	12	202	(45)	(557)	(7.362)	11.585
(12.029)	(3.030)	(11.111)	(4.408)	(48.189)	(21.126)	(1.534.855)	(1.380.860)
(376.239)	(47.813)	(81.749)	(23.688)	(757.135)	(5.131)	(9.081.457)	(2.018.989)
(38)	(35)	0	0	7	9	(5.121)	2.865
0	0	0	0	(2)	0	(1.130)	0
(376.277)	(47.848)	(81.749)	(23.688)	(757.130)	(5.122)	(9.087.708)	(2.016.124)
\$ (376.277)	\$ (47.848)	\$ (81.749)	\$ (23.688)	\$ (757.130)	\$ (5.122)	\$ (9.087.708)	\$ (2.016.124)

Betriebsergebnisrechnung (Forts.)

(Angaben in Tausend)	Income Fund II		Inflation Multi-Asset Fund ⁽¹⁾	
	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Berichtszeitraum vom 29. Jan. 2021 bis 31. Dez. 2021	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2021
Erträge				
Zins- und Dividendenerträge	\$ 1.453	\$ 604	\$ 18.013	\$ 3.691
Sonstige Erträge	0	0	0	0
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	(1.292)	49	(11.601)	2.554
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten	591	244	(14.589)	3.856
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung	29	(23)	(1.046)	17
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	(3.257)	(416)	(43.168)	(16)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten	307	51	3.742	(1.199)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus Fremdwährung	(18)	(1)	46	(25)
Gesamtanlageertrag/(-verlust)	(2.187)	508	(48.603)	8.878
Betriebskosten				
Verwaltungsgebühr	(362)	(139)	(4.863)	(1.293)
Servicegebühr	0	0	0	0
Bestandspflegegebühr	0	0	(41)	0
Sonstige Aufwendungen	(2)	(1)	0	0
Gesamtaufwendungen	(364)	(140)	(4.904)	(1.293)
Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft	0	0	0	0
Betriebskosten, netto	(364)	(140)	(4.904)	(1.293)
Anlageerträge/(-verluste), netto	(2.551)	368	(53.507)	7.585
Finanzierungskosten				
Zinsaufwendungen	(2)	0	(42)	(6)
Aufwand für Kreditfazilitäten	0	0	0	0
Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber	(828)	(26)	(732)	(59)
Nettoausgleichskredite und -gebühren	(88)	1	50	10
Summe Finanzierungskosten	(918)	(25)	(724)	(55)
Gewinne/(Verluste) im Geschäftsjahr vor Steuern	(3.469)	343	(54.231)	7.530
Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge	(6)	(1)	(369)	(216)
Kapitalertragsteuer	0	0	0	0
Gewinne/(Verluste) im Geschäftsjahr nach Steuern	(3.475)	342	(54.600)	7.314
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit	\$ (3.475)	\$ 342	\$ (54.600)	\$ 7.314

Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter tausend liegt. Alle Beträge ergeben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

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

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

Low Average Duration Fund		Low Duration Global Investment Grade Credit Fund		Low Duration Income Fund		Low Duration Opportunities Fund ⁽²⁾	
Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2021	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2021	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2021	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2021
\$ 25.484	\$ 10.934	\$ 14.422	\$ 12.323	\$ 39.539	\$ 29.025	\$ 55.391	\$ 46.121
0	0	0	0	0	0	0	0
(42.813)	(667)	(20.974)	5.594	(56.562)	3.984	(193.300)	(3.632)
10.878	(648)	(52.392)	(34.845)	(38.394)	(42.131)	(377.025)	3.043
(1.316)	238	(1.354)	1.207	(394)	999	(6.253)	5.878
(57.779)	(19.422)	(35.028)	(32.530)	(91.374)	(33.323)	(143.747)	(85.789)
(1.564)	(1.183)	(1.725)	(4.922)	4.463	5.278	(76.554)	3.555
253	98	115	(8)	(601)	440	132	(42)
(66.857)	(10.650)	(96.936)	(53.181)	(143.323)	(35.728)	(741.356)	(30.866)
(7.440)	(6.488)	(3.531)	(3.868)	(7.436)	(6.354)	(13.186)	(15.019)
(84)	(125)	0	0	(1)	(1)	(20)	(47)
(59)	(66)	0	0	0	0	0	0
(3)	(1)	(1)	(1)	(2)	(2)	(7)	(4)
(7.586)	(6.680)	(3.532)	(3.869)	(7.439)	(6.357)	(13.213)	(15.070)
169	172	0	0	0	0	214	218
(7.417)	(6.508)	(3.532)	(3.869)	(7.439)	(6.357)	(12.999)	(14.852)
(74.274)	(17.158)	(100.468)	(57.050)	(150.762)	(42.085)	(754.355)	(45.718)
(1.538)	(6)	(323)	(10)	(200)	(9)	(379)	(17)
0	0	0	0	0	0	0	0
(985)	(387)	(399)	(172)	(4.686)	(4.989)	(7.886)	(7.775)
51	(9)	3	20	(564)	64	104	378
(2.472)	(402)	(719)	(162)	(5.450)	(4.934)	(8.161)	(7.414)
(76.746)	(17.560)	(101.187)	(57.212)	(156.212)	(47.019)	(762.516)	(53.132)
(33)	(2)	0	0	(5)	11	(87)	(41)
0	0	0	0	0	0	(7)	0
(76.779)	(17.562)	(101.187)	(57.212)	(156.217)	(47.008)	(762.610)	(53.173)
\$ (76.779)	\$ (17.562)	\$ (101.187)	\$ (57.212)	\$ (156.217)	\$ (47.008)	\$ (762.610)	\$ (53.173)

Betriebsergebnisrechnung (Forts.)

(Angaben in Tausend)

	Low Duration Opportunities ESG Fund	PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	
	Berichtszeitraum vom 27. Jul. 2022 bis 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2021
Erträge			
Zins- und Dividenderträge	\$ 62	\$ 4.517	\$ 1.742
Sonstige Erträge	0	0	0
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	2	12.875	2.539
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten	(37)	9.251	13.480
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung	9	(73)	(103)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	(22)	(1.853)	8.412
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten	(45)	815	3.523
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus Fremdwährung	1	3	(4)
Gesamtanlageertrag/(-verlust)	(30)	25.535	29.589
Betriebskosten			
Verwaltungsgebühr	(11)	(1.351)	(891)
Servicegebühr	0	0	(5)
Bestandspflegegebühr	0	0	0
Sonstige Aufwendungen	0	0	0
Gesamtaufwendungen	(11)	(1.351)	(896)
Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft	0	0	0
Betriebskosten, netto	(11)	(1.351)	(896)
Anlageerträge/(-verluste), netto	(41)	24.184	28.693
Finanzierungskosten			
Zinsaufwendungen	0	(21)	(1)
Aufwand für Kreditfazilitäten	0	0	0
Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber	0	(1.973)	(2.326)
Nettoausgleichskredite und -gebühren	0	(158)	(52)
Summe Finanzierungskosten	0	(2.152)	(2.379)
Gewinne/(Verluste) im Geschäftsjahr vor Steuern	(41)	22.032	26.314
Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge	0	(1.066)	(524)
Kapitalertragsteuer	0	0	0
Gewinne/(Verluste) im Geschäftsjahr nach Steuern	(41)	20.966	25.790
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit	\$ (41)	\$ 20.966	\$ 25.790

Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter tausend liegt. Alle Beträge ergeben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

Mortgage Opportunities Fund		StocksPLUS™ Fund		PIMCO StocksPLUS™ AR Fund		Strategic Income Fund	
Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2021	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2021	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2021	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2021
\$ 64.142	\$ 61.815	\$ 33.258	\$ 21.704	\$ 200	\$ 89	\$ 24.332	\$ 32.261
0	0	0	0	0	0	0	329
(104.200)	(9.000)	(81.088)	9.276	(38)	57	(10.791)	77.423
(29.390)	(12.983)	(489.873)	865.225	(2.250)	2.395	(40.272)	(37.734)
(5.448)	1.494	(4.542)	6.220	18	(6)	(504)	(97)
(167.826)	(47.271)	(73.113)	(43.299)	(374)	(163)	(66.591)	(52.104)
(16.819)	21.700	(87.127)	(90.840)	(231)	125	16.280	(8.337)
(1.441)	(107)	(18)	115	0	1	(284)	868
(260.982)	15.648	(702.503)	768.401	(2.675)	2.498	(77.830)	12.609
(9.762)	(12.411)	(12.870)	(19.756)	(73)	(71)	(7.425)	(9.903)
(116)	(225)	(60)	(70)	0	0	0	0
(1)	(3)	0	0	0	0	0	0
(17)	(4)	(6)	(13)	0	0	(105)	(119)
(9.896)	(12.643)	(12.936)	(19.839)	(73)	(71)	(7.530)	(10.022)
0	0	0	0	1	1	0	0
(9.896)	(12.643)	(12.936)	(19.839)	(72)	(70)	(7.530)	(10.022)
(270.878)	3.005	(715.439)	748.562	(2.747)	2.428	(85.360)	2.587
(7.142)	(154)	(199)	(108)	0	(1)	(225)	(111)
0	0	0	0	0	0	0	0
(9.330)	(12.279)	(218)	0	0	0	(5.529)	(5.762)
(159)	45	(322)	35	0	0	171	(41)
(16.631)	(12.388)	(739)	(73)	0	(1)	(5.583)	(5.914)
(287.509)	(9.383)	(716.178)	748.489	(2.747)	2.427	(90.943)	(3.327)
0	0	10	(14)	0	0	(1.177)	(1.700)
0	0	0	0	0	0	(9)	0
(287.509)	(9.383)	(716.168)	748.475	(2.747)	2.427	(92.129)	(5.027)
\$ (287.509)	\$ (9.383)	\$ (716.168)	\$ 748.475	\$ (2.747)	\$ 2.427	\$ (92.129)	\$ (5.027)

Betriebsergebnisrechnung (Forts.)

(Angaben in Tausend)	Total Return Bond Fund		PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	
	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2021	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2021
Erträge				
Zins- und Dividenderträge	\$ 114.210	\$ 117.233	\$ 3.645	\$ 202
Sonstige Erträge	0	0	0	0
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	(308.687)	21.935	(4.374)	(25)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten	18.095	(66.800)	1.422	(207)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung	(10.559)	8.396	(599)	(302)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	(628.624)	(271.256)	4.540	(79)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten	2.689	(18.674)	(7.427)	1.783
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus Fremdwährung	(795)	(37)	(70)	5
Gesamtanlageertrag/(-verlust)	(813.671)	(209.203)	(2.863)	1.377
Betriebskosten				
Verwaltungsgebühr	(32.300)	(44.468)	(2.340)	(1.202)
Servicegebühr	(1.509)	(2.011)	0	0
Bestandspflegegebühr	(722)	(892)	0	0
Sonstige Aufwendungen	(44)	(69)	0	0
Gesamtaufwendungen	(34.575)	(47.440)	(2.340)	(1.202)
Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft	512	1.159	25	7
Betriebskosten, netto	(34.063)	(46.281)	(2.315)	(1.195)
Anlageerträge/(-verluste), netto	(847.734)	(255.484)	(5.178)	182
Finanzierungskosten				
Zinsaufwendungen	(857)	(74)	(89)	(20)
Aufwand für Kreditfazilitäten	0	0	0	0
Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber	(14.771)	(14.602)	(319)	0
Nettoausgleichskredite und -gebühren	138	(47)	159	0
Summe Finanzierungskosten	(15.490)	(14.723)	(249)	(20)
Gewinne/(Verluste) im Geschäftsjahr vor Steuern	(863.224)	(270.207)	(5.427)	162
Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge	(288)	(84)	0	0
Kapitalertragsteuer	0	0	0	0
Gewinne/(Verluste) im Geschäftsjahr nach Steuern	(863.512)	(270.291)	(5.427)	162
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit	\$ (863.512)	\$ (270.291)	\$ (5.427)	\$ 162

Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter tausend liegt. Alle Beträge ergeben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

UK Corporate Bond Fund		UK Long Term Corporate Bond Fund		US High Yield Bond Fund		US Investment Grade Corporate Bond Fund	
Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2021	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2021	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2021	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2021
£ 11.760	£ 13.061	£ 11.151	£ 10.633	\$ 156.507	\$ 201.773	\$ 18.748	\$ 33.144
0	0	0	0	0	0	0	0
(30.472)	12.821	(27.835)	8.091	(135.436)	33.353	(82.238)	7.951
(18.338)	3.235	(26.173)	665	(77.001)	(23.016)	(42.587)	(19.621)
(25)	(1.263)	131	(808)	(1.909)	586	(237)	42
(66.723)	(47.407)	(80.017)	(30.310)	(441.841)	(56.784)	(56.269)	(59.491)
3.502	(2.700)	1.687	(487)	3.016	(17.594)	(8.065)	(10.285)
96	61	79	148	51	(33)	93	132
(100.200)	(22.192)	(120.977)	(12.068)	(496.613)	138.285	(170.555)	(48.128)
(1.843)	(2.498)	(1.596)	(1.827)	(18.237)	(26.847)	(2.797)	(5.417)
0	0	0	0	(1.231)	(1.558)	0	0
0	0	0	0	0	0	0	0
(1)	(1)	(2)	(1)	(10)	(5)	(1)	(1)
(1.844)	(2.499)	(1.598)	(1.828)	(19.478)	(28.410)	(2.798)	(5.418)
12	126	0	5	0	0	0	0
(1.832)	(2.373)	(1.598)	(1.823)	(19.478)	(28.410)	(2.798)	(5.418)
(102.032)	(24.565)	(122.575)	(13.891)	(516.091)	109.875	(173.353)	(53.546)
(164)	(32)	(76)	(31)	(38)	(94)	(42)	(42)
0	0	0	0	(553)	(616)	0	0
(7.385)	(7.318)	(1.401)	(1.320)	(28.068)	(32.603)	(6.002)	(17.509)
147	(330)	0	0	(1.127)	1.195	(1.021)	(369)
(7.402)	(7.680)	(1.477)	(1.351)	(29.786)	(32.118)	(7.065)	(17.920)
(109.434)	(32.245)	(124.052)	(15.242)	(545.877)	77.757	(180.418)	(71.466)
6	14	0	2	(22)	0	(60)	(57)
0	0	0	0	0	0	0	0
(109.428)	(32.231)	(124.052)	(15.240)	(545.899)	77.757	(180.478)	(71.523)
£ (109.428)	£ (32.231)	£ (124.052)	£ (15.240)	\$ (545.899)	\$ 77.757	\$ (180.478)	\$ (71.523)

Betriebsergebnisrechnung (Forts.)

(Angaben in Tausend)

	US Short-Term Fund		Summe der Gesellschaft*	
	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2021	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2021
Erträge				
Zins- und Dividendenerträge	\$ 55.566	\$ 31.255	\$ 6.178.757	\$ 6.303.134
Sonstige Erträge	0	72	0	3.116
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	(71.854)	13.161	(8.968.907)	2.413.798
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten	58.715	(4.690)	(2.110.326)	(14.600)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung	(2.268)	2.843	(570.612)	(290.548)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	(75.579)	(51.366)	(21.700.661)	(8.960.122)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten	16.121	(6.311)	(473.258)	(1.793.785)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus Fremdwährung	(37)	852	(34.364)	137.404
Gesamtanlageertrag/(-verlust)	(19.336)	(14.184)	(27.679.371)	(2.201.603)
Betriebskosten				
Verwaltungsgebühr	(10.218)	(11.997)	(1.395.118)	(1.794.845)
Servicegebühr	(51)	(76)	(25.946)	(36.004)
Bestandspflegegebühr	0	0	(36.489)	(41.978)
Sonstige Aufwendungen	(3)	(3)	(6.292)	(7.868)
Gesamtaufwendungen	(10.272)	(12.076)	(1.463.845)	(1.880.695)
Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft	874	1.085	12.309	17.786
Betriebskosten, netto	(9.398)	(10.991)	(1.451.536)	(1.862.909)
Anlageerträge/(-verluste), netto	(28.734)	(25.175)	(29.130.907)	(4.064.512)
Finanzierungskosten				
Zinsaufwendungen	(1.332)	(37)	(69.903)	(26.834)
Aufwand für Kreditfazilitäten	0	0	(1.257)	(1.507)
Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber	(15.307)	(10.146)	(2.279.520)	(2.292.758)
Nettoausgleichskredite und -gebühren	896	(135)	(23.010)	5.675
Summe Finanzierungskosten	(15.743)	(10.318)	(2.373.690)	(2.315.424)
Gewinne/(Verluste) im Geschäftsjahr vor Steuern	(44.477)	(35.493)	(31.504.597)	(6.379.936)
Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge	1	12	(21.859)	(9.779)
Kapitalertragsteuer	0	0	(1.417)	747
Gewinne/(Verluste) im Geschäftsjahr nach Steuern	(44.476)	(35.481)	(31.527.873)	(6.388.968)
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit	\$ (44.476)	\$ (35.481)	\$ (31.527.873)	\$ (6.388.968)

Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter tausend liegt. Alle Beträge ergeben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

* Die Summe der Gesellschaft für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 und zum 31. Dezember 2021 wurde bereinigt, um Überkreuzinvestitionen und Salden im Namen der Gesellschaft zu eliminieren. Nähere Einzelheiten zu Überkreuzinvestitionen sind Erläuterung 14 in den Erläuterungen zum Abschluss zu entnehmen.

(Diese Seite wurde absichtlich freigelassen.)

Ausweis der Nettovermögensänderungen

(Angaben in Tausend)	PIMCO Asia High Yield Bond Fund		Asia Strategic Interest Bond Fund		PIMCO Capital Securities Fund	
	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2021	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2021	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2021
Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres	\$ 3.411.923	\$ 890.928	\$ 361.011	\$ 167.716	\$ 9.110.409	\$ 7.958.322
Erlöse aus ausgegebenen Anteilen	2.053.140	3.621.247	98.659	259.978	1.684.526	4.540.326
Erlöse aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	10.176	1.386	762	112	10.326	9.607
Zahlungen für zurückgenommene Anteile	(1.858.479)	(765.332)	(89.514)	(41.694)	(3.728.874)	(3.434.342)
Nominalwechselkursanpassungen	0	0	0	0	0	0
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit	(635.368)	(336.306)	(56.931)	(25.101)	(1.354.796)	36.496
Nettovermögen zum Ende des Geschäftsjahres	\$ 2.981.392	\$ 3.411.923	\$ 313.987	\$ 361.011	\$ 5.721.591	\$ 9.110.409
	Diversified Income Duration Hedged Fund		Diversified Income ESG Fund		Dynamic Bond Fund	
	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2021	Berichtszeitraum vom 27. Jul. 2022 bis 31. Dez. 2022		Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2021
Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres	\$ 1.305.365	\$ 1.486.931	\$ 0		\$ 3.277.997	\$ 3.204.860
Erlöse aus ausgegebenen Anteilen	68.633	448.782	9.954		1.763.140	1.528.096
Erlöse aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	34	23	0		1.413	1.696
Zahlungen für zurückgenommene Anteile	(612.551)	(596.657)	0		(1.068.332)	(1.343.284)
Nominalwechselkursanpassungen	0	0	0		0	0
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit	(196.797)	(33.714)	(100)		(490.617)	(113.371)
Nettovermögen zum Ende des Geschäftsjahres	\$ 564.684	\$ 1.305.365	\$ 9.854		\$ 3.483.601	\$ 3.277.997
	Emerging Markets Bond ESG Fund		Emerging Markets Corporate Bond Fund		PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	
	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2021	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2021	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2021
Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres	\$ 2.635.769	\$ 1.441.457	\$ 212.894	\$ 261.236	\$ 290.475	\$ 220.309
Erlöse aus ausgegebenen Anteilen	1.511.574	2.226.780	26.594	42.380	167.062	157.673
Erlöse aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	2.170	47	0	0	20	0
Zahlungen für zurückgenommene Anteile	(948.773)	(825.918)	(30.165)	(72.401)	(212.974)	(61.901)
Nominalwechselkursanpassungen	0	0	0	0	0	0
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit	(708.265)	(206.597)	(40.337)	(18.321)	(39.452)	(25.606)
Nettovermögen zum Ende des Geschäftsjahres	\$ 2.492.475	\$ 2.635.769	\$ 168.986	\$ 212.894	\$ 205.131	\$ 290.475

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

PIMCO Climate Bond Fund		Commodity Real Return Fund		PIMCO Credit Opportunities Bond Fund		Diversified Income Fund	
Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2021	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2021	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2021	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2021
\$ 328.081	\$ 101.869	\$ 1.444.182	\$ 325.109	\$ 139.704	\$ 144.512	\$ 16.447.733	\$ 18.641.861
140.136	278.727	1.475.400	1.354.368	9.058	22.812	1.896.447	6.270.901
136	6	0	0	0	0	16.545	18.607
(101.860)	(32.957)	(1.623.269)	(401.731)	(38.655)	(23.013)	(6.169.181)	(7.562.529)
0	0	0	0	0	0	0	0
(73.838)	(19.564)	73.564	166.436	(12.954)	(4.607)	(3.439.748)	(921.107)
\$ 292.655	\$ 328.081	\$ 1.369.877	\$ 1.444.182	\$ 97.153	\$ 139.704	\$ 8.751.796	\$ 16.447.733
Dynamic Multi-Asset Fund		Emerging Local Bond Fund		Emerging Local Bond ESG Fund		Emerging Markets Bond Fund	
Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2021	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2021	Berichtszeitraum vom 27. Jul. 2022 bis 31. Dez. 2022		Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2021
€ 7.635.950	€ 5.128.926	\$ 2.151.129	\$ 2.849.284	\$ 0		\$ 4.714.744	\$ 5.263.015
862.412	4.955.709	803.400	1.175.064	6.206		1.975.229	2.839.067
92	91	1.998	1.937	1		3.115	3.750
(2.381.432)	(2.465.349)	(864.659)	(1.635.674)	0		(2.402.706)	(3.028.013)
0	0	0	0	0		0	0
(1.001.852)	16.573	(172.200)	(239.482)	402		(984.403)	(363.075)
€ 5.115.170	€ 7.635.950	\$ 1.919.668	\$ 2.151.129	\$ 6.609		\$ 3.305.979	\$ 4.714.744
Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund		PIMCO ESG Income Fund		Euro Bond Fund		Euro Credit Fund	
Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2021	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Berichtszeitraum vom 29. Apr. 2021 bis 31. Dez. 2021	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2021	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2021
\$ 29.760	\$ 32.571	\$ 125.087	\$ 0	€ 2.574.129	€ 3.243.455	€ 1.017.163	€ 1.150.058
8.145	26.458	172.394	132.126	335.598	582.897	434.310	464.795
0	0	465	36	0	0	320	464
(15.231)	(27.908)	(38.588)	(3.924)	(595.105)	(1.157.130)	(673.784)	(584.243)
0	0	0	0	0	0	0	0
(1.737)	(1.361)	(21.397)	(3.151)	(401.347)	(95.093)	(168.001)	(13.911)
\$ 20.937	\$ 29.760	\$ 237.961	\$ 125.087	€ 1.913.275	€ 2.574.129	€ 610.008	€ 1.017.163

Ausweis der Nettovermögensänderungen (Forts.)

(Angaben in Tausend)	Euro Income Bond Fund		Euro Long Average Duration Fund		Euro Short-Term Fund	
	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2021	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2021	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2021
Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres	€ 2.482.304	€ 3.182.867	€ 160.601	€ 182.461	€ 629.859	€ 807.538
Erlöse aus ausgegebenen Anteilen	446.648	750.472	40.010	56.603	249.387	218.558
Erlöse aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	1.221	1.337	0	0	0	0
Zahlungen für zurückgenommene Anteile	(1.293.838)	(1.421.367)	(31.391)	(63.436)	(518.005)	(393.860)
Nominalwechselkursanpassungen	0	0	0	0	0	0
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit	(283.355)	(31.005)	(59.172)	(15.027)	(8.146)	(2.377)
Nettovermögen zum Ende des Geschäftsjahres	€ 1.352.980	€ 2.482.304	€ 110.048	€ 160.601	€ 353.095	€ 629.859
	Global Bond ESG Fund		Global Bond Ex-US Fund		PIMCO Global Core Asset Allocation Fund	
	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2021	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2021	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2021
Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres	\$ 2.302.966	\$ 1.509.594	\$ 911.707	\$ 929.980	\$ 1.035.021	\$ 702.430
Erlöse aus ausgegebenen Anteilen	1.882.825	1.385.787	307.762	336.178	175.286	453.398
Erlöse aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	4.271	2.544	678	823	7	11
Zahlungen für zurückgenommene Anteile	(657.548)	(468.888)	(406.302)	(327.990)	(235.350)	(160.980)
Nominalwechselkursanpassungen	0	0	0	0	0	0
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit	(426.324)	(126.071)	(97.823)	(27.284)	(224.888)	40.162
Nettovermögen zum Ende des Geschäftsjahres	\$ 3.106.190	\$ 2.302.966	\$ 716.022	\$ 911.707	\$ 750.076	\$ 1.035.021
	Global Real Return Fund		Income Fund		Income Fund II	
	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2021	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2021	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Berichtszeitraum vom 29. Jan. 2021 bis 31. Dez. 2021
Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres	\$ 3.703.379	\$ 2.578.062	\$ 73.579.726	\$ 71.275.311	\$ 27.770	\$ 0
Erlöse aus ausgegebenen Anteilen	881.779	2.198.876	18.117.060	32.285.151	35.679	27.404
Erlöse aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	4.676	3.062	124.031	91.069	62	25
Zahlungen für zurückgenommene Anteile	(1.260.842)	(1.071.499)	(24.752.782)	(28.055.681)	(3.413)	(1)
Nominalwechselkursanpassungen	0	0	0	0	0	0
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit	(757.130)	(5.122)	(9.087.708)	(2.016.124)	(3.475)	342
Nettovermögen zum Ende des Geschäftsjahres	\$ 2.571.862	\$ 3.703.379	\$ 57.980.327	\$ 73.579.726	\$ 56.623	\$ 27.770

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

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

PIMCO European High Yield Bond Fund		PIMCO European Short-Term Opportunities Fund		Global Advantage Fund		Global Bond Fund	
Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2021	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2021	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2021	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2021
€ 170.489	€ 162.061	€ 395.491	€ 350.749	\$ 521.067	\$ 524.284	\$ 14.038.846	\$ 16.302.309
37.975	8.086	69.639	205.761	25.733	76.128	3.949.985	4.180.638
0	0	0	0	0	0	3.168	2.549
(18.172)	(5.392)	(243.049)	(153.961)	(53.865)	(50.091)	(4.441.247)	(5.601.614)
0	0	0	0	0	0	0	0
(16.130)	5.734	(10.909)	(7.058)	(82.476)	(29.254)	(2.130.640)	(845.036)
€ 174.162	€ 170.489	€ 211.172	€ 395.491	\$ 410.459	\$ 521.067	\$ 11.420.112	\$ 14.038.846
Global High Yield Bond Fund		Global Investment Grade Credit Fund		Global Investment Grade Credit ESG Fund		Global Low Duration Real Return Fund	
Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2021	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2021	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2021	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2021
\$ 5.169.160	\$ 5.403.543	\$ 17.154.925	\$ 28.178.170	\$ 1.189.563	\$ 332.010	\$ 1.199.076	\$ 787.871
1.424.841	3.122.850	3.907.121	7.389.072	1.086.602	1.213.204	1.093.289	741.595
2.721	3.266	4.308	10.357	366	574	2	2
(2.631.133)	(3.279.989)	(7.352.259)	(17.207.756)	(530.364)	(308.377)	(846.243)	(306.704)
0	0	0	0	0	0	0	0
(862.721)	(80.510)	(3.175.754)	(1.214.918)	(376.277)	(47.848)	(81.749)	(23.688)
\$ 3.102.868	\$ 5.169.160	\$ 10.538.341	\$ 17.154.925	\$ 1.369.890	\$ 1.189.563	\$ 1.364.375	\$ 1.199.076
Inflation Multi-Asset Fund ⁽¹⁾		Low Average Duration Fund		Low Duration Global Investment Grade Credit Fund		Low Duration Income Fund	
Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2021	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2021	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2021	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2021
\$ 164.345	\$ 70.032	\$ 1.179.138	\$ 1.183.413	\$ 806.869	\$ 632.519	\$ 1.367.475	\$ 960.639
474.503	115.894	1.413.022	688.563	182.884	382.649	597.584	746.949
230	0	309	83	254	0	67	26
(181.400)	(28.895)	(1.442.932)	(675.359)	(234.071)	(151.087)	(724.529)	(293.131)
0	0	0	0	0	0	0	0
(54.600)	7.314	(76.779)	(17.562)	(101.187)	(57.212)	(156.217)	(47.008)
\$ 403.078	\$ 164.345	\$ 1.072.758	\$ 1.179.138	\$ 654.749	\$ 806.869	\$ 1.084.380	\$ 1.367.475

Ausweis der Nettovermögensänderungen (Forts.)

(Angaben in Tausend)	Low Duration Opportunities Fund ⁽²⁾		Low Duration Opportunities ESG Fund		PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	
	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2021	Berichtszeitraum vom 27. Jul. 2022 bis 31. Dez. 2022		Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2021
Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres	\$ 3.217.260	\$ 2.644.601	\$ 0		\$ 100.538	\$ 77.631
Erlöse aus ausgegebenen Anteilen	880.588	1.559.905	4.969		78.857	44.785
Erlöse aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	869	643	0		6	1
Zahlungen für zurückgenommene Anteile	(1.990.326)	(934.716)	0		(80.230)	(47.669)
Nominalwechselkursanpassungen	0	0	0		0	0
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit	(762.610)	(53.173)	(41)		20.966	25.790
Nettovermögen zum Ende des Geschäftsjahres	\$ 1.345.781	\$ 3.217.260	\$ 4.928		\$ 120.137	\$ 100.538
	Total Return Bond Fund		PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund		UK Corporate Bond Fund	
	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2021	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2021	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2021
Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres	\$ 4.944.898	\$ 6.424.053	\$ 101.789	\$ 47.221	£ 592.164	£ 764.359
Erlöse aus ausgegebenen Anteilen	1.455.704	1.468.936	446.424	79.518	89.056	202.988
Erlöse aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	8.134	7.905	2	0	1	15
Zahlungen für zurückgenommene Anteile	(1.394.507)	(2.685.705)	(106.864)	(25.112)	(182.620)	(342.967)
Nominalwechselkursanpassungen	0	0	0	0	0	0
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit	(863.512)	(270.291)	(5.427)	162	(109.428)	(32.231)
Nettovermögen zum Ende des Geschäftsjahres	\$ 4.150.717	\$ 4.944.898	\$ 435.924	\$ 101.789	£ 389.173	£ 592.164
	Summe der Gesellschaft*					
	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2021				
Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres	\$ 209.342.798	\$ 215.950.477				
Erlöse aus ausgegebenen Anteilen	59.195.422	99.474.968				
Erlöse aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	229.935	197.894				
Zahlungen für zurückgenommene Anteile	(84.448.259)	(98.628.652)				
Nominalwechselkursanpassungen	(1.267.504)	(1.262.921)				
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit	(31.527.873)	(6.388.968)				
Nettovermögen zum Ende des Geschäftsjahres	\$ 151.524.519	\$ 209.342.798				

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

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

* Die Summe der Gesellschaft für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 und zum 31. Dezember 2021 wurde bereinigt, um Überkreuzinvestitionen und Salden im Namen der Gesellschaft zu eliminieren. Nähere Einzelheiten zu Überkreuzinvestitionen sind Erläuterung 14 in den Erläuterungen zum Abschluss zu entnehmen.

Mortgage Opportunities Fund		StocksPLUS™ Fund		PIMCO StocksPLUS™ AR Fund		Strategic Income Fund	
Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2021	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2021	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2021	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2021
\$ 2.238.424	\$ 1.977.007	\$ 3.761.156	\$ 3.538.833	\$ 11.610	\$ 8.417	\$ 619.928	\$ 974.664
944.728	1.194.468	951.977	2.271.566	1.511	1.145	179.697	190.976
4.620	4.404	215	0	0	0	15	11
(2.051.115)	(928.072)	(2.988.441)	(2.797.718)	(846)	(379)	(200.954)	(540.696)
0	0	0	0	0	0	0	0
(287.509)	(9.383)	(716.168)	748.475	(2.747)	2.427	(92.129)	(5.027)
\$ 849.148	\$ 2.238.424	\$ 1.008.739	\$ 3.761.156	\$ 9.528	\$ 11.610	\$ 506.557	\$ 619.928
UK Long Term Corporate Bond Fund		US High Yield Bond Fund		US Investment Grade Corporate Bond Fund		US Short-Term Fund	
Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2021	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2021	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2021	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2021
£ 425.748	£ 364.631	\$ 3.923.786	\$ 4.054.927	\$ 878.100	\$ 1.180.148	\$ 2.650.198	\$ 3.654.185
108.291	124.748	744.251	2.106.890	223.870	349.575	1.278.210	1.086.979
2	743	5.395	6.919	3.292	13.646	13.355	9.488
(84.969)	(49.134)	(2.142.611)	(2.322.707)	(536.262)	(593.746)	(1.587.172)	(2.064.973)
0	0	0	0	0	0	0	0
(124.052)	(15.240)	(545.899)	77.757	(180.478)	(71.523)	(44.476)	(35.481)
£ 325.020	£ 425.748	\$ 1.984.922	\$ 3.923.786	\$ 388.522	\$ 878.100	\$ 2.310.115	\$ 2.650.198

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
Yanlord Land HK Co. Ltd. 5,125 % fällig am 20.05.2026	\$ 36.999	\$30.940	1,04	MAURITIUS UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Globe Telecom, Inc. 3,000 % fällig am 23.07.2035	\$ 15.850	\$11.537	0,39
		181.184	6,08	CA Magnum Holdings 5,375 % fällig am 31.10.2026	\$ 31.760	\$29.020	0,97	4,200 % fällig am 02.08.2026 (d)	24.100	21.630	0,73
Summe Hongkong		181.885	6,10	Greenko Dutch BV 3,850 % fällig am 29.03.2026	8.977	7.810	0,26	ICTSI Treasury BV 3,500 % fällig am 16.11.2031	2.000	1.545	0,05
INDIEN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Greenko Investment Co. 4,875 % fällig am 16.08.2023	24.932	24.464	0,82	Petron Corp. 5,950 % fällig am 19.04.2026 (d)	5.200	4.467	0,15
Adani Green Energy Ltd. 4,375 % fällig am 08.09.2024	4.800	4.368	0,15	Greenko Mauritius Ltd. 6,250 % fällig am 21.02.2023	1.820	1.813	0,06	Royal Capital BV 4,875 % fällig am 05.05.2024 (d)	10.571	10.170	0,34
Adani Green Energy UP Ltd. 6,250 % fällig am 10.12.2024	12.041	11.764	0,39	Greenko Solar Mauritius Ltd. 5,550 % fällig am 29.01.2025	4.900	4.624	0,15	5,000 % fällig am 05.02.2026 (d)	900	838	0,03
GMR Hyderabad International Airport Ltd. 4,250 % fällig am 27.10.2027	9.878	8.570	0,29	5,950 % fällig am 29.07.2026	24.600	22.540	0,76	San Miguel Corp. 5,500 % fällig am 29.07.2025 (d)	10.150	8.894	0,30
4,750 % fällig am 02.02.2026	25.175	23.546	0,79	Greenko Wind Projects Mauritius Ltd. 5,500 % fällig am 06.04.2025	45.700	42.908	1,44	SMC Global Power Holdings Corp. 5,450 % fällig am 09.12.2026 (d)	9.875	6.616	0,22
JSW Hydro Energy Ltd. 4,125 % fällig am 18.05.2031	19.160	15.998	0,54	India Airport Infra 6,250 % fällig am 25.10.2025	2.400	2.300	0,08	5,700 % fällig am 21.01.2026 (d)	3.754	2.684	0,09
JSW Steel Ltd. 5,050 % fällig am 05.04.2032	2.100	1.661	0,06	India Clean Energy Holdings 4,500 % fällig am 18.04.2027	7.950	6.284	0,21	5,950 % fällig am 05.05.2025 (d)	9.000	6.615	0,22
5,950 % fällig am 18.04.2024	1.000	996	0,03	India Green Energy Holdings 5,375 % fällig am 29.04.2024	32.073	30.878	1,04	7,000 % fällig am 21.10.2025 (d)	16.884	12.916	0,43
Muthoot Finance Ltd. 4,400 % fällig am 02.09.2023	32.662	32.178	1,08	India Green Power Holdings 4,000 % fällig am 22.02.2027	23.702	20.304	0,68	Summe Philippinen		105.353	3,53
Periama Holdings LLC 5,950 % fällig am 19.04.2026	59.600	55.840	1,87	India Toll Roads 5,500 % fällig am 19.08.2024	23.043	22.292	0,75	SINGAPUR UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
ReNew Power Pvt Ltd. 5,875 % fällig am 18.07.2027	6.220	5.979	0,20	Summe Mauritius		215.237	7,22	ABJA Investment Co. Pte. Ltd. 5,450 % fällig am 24.01.2028	7.650	7.477	0,25
ReNew Wind Energy AP2 4,500 % fällig am 14.07.2028	15.188	12.763	0,43	MEXIKO UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Clean Renewable Power Mauritius Pte. Ltd. 4,250 % fällig am 25.03.2027	7.115	6.184	0,21
Shriram Finance Ltd. 4,150 % fällig am 18.07.2025	6.956	6.417	0,21	Banco Mercantil del Norte S.A. 5,875 % fällig am 24.01.2027 (d)(f)	8.050	7.193	0,24	Continuum Energy Levanter Pte. Ltd. 4,500 % fällig am 09.02.2027	3.643	3.274	0,11
4,400 % fällig am 13.03.2024	12.804	12.332	0,41	6,625 % fällig am 24.01.2032 (d)(f)	4.650	3.859	0,13	GLP Pte Ltd. 4,500 % fällig am 17.05.2026 (d)	13.300	6.825	0,23
Summe Indien		192.412	6,45	Summe Mexiko		11.052	0,37	4,600 % fällig am 29.06.2027 (d)	7.000	3.605	0,12
INDONESIEN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				MONGOLEI STAATSEMISSIONEN				Indika Energy Capital Pte. Ltd. 8,250 % fällig am 22.10.2025	31.900	31.563	1,06
Adaro Indonesia PT 4,250 % fällig am 31.10.2024	9.584	9.239	0,31	Mongolia Government International Bond 4,450 % fällig am 07.07.2031	9.925	7.743	0,26	LMIRT Capital Pte. Ltd. 7,250 % fällig am 19.06.2024	5.600	3.955	0,13
Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT 3,750 % fällig am 30.03.2026 (f)	23.154	21.534	0,72	5,125 % fällig am 07.04.2026	22.095	19.114	0,64	7,500 % fällig am 09.02.2026	8.500	5.164	0,18
Bukit Makmur Mandiri Utama PT 7,750 % fällig am 10.02.2026	16.856	14.496	0,49	5,625 % fällig am 01.05.2023	12.030	11.750	0,40	Medco Bell Pte. Ltd. 6,375 % fällig am 30.01.2027	24.100	21.825	0,73
Cikarang Listrindo Tbk PT 4,950 % fällig am 14.09.2026	6.443	6.028	0,20	Summe Mongolei		38.607	1,30	Medco Platinum Road Pte. Ltd. 6,750 % fällig am 30.01.2025	1.802	1.758	0,06
Freeport Indonesia PT 4,763 % fällig am 14.04.2027	9.200	8.878	0,30	NIEDERLANDE UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Theta Capital Pte. Ltd. 6,750 % fällig am 31.10.2026	3.800	2.471	0,08
5,315 % fällig am 14.04.2032	21.800	20.105	0,68	Mong Duong Finance Holdings BV 5,125 % fällig am 07.05.2029	28.359	23.646	0,79	TML Holdings Pte. Ltd. 4,350 % fällig am 09.06.2026	14.700	13.156	0,44
Medco Oak Tree Pte. Ltd. 7,375 % fällig am 14.05.2026	17.800	16.977	0,57	Prosus NV 4,193 % fällig am 19.01.2032	15.600	12.954	0,44	5,500 % fällig am 03.06.2024	9.100	8.861	0,30
Minejesa Capital BV 4,625 % fällig am 10.08.2030	4.700	4.137	0,14	4,987 % fällig am 19.01.2052	24.000	17.030	0,57	Summe Singapur		116.118	3,90
Pakuwon Jati Tbk PT 4,875 % fällig am 29.04.2028	6.100	5.398	0,18	Summe Niederlande		53.630	1,80	SÜDKOREA UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Saka Energi Indonesia PT 4,450 % fällig am 05.05.2024	7.900	7.560	0,25	OMAN STAATSEMISSIONEN				Kyobo Life Insurance Co. Ltd. 5,900 % fällig am 15.06.2052	2.800	2.597	0,09
Summe Indonesien		114.352	3,84	Oman Government International Bond 7,000 % fällig am 25.01.2051	5.000	4.851	0,16	Tongyang Life Insurance Co. Ltd. 5,250 % fällig am 22.09.2025 (d)	4.200	3.381	0,11
ISRAEL UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				PAKISTAN STAATSEMISSIONEN				Summe Südkorea		5.978	0,20
Enegean Israel Finance Ltd. 4,875 % fällig am 30.03.2026	2.800	2.599	0,09	Pakistan Government International Bond 6,000 % fällig am 08.04.2026	62.171	25.024	0,84	SRI LANKA STAATSEMISSIONEN			
JAPAN WANDELANLEIHEN & WECHSEL				6,875 % fällig am 05.12.2027	51.157	20.275	0,68	Sri Lanka Government International Bond 5,750 % fällig am 18.04.2023 ^	19.512	6.194	0,21
ANA Holdings, Inc. 0,000 % fällig am 10.12.2031 (b)	¥ 860.000	7.064	0,24	7,375 % fällig am 08.04.2031	25.300	9.108	0,30	6,200 % fällig am 11.05.2027 ^	23.800	7.594	0,25
JERSEY, KANALINSELN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				8,250 % fällig am 15.04.2024	6.500	3.542	0,12	6,350 % fällig am 28.06.2024 ^	9.500	3.028	0,10
West China Cement Ltd. 4,950 % fällig am 08.07.2026	\$ 29.475	25.054	0,84	7,375 % fällig am 30.09.2025	6.635	3.212	0,11	6,750 % fällig am 18.04.2028 ^	7.000	2.242	0,08
LUXEMBURG UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				8,875 % fällig am 08.04.2051	11.200	3.948	0,13	6,825 % fällig am 18.07.2026 ^	4.500	1.441	0,05
Guara Norte SARRL 5,198 % fällig am 15.06.2034	4.553	3.859	0,13	Summe Pakistan		65.109	2,18	6,850 % fällig am 14.03.2024 ^	61.971	19.739	0,66
				PHILIPPINEN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				6,850 % fällig am 03.11.2025 ^	39.900	12.872	0,43
				ACEN Finance Ltd. 4,000 % fällig am 08.03.2025 (d)	15.900	10.445	0,35	7,550 % fällig am 28.03.2030 ^	8.350	2.664	0,09
				Development Bank of the Philippines 2,375 % fällig am 11.03.2031	9.252	6.996	0,23	7,850 % fällig am 14.03.2029 ^	3.600	1.153	0,04
				Summe Philippinen				Summe Sri Lanka		56.927	1,91
								THAILAND UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
								Bangkok Bank PCL 5,000 % fällig am 23.09.2025 (d)(f)	3.000	2.849	0,09
								Kasikornbank PCL 3,343 % fällig am 02.10.2031 (f)	6.144	5.414	0,18
								4,000 % fällig am 10.02.2027 (d)(f)	4.700	3.866	0,13
								5,275 % fällig am 14.10.2025 (d)(f)	35.657	33.585	1,13

Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO Asia High Yield Bond Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
BESCHREIBUNG				VIETNAM				BESCHREIBUNG			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				STAATSEMISSIONEN				KURZFRISTIGE INSTRUMENTE			
Krung Thai Bank PCL 4,400 % fällig am 25.03.2026 (d)(f)	\$ 18.800	\$ 16.732	0,56	Vietnam Debt & Asset Trading Corp. 1,000 % fällig am 10.10.2025	\$ 6.290	\$ 5.258	0,18	Wanda Properties International Co. Ltd. 7,250 % fällig am 29.01.2024	\$ 3.100	\$ 2.805	0,09
Muang Thai Life Assurance PCL 3,552 % fällig am 27.01.2037 (f)	23.300	19.655	0,66	Vietnam Government International Bond 5,500 % fällig am 12.03.2028	960	936	0,03	Wanda Properties Overseas Ltd. 6,875 % fällig am 23.07.2023	1.000	955	0,03
Summe Thailand		82.101	2,75	Summe Vietnam		6.194	0,21	Summe Jungferninseln (Britisch)		293.182	9,83
GROSSBRITANNIEN				JUNGFERNINSELN (BRITISCH)				KURZFRISTIGE INSTRUMENTE			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				KURZFRISTIGE SCHULDITITEL			
Barclays PLC 8,000 % fällig am 15.03.2029 (d)(f)	2.500	2.344	0,08	1MDB Global Investments Ltd. 4,400 % fällig am 09.03.2023	66.800	65.402	2,19	Yango Justice International Ltd. 10,250 % fällig am 15.09.2022 ^	4.500	146	0,01
HSBC Holdings PLC 6,000 % fällig am 22.05.2027 (d)(f)	12.700	11.688	0,39	CAS Capital Ltd. 4,000 % fällig am 12.07.2026 (d)	3.820	2.989	0,10	Summe Kurzfristige Instrumente		146	0,01
Jaguar Land Rover Automotive PLC 4,500 % fällig am 01.10.2027	6.200	4.733	0,16	Celestial Miles Ltd. 5,750 % fällig am 31.01.2024 (d)	17.554	16.852	0,56	Summe Übertragbare Wertpapiere	\$	2.652.171	88,95
NatWest Group PLC 4,600 % fällig am 28.06.2031 (d)(f)	3.000	2.155	0,07	Champion Path Holdings Ltd. 4,500 % fällig am 27.01.2026	7.200	6.287	0,21	AKTIEN			
8,000 % fällig am 10.08.2025 (d)(f)	5.800	5.719	0,19	4,850 % fällig am 27.01.2028	6.939	5.854	0,20	INVESTMENTFONDS			
Standard Chartered PLC 6,000 % fällig am 26.07.2025 (d)(f)	7.900	7.619	0,26	Easy Tactic Ltd. (7,500 % bar oder 7,500 % PIK) 7,500 % fällig am 11.07.2027 (a)	28.570	6.285	0,21	ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN			
7,750 % fällig am 02.04.2023 (d)(f)	5.400	5.371	0,18	7,500 % fällig am 11.07.2028 (a)	8.550	1.731	0,06	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (e)	22.628.495	225.244	7,56
7,750 % fällig am 15.08.2027 (d)(f)	26.300	26.058	0,87	NWD Finance BVI Ltd. 4,125 % fällig am 10.03.2028 (d)	11.200	8.232	0,28	PIMCO Specialty Funds Ireland p.l.c. - PIMCO China Bond Fund (e)	744.048	9.911	0,33
7,776 % fällig am 16.11.2025	1.300	1.340	0,05	4,800 % fällig am 09.09.2023 (d)	17.000	10.396	0,35			235.155	7,89
Vedanta Resources Finance PLC 8,950 % fällig am 11.03.2025	62.292	42.394	1,42	5,250 % fällig am 22.03.2026 (d)	38.700	33.669	1,13	BÖRSENGEHANDELTE FONDS			
Summe Großbritannien		109.421	3,67	6,150 % fällig am 16.03.2025 (d)	57.200	53.614	1,80	PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (e)	48.700	4.824	0,16
USA				Peak RE BVI Holding Ltd. 5,350 % fällig am 28.10.2025 (d)	7.670	6.262	0,21	Summe Investmentfonds	\$	239.979	8,05
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				RKPF Overseas Ltd. 5,125 % fällig am 26.07.2026	8.750	6.278	0,21				
Stillwater Mining Co. 4,000 % fällig am 16.11.2026	2.500	2.211	0,07	5,200 % fällig am 12.01.2026	26.100	18.861	0,63				
US-SCHATZOBIGATIONEN				6,000 % fällig am 04.09.2025	11.006	8.915	0,30				
U.S. Treasury Bonds 1,875 % fällig am 15.11.2051	2.700	1.711	0,06	Scenery Journey Ltd. 11,500 % fällig am 24.10.2022 ^	400	27	0,00				
U.S. Treasury Inflation Protected Securities (c) 0,125 % fällig am 15.01.2032	49.017	42.971	1,44	Studio City Finance Ltd. 5,000 % fällig am 15.01.2029	20.100	14.869	0,50				
		44.682	1,50	6,000 % fällig am 15.07.2025	24.332	21.135	0,71				
Summe USA		46.893	1,57	6,500 % fällig am 15.01.2028	2.267	1.764	0,06				

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kapital- betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions- geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions- geschäft ⁽¹⁾	% des Netto- vermögens
SSB	1,900 %	30.12.2022	03.01.2023	\$ 20.572	U.S. Treasury Notes 1,875 % fällig am 30.06.2026	\$ (20.983)	\$ 20.572	\$ 20.574	0,69
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (20.983)	\$ 20.572	\$ 20.574	0,69

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Netto- vermögens
Euro-Bobl March Futures	Short	03.2023	102	\$ 413	0,01
U.S. Treasury 5-Year Note March Futures	Long	03.2023	1.495	(400)	(0,01)
U.S. Treasury 10-Year Note March Futures	Long	03.2023	16	(39)	0,00
U.S. Treasury 30-Year Bond March Futures	Long	03.2023	429	(377)	(0,01)
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond March Futures	Short	03.2023	18	4	0,00
				\$ (399)	(0,01)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ (399)	(0,01)

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Jaguar Land Rover Automotive PLC	5,000 %	20.12.2024	€ 5.000	\$ 203	0,01
Jaguar Land Rover Automotive PLC	5,000	20.06.2026	2.800	(542)	(0,02)
				\$ (339)	(0,01)

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
iTraxx Asia Ex-Japan 38 5-Year Index	1,000 %	20.12.2027	\$ 47.907	\$ 984	0,03

ZINSSWAPS

Zahlung/Erhalt	Erhalt	Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS			6,250 %	21.12.2027	INR 5.428.600	\$ 454	0,02
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS			1,000	15.06.2027	\$ 30.000	(3.068)	(0,10)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS			1,250	15.06.2032	33.200	5.296	0,19
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS			1,500	15.12.2031	28.100	1.899	0,06
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS			1,750	15.06.2024	114.000	(3.136)	(0,11)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS			1,750	15.12.2051	39.300	4.265	0,14
Erhalt	3-Month CNY-CNREPOFIX			2,500	16.03.2027	CNY 271.400	434	0,01
Erhalt	3-Month USD-LIBOR			0,750	16.06.2031	\$ 19.400	2.832	0,09
Erhalt	3-Month USD-LIBOR			1,250	15.12.2026	37.550	4.055	0,14
Erhalt ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR			1,500	15.03.2028	€ 4.000	190	0,01
							\$ 13.221	0,45

Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate

\$ 13.866 0,47

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

⁽²⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert.

⁽³⁾ Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

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

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

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZKAUF⁽¹⁾

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽³⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	Saudi Arabia Government International Bond	(1,000) %	20.12.2027	\$ 49.200	\$ (577)	\$ (282)	\$ (859)	(0,03)
BRC	South Korea Government International Bond	(1,000)	20.12.2027	22.500	(460)	(10)	(470)	(0,02)
GST	South Korea Government International Bond	(1,000)	20.12.2027	35.000	(377)	(355)	(732)	(0,02)
JPM	South Korea Government International Bond	(1,000)	20.12.2027	22.500	(466)	(5)	(471)	(0,02)
					\$ (1.880)	\$ (652)	\$ (2.532)	(0,09)

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽²⁾

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽³⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BPS	Longfor Group Holdings Ltd.	1,000 %	20.06.2026	\$ 9.500	\$ (155)	\$ (1.144)	\$ (1.299)	(0,04)
BRC	BOC Aviation Ltd.	1,000	20.06.2026	24.300	(70)	(6)	(76)	0,00
	Vanke Real Estate Hong Kong Co. Ltd.	1,000	20.06.2026	7.400	9	(454)	(445)	(0,02)
CBK	Vietnam Government International Bond	1,000	20.12.2027	9.100	(263)	98	(165)	(0,01)
					\$ (479)	\$ (1.506)	\$ (1.985)	(0,07)

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

Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO Asia High Yield Bond Fund (Forts.)

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

(3) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definieren.

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
BOA	01.2023	CNH	\$ 714.240	\$ 110.683	\$ 7.322	\$ 7.322	0,25	
	02.2023	\$	110.572	CNH 714.240	0	(6.952)	(0,23)	
	02.2023	\$	11.140	€ 10.510	109	0	0,00	
BPS	01.2023	THB	\$ 98	\$ 3	0	0	0,00	
	01.2023	\$	109.226	CNH 714.240	0	(5.864)	(0,20)	
	01.2023	\$	1	SGD 2	0	0	0,00	
	02.2023	€	48.608	\$ 50.403	0	(1.623)	(0,05)	
	02.2023	IDR	480.113	31	0	(1)	(0,00)	
	02.2023	\$	16.568	¥ 2.171.055	0	(22)	(0,00)	
	03.2023	MYR	581	\$ 129	0	(5)	(0,00)	
BRC	03.2023	TWD	8.606	285	3	0	0,00	
	03.2023	\$	97	INR 8.076	0	0	0,00	
	01.2023	CNH	70	\$ 10	0	0	0,00	
CBK	01.2023	SGD	101	75	0	0	0,00	
	01.2023	\$	10.988	CNH 76.617	99	0	0,00	
	02.2023	AUD	73	PHP 4.072	0	0	0,00	
DUB	02.2023	AUD	11.101	\$ 7.431	0	(110)	(0,00)	
	01.2023	\$	29.451	THB 1.022.256	107	0	0,00	
	02.2023	\$	11.683	¥ 1.605.856	555	0	0,02	
GLM	01.2023	HKD	12.085	\$ 1.552	3	0	0,00	
	01.2023	THB	44.934	1.289	0	(10)	(0,00)	
	01.2023	\$	11.432	CNH 79.525	75	0	0,00	
JPM	01.2023	\$	1.797	CNY 12.509	14	0	0,00	
	02.2023	AUD	20	\$ 13	0	0	0,00	
	02.2023	IDR	829.259	53	0	(1)	(0,00)	
	02.2023	¥	859.767	6.239	0	(314)	(0,01)	
	02.2023	TWD	254.368	8.378	69	0	0,00	
	03.2023	\$	3.228	CNY 22.330	19	0	0,00	
	03.2023	\$	11.388	IDR 178.241.848	134	0	0,01	
MBC	06.2023	\$	13.757	VND 330.164.544	13	(1)	(0,00)	
	01.2023	HKD	50.159	\$ 6.443	14	0	0,00	
	02.2023	AUD	10	7	0	0	0,00	
	02.2023	€	881	910	0	(33)	(0,00)	
	03.2023	\$	6.911	IDR 108.183.597	82	0	0,00	
MYI	05.2023	CNH	118.013	\$ 17.585	363	0	0,01	
	01.2023	€	182	194	0	0	0,00	
	01.2023	£	56	68	0	0	0,00	
	01.2023	HKD	50	6	0	0	0,00	
	01.2023	PHP	805.025	14.389	0	(101)	(0,00)	
	01.2023	SGD	10	8	0	0	0,00	
	01.2023	\$	232	£ 193	0	0	0,00	
SCX	02.2023	NZD	321	\$ 198	0	(5)	(0,00)	
	02.2023	TWD	470.273	15.425	63	0	0,00	
	03.2023	\$	9.719	IDR 152.428.770	134	0	0,01	
	01.2023	SGD	20	\$ 15	0	0	0,00	
	01.2023	\$	10	CNH 69	0	0	0,00	
UAG	02.2023	IDR	872.563	\$ 55	0	(1)	(0,00)	
	02.2023	\$	1.507	€ 1.455	50	0	0,00	
	03.2023	MYR	601	\$ 133	0	(5)	(0,00)	
	02.2023	CNH	714.240	111.084	7.464	0	7.464	0,25
	02.2023	IDR	1.295.032	82	0	(2)	(0,00)	
				\$ 16.692	\$ (15.050)	\$ 1.642	0,06	

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional AUD (Hedged) ausschüttend und Investor AUD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnung monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	01.2023	\$	AUD 42.949	AUD 63.757	\$ 299	\$ 0	0,01
BOA	01.2023	\$	2.340	3.467	12	0	0,00
CBK	01.2023	AUD	22	\$ 15	0	0	0,00
	01.2023	\$	3.235	AUD 4.770	14	(14)	0,00
MBC	01.2023	\$	18.517	27.475	144	(25)	0,00
MYI	01.2023	\$	38.049	56.659	384	0	0,01
UAG	01.2023	\$	27.728	41.079	137	0	0,01
				\$ 990	\$ (39)	\$ 951	0,03

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilklassen Institutional CHF (Hedged) thesaurierend, Institutional CHF (Hedged) ausschüttend, E CHF (Hedged) thesaurierend und E CHF (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2023	\$ 2.361	CHF 2.231	\$ 53	\$ 0	\$ 53	0,00
BRC	01.2023	\$ 56	52	0	0	0	0,00
CBK	01.2023	4.535	4.285	99	0	99	0,01
MBC	01.2023	CHF 13	\$ 14	0	0	0	0,00
MYI	01.2023	6	6	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 428	CHF 402	7	0	7	0,00
SCX	01.2023	CHF 43	\$ 47	0	0	0	0,00
				\$ 159	\$ 0	\$ 159	0,01

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Investor EUR (Hedged) ausschüttend, E EUR (Hedged) thesaurierend und E EUR (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	01.2023	€ 8.046	\$ 8.502	\$ 0	\$ (88)	\$ (88)	0,00
	01.2023	\$ 56.509	€ 54.352	1.523	0	1.523	0,05
BOA	01.2023	€ 210	\$ 222	0	(3)	(3)	0,00
BPS	01.2023	15.606	16.652	0	(10)	(10)	0,00
CBK	01.2023	5.211	5.540	0	(24)	(24)	0,00
	01.2023	\$ 149.671	€ 144.189	4.280	0	4.280	0,14
DUB	01.2023	13.949	13.426	386	0	386	0,01
MBC	01.2023	€ 3.933	\$ 4.149	1	(50)	(49)	0,00
	01.2023	\$ 213.195	€ 203.362	3.936	0	3.936	0,13
SCX	01.2023	181.207	174.095	4.676	0	4.676	0,16
				\$ 14.802	\$ (175)	\$ 14.627	0,49

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend und Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2023	£ 474	\$ 581	\$ 11	\$ 0	\$ 11	0,00
	01.2023	\$ 16.409	£ 13.611	0	(34)	(34)	0,00
BRC	01.2023	£ 776	\$ 943	9	0	9	0,00
	01.2023	\$ 4	£ 4	0	0	0	0,00
MBC	01.2023	£ 510	\$ 621	7	0	7	0,00
	01.2023	\$ 14.167	£ 11.821	60	(5)	55	0,00
MYI	01.2023	£ 579	\$ 708	12	0	12	0,00
	01.2023	\$ 711	£ 579	0	(15)	(15)	0,00
UAG	01.2023	£ 172	\$ 211	5	0	5	0,00
	01.2023	\$ 11.827	£ 9.844	16	(1)	15	0,00
				\$ 120	\$ (55)	\$ 65	0,00

Zum 31. Dezember 2022 standen für die ausschüttende Investor RMB (Hedged) Class die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BRC	01.2023	\$ 488	CNH 3.445	\$ 11	\$ 0	\$ 11	0,00
GLM	01.2023	96	677	2	0	2	0,00
MBC	01.2023	CNH 69	\$ 10	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 591	CNH 4.224	20	0	20	0,00
UAG	01.2023	CNH 49	\$ 7	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 612	CNH 4.323	13	0	13	0,00
				\$ 46	\$ 0	\$ 46	0,00

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilklassen Institutional SGD (Hedged) ausschüttend, Investor SGD (Hedged) ausschüttend, E SGD (Hedged) ausschüttend und M Retail SGD (Hedged) ausschüttend II die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2023	\$ 6.180	SGD 8.478	\$ 142	\$ 0	\$ 142	0,01
BPS	01.2023	6.084	8.347	141	0	141	0,01
GLM	01.2023	1.593	2.172	26	0	26	0,00
MBC	01.2023	SGD 327	\$ 241	0	(3)	(3)	0,00
	01.2023	\$ 6.028	SGD 8.239	116	0	116	0,00
UAG	01.2023	SGD 27	\$ 20	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 295	SGD 401	4	0	4	0,00
				\$ 429	\$ (3)	\$ 426	0,02
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						\$ 13.399	0,45
Summe Anlagen						\$ 2.939.588	98,60
Sonstige Aktiva und Passiva						\$ 41.804	1,40
Nettovermögen						\$ 2.981.392	100,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO Asia High Yield Bond Fund (Forts.)

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

- * Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt
- ^ Das Wertpapier ist in Verzug.
- (a) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.
- (b) Nullkuponwertpapier.
- (c) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.
- (d) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.
- (e) Mit dem Fonds verbunden.
- (f) Bedingt wandelbares Wertpapier.
- (g) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2021: 0,08 %):

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeitsdatum	Kaufdatum	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
Flourish Century	6,600 %	04.02.2049	25.08.2021 - 27.08.2021	\$ 10.747	\$ 1.209	0,04

Wertpapiere mit einem Gesamtwert von 0 USD (31. Dezember 2021: 46.847 USD) und Barmittel in Höhe von 0 USD (31. Dezember 2021: 440 USD) wurden gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen zum 31. Dezember 2022 als Sicherheiten verpfändet.

Barmittel in Höhe von 21.668 USD (31. Dezember 2021: 28.684 USD) wurden zum 31. Dezember 2022 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Wertpapiere mit einem Gesamtwert von 0 USD (31. Dezember 2021: 1.804 USD) und Barmittel in Höhe von 12.646 USD (31. Dezember 2021: 10 USD) wurden gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. zum 31. Dezember 2022 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 2.650.199	\$ 1.972	\$ 2.652.171
Investmentfonds	235.155	4.824	0	239.979
Pensionsgeschäfte	0	20.572	0	20.572
Finanzderivate ⁽³⁾	413	27.752	(1.299)	26.866
Summen	\$ 235.568	\$ 2.703.347	\$ 673	\$ 2.939.588

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

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

⁽¹⁾ Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

⁽²⁾ Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

⁽³⁾ Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung des Marktwerts der außerbörslich gehandelten Finanzderivate und (erhaltenen)/verpfändeten Sicherheiten nach Kontrahenten zum 31. Dezember 2022 und 31. Dezember 2021:

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2022			Zum 31. Dez. 2021		
	Gesamtwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾	Gesamtwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾
AZD	\$ 1.734	\$ (1.360)	\$ 374	\$ k. A.	\$ k. A.	\$ k. A.
BOA	(199)	350	151	1.576	(1.520)	56
BPS	(8.680)	9.734	1.054	(1.165)	1.312	147
BRC	(872)	1.172	300	2.544	(1.580)	964
CBK	4.080	(4.046)	34	575	(843)	(268)
DBL	k. A.	k. A.	k. A.	142	0	142
DUB	1.048	(1.010)	38	14	0	14
GLM	96	0	96	2.670	(2.210)	460
GST	(732)	660	(72)	(268)	502	234
HUS	k. A.	k. A.	k. A.	384	(580)	(196)
JPM	(538)	730	192	40	0	40
MBC	4.627	(4.030)	597	k. A.	k. A.	k. A.

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2022			Zum 31. Dez. 2021		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement ⁽¹⁾	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾
MYI	\$ 479	\$ (240)	\$ 239	\$ 844	\$ (680)	\$ 164
SCX	4.720	(4.520)	200	2.530	(1.460)	1.070
UAG	7.636	(8.540)	(904)	621	(280)	341

⁽¹⁾ Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2022:

	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	70,88	62,61
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	18,07	22,44
Investmentfonds	8,05	9,69
Pensionsgeschäfte	0,69	5,24
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,01)	0,02
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,47	0,07
Freiverkehrsfinanzderivate	0,45	0,31
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	k. A.	(1,43)

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2022 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
Australien	1,12	0,59
Brasilien	0,13	0,54
Cayman-Inseln	26,52	24,32
China	1,91	6,86
Ägypten	k. A.	0,32
Frankreich	0,59	0,10
Deutschland	0,38	0,43
Hongkong	6,10	5,27
Indien	6,45	6,84
Indonesien	3,84	4,06
Israel	0,09	0,12
Italien	k. A.	0,37
Japan	0,24	0,53
Jersey, Kanalinseln	0,84	0,21
Luxemburg	0,13	0,42
Malaysia	k. A.	0,81
Mauritius	7,22	3,62
Mexiko	0,37	0,41
Mongolei	1,30	1,23
Marokko	k. A.	0,18
Niederlande	1,80	0,56
Oman	0,16	0,39
Pakistan	2,18	3,35
Philippinen	3,53	2,52
Singapur	3,90	3,59
Südafrika	k. A.	0,35
Südkorea	0,20	0,13
Spanien	k. A.	0,24
Sri Lanka	1,91	2,17
Schweden	k. A.	0,01
Thailand	2,75	2,07
Großbritannien	3,67	3,78
USA	1,57	0,50
Vietnam	0,21	0,17
Jungferninseln (Britisch)	9,83	7,05
Kurzfristige Instrumente	0,01	0,94
Investmentfonds	8,05	9,69
Pensionsgeschäfte	0,69	5,24
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,01)	0,02
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	(0,01)	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,03	0,03
Zinsswaps	0,45	0,04
Freiverkehrsfinanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzkauf	(0,09)	k. A.
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	(0,07)	(0,01)
Zinsswaps	k. A.	0,01
Total Return Swaps auf Wertpapiere	k. A.	0,00
Devisenterminkontrakte	0,06	0,03
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,55	0,28
Sonstige Aktiva und Passiva	1,40	(0,38)
Nettovermögen	100,00	100,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Asia Strategic Interest Bond Fund

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE											
AUSTRALIEN											
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL											
Emeco Pty. Ltd. 6,250 % fällig am 10.07.2026	AUD 1.300	\$808	0,26	eHi Car Services Ltd. 8,000 % fällig am 27.01.2024			0,05	Flourish Century 6,600 % fällig am 04.02.2049 ^ (f)	\$ 1.700	\$189	0,06
Mineral Resources Ltd. 8,000 % fällig am 01.11.2027	\$ 1.000	1.024	0,33	7,000 % fällig am 21.09.2026	1.400	870	0,28	Greenland Global Investment Ltd. 7,250 % fällig am 22.01.2027	1.100	369	0,12
8,125 % fällig am 01.05.2027	1.105	1.115	0,35	7,750 % fällig am 14.11.2024	800	532	0,17	Midea Investment Development Co. Ltd. 2,880 % fällig am 24.02.2027	1.500	1.357	0,43
Pacific National Finance Pty. Ltd. 4,750 % fällig am 22.03.2028	1.700	1.510	0,48	Geely Automobile Holdings Ltd. 4,000 % fällig am 09.12.2024 (c)	2.000	1.820	0,58	New Metro Global Ltd. 4,625 % fällig am 15.10.2025	2.140	1.503	0,48
Santos Finance Ltd. 3,649 % fällig am 29.04.2031	600	478	0,15	3,000 % fällig am 22.07.2030	700	583	0,19	4,800 % fällig am 15.12.2024	700	543	0,17
5,250 % fällig am 13.03.2029	400	367	0,12	Health & Happiness H&H International Holdings Ltd. 5,625 % fällig am 24.10.2024	2.100	1.867	0,59	SF Holding Investment Ltd. 2,375 % fällig am 17.11.2026	600	540	0,17
Woodside Finance Ltd. 3,700 % fällig am 15.09.2026	1.600	1.498	0,48	Kaissa Group Holdings Ltd. 9,375 % fällig am 30.06.2024 ^	800	112	0,04	Sinopec Group Overseas Development Ltd. 4,250 % fällig am 12.09.2028	2.300	2.242	0,72
Summe Australien		6.800	2,17	9,750 % fällig am 28.09.2023 ^	200	28	0,01	Yango Group Co. Ltd. 6,900 % fällig am 31.10.2022 ^	20,00	0	0,12
				10,500 % fällig am 15.01.2025 ^	2.100	296	0,09	Yango Justice International Ltd. 7,875 % fällig am 04.09.2024 ^	\$ 700	26	0,01
				11,250 % fällig am 09.04.2022 ^	500	64	0,02	Yunda Holding Investment Ltd. 2,250 % fällig am 19.08.2025	1.500	1.328	0,42
				11,950 % fällig am 22.10.2022 ^	300	42	0,01	ZhongAn Online P&C Insurance Co. Ltd. 3,125 % fällig am 16.07.2025	2.900	2.523	0,80
				11,950 % fällig am 12.11.2023 ^	1.200	169	0,05	Summe China		14.793	4,71
				KWG Group Holdings Ltd. 5,875 % fällig am 10.11.2024	800	349	0,11	FRANKREICH			
				5,950 % fällig am 10.08.2025	600	248	0,08	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
				6,300 % fällig am 13.02.2026	1.100	437	0,14	BNP Paribas S.A. 9,250 % fällig am 17.11.2027 (c)(e)	700	731	0,23
				Longfor Group Holdings Ltd. 3,950 % fällig am 16.09.2029	400	294	0,09	Societe Generale S.A. 9,375 % fällig am 22.11.2027 (c)(e)	1.000	1.029	0,33
				4,500 % fällig am 16.01.2028	400	326	0,10	Summe Frankreich		1.760	0,56
				Melco Resorts Finance Ltd. 4,875 % fällig am 06.06.2025	1.100	1.012	0,32	DEUTSCHLAND			
				5,250 % fällig am 26.04.2026	1.700	1.499	0,48	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
				5,750 % fällig am 21.07.2028	1.500	1.257	0,40	BMW Finance NV 3,440 % fällig am 15.06.2024	CNY 7.000	1.009	0,32
				MGM China Holdings Ltd. 4,750 % fällig am 01.02.2027	1.000	886	0,28	Deutsche Bank AG 4,500 % fällig am 30.11.2026 (c)(e)	€ 800	669	0,22
				5,250 % fällig am 18.06.2025	200	188	0,06	10,000 % fällig am 01.12.2027 (c)(e)	400	442	0,14
				5,375 % fällig am 15.05.2024	1.000	966	0,31	Summe Deutschland		2.120	0,68
				Powerlong Real Estate Holdings Ltd. 5,950 % fällig am 30.04.2025	400	118	0,04	HONGKONG			
				6,250 % fällig am 10.08.2024	1.000	310	0,10	WANDELANLEIHEN & WECHSEL			
				Sands China Ltd. 2,800 % fällig am 08.03.2027	1.500	1.287	0,41	Universe Trek Ltd. 0,000 % fällig am 15.06.2026 (a)	\$ 200	175	0,06
				5,625 % fällig am 08.08.2025	2.400	2.298	0,73	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
				5,900 % fällig am 08.08.2028	1.700	1.594	0,51	China Cinda Finance Ltd. 4,750 % fällig am 08.02.2028	1.000	952	0,30
				Seazen Group Ltd. 4,450 % fällig am 13.07.2025	600	423	0,13	Fortune Star BVI Ltd. 3,950 % fällig am 02.10.2026	€ 800	491	0,16
				6,000 % fällig am 12.08.2024	500	393	0,12	5,000 % fällig am 18.05.2026	\$ 700	480	0,15
				Shui On Development Holding Ltd. 5,500 % fällig am 29.06.2026	700	566	0,18	5,050 % fällig am 27.01.2027	1.200	772	0,25
				Sunac China Holdings Ltd. 5,950 % fällig am 26.04.2024 ^	300	66	0,02	5,950 % fällig am 19.10.2025	800	619	0,20
				6,500 % fällig am 10.01.2025 ^	200	44	0,01	6,850 % fällig am 02.07.2024	1.700	1.471	0,47
				6,650 % fällig am 03.08.2024 ^	3.000	652	0,21	Gemdale Ever Prosperity Investment Ltd. 4,950 % fällig am 12.08.2024	500	429	0,14
				6,800 % fällig am 20.10.2024 ^	800	178	0,06	GLP China Holdings Ltd. 2,950 % fällig am 29.03.2026	900	646	0,20
				7,950 % fällig am 11.10.2023 ^	500	110	0,03	4,974 % fällig am 26.02.2024	400	351	0,11
				8,350 % fällig am 19.04.2023 ^	800	176	0,06	Huarong Finance Co. Ltd. 4,250 % fällig am 07.11.2027	500	428	0,14
				Sunny Optical Technology Group Co. Ltd. 3,750 % fällig am 23.01.2023	3.600	3.596	1,15	4,500 % fällig am 29.05.2029	5.100	4.238	1,35
				Tencent Holdings Ltd. 3,240 % fällig am 03.06.2050	1.100	697	0,22	4,875 % fällig am 22.11.2026	400	358	0,11
				Times China Holdings Ltd. 5,550 % fällig am 04.06.2024	1.900	370	0,12	6,007 % fällig am 24.02.2025	400	377	0,12
				VLL International, Inc. 5,750 % fällig am 28.11.2024	200	189	0,06	Lenovo Group Ltd. 5,875 % fällig am 24.04.2025	200	195	0,06
				Wynn Macau Ltd. 4,875 % fällig am 01.10.2024	2.450	2.317	0,74	6,536 % fällig am 27.07.2032	700	679	0,22
				5,125 % fällig am 15.12.2029	500	405	0,13	Yanlord Land HK Co. Ltd. 5,125 % fällig am 20.05.2026	2.000	1.673	0,53
				5,500 % fällig am 15.01.2026	2.700	2.482	0,79	6,750 % fällig am 23.04.2023	200	199	0,06
				5,500 % fällig am 01.10.2027	400	350	0,11			14.358	4,57
				5,625 % fällig am 26.08.2028	300	257	0,08				
				Zhongsheng Group Holdings Ltd. 3,000 % fällig am 13.01.2026	1.650	1.477	0,47				
				Summe Cayman Inseln		54.111	17,23				
				CHINA							
				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL							
				China Huaneng Group Hong Kong Treasury Management Holding Ltd. 3,080 % fällig am 09.12.2025 (c)	1.000	932	0,30				
				CNAC HK Finbridge Co. Ltd. 3,875 % fällig am 19.06.2029	3.200	2.859	0,91				

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS																																					
STAATSEMISSIONEN				Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia				India Green Energy Holdings																																								
Airport Authority Hong Kong	\$	3.600	2.969	0,94	4.400 % fällig am 06.06.2027	\$	3.200	3.170	1,01	5.375 % fällig am 29.04.2024	\$	6.000	5.776	1,84																																		
2.500 % fällig am 12.01.2032					Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara					India Toll Roads																																						
Summe Hongkong			17.502	5,57	3.375 % fällig am 05.02.2030		2.500	2.125	0,68	5.500 % fällig am 19.08.2024		250	242	0,08																																		
INDIEN				Saka Energi Indonesia PT				Summe Mauritius																																								
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				4.450 % fällig am 05.05.2024				700				670				0,21																																
Adani Electricity Mumbai Ltd.		1.200	919	0,29					21.930				6,98																																			
3.949 % fällig am 12.02.2030					STAATSEMISSIONEN				Indonesia Government International Bond				Banco Mercantil del Norte S.A.																																			
Adani Green Energy UP Ltd.		2.000	1.954	0,62	Indonesia Government International Bond				4.650 % fällig am 20.09.2032				6.900				6.768				2,16																											
6.250 % fällig am 10.12.2024					5.250 % fällig am 17.01.2042				900				887				0,28																															
Adani Transmission Step-One Ltd.		1.600	1.429	0,46					7.655				2,44				5.875 % fällig am 24.01.2027 (c)(e)				850				760				0,24																			
4.000 % fällig am 03.08.2026					Summe Indonesien				29.585				9,42				MONGOLEI				STAATSEMISSIONEN																											
GMR Hyderabad International Airport Ltd.		2.800	2.429	0,77	ISRAEL				Energean Israel Finance Ltd.				Mongolia Government International Bond				4.450 % fällig am 07.07.2031				1.600				1.248				0,40																			
4.250 % fällig am 27.10.2027					UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				4.875 % fällig am 30.03.2026				500				464				0,15				5.625 % fällig am 01.05.2023				431				421				0,13											
Indian Railway Finance Corp. Ltd.		2.100	1.807	0,58	JAPAN				ANA Holdings, Inc.				Summe Mongolei				1.669				0,53																											
3.570 % fällig am 21.01.2032					WANDELANLEIHEN & WECHSEL				0.000 % fällig am 10.12.2031 (a)				¥				90.000				739				0,24																							
JSW Hydro Energy Ltd.		974	813	0,26	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Summe Japan				6.879				2,19				NIEDERLANDE				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL																							
4.125 % fällig am 18.05.2031					Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.				5.063 % fällig am 12.09.2025				\$				3.100				3.080				0,98																							
Muthoot Finance Ltd.		1.000	985	0,31	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.				4.800 % fällig am 15.09.2025				3.100				3.060				0,97				Mong Duong Finance Holdings BV				5.125 % fällig am 07.05.2029				1.450				1.209				0,39							
4.400 % fällig am 02.09.2023					Summe Japan				6.879				2,19				4.987 % fällig am 19.01.2052				1.900				1.827				0,58																			
Network i2i Ltd.		200	192	0,06	JERSEY, KANALINSELN				West China Cement Ltd.				4.950 % fällig am 08.07.2026				1.400				1.190				0,38																							
5.650 % fällig am 15.01.2025 (c)					UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Guara Norte SARL				5.198 % fällig am 15.06.2034				820				695				0,22																							
NTPC Ltd.		600	578	0,18	LUXEMBURG				Genm Capital Labuan Ltd.				3.882 % fällig am 19.04.2031				500				373				0,12																							
4.250 % fällig am 26.02.2026					UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Misc Capital Two Labuan Ltd.				3.625 % fällig am 06.04.2025				3.900				3.713				1,18																							
ONGC Videsh Ltd.		4.100	4.075	1,30	Guara Norte SARL				5.198 % fällig am 15.06.2034				820				695				0,22				Petronas Capital Ltd.				2.480 % fällig am 28.01.2032				600				497				0,16							
ONGC Videsh Vankorneft Pte. Ltd.		1.000	934	0,30	MALAYSIA				Export-Import Bank of Malaysia Bhd.				1.831 % fällig am 26.11.2026				1.000				885				0,28				3.200 % fällig am 06.07.2046				\$				900				661				0,21			
3.750 % fällig am 07.05.2023					UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Summe Malaysia				6.638				2,11				5.000 % fällig am 13.01.2037				200				195				0,06															
ONGC Videsh Vankorneft Pte. Ltd.		1.000	934	0,30	MAURITIUS				Greenko Dutch BV				3.850 % fällig am 29.03.2026				2.197				1.911				0,61				5.609 % fällig am 13.04.2033				800				848				0,27							
Periama Holdings LLC		3.500	3.279	1,05	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Greenko Investment Co.				4.875 % fällig am 16.08.2023				2.200				2.159				0,69				2.729				0,87															
5.950 % fällig am 19.04.2026					Greenko Solar Mauritius Ltd.				5.950 % fällig am 29.07.2026				1.200				1.099				0,35				Summe Philippinen				5.076				1,62															
Reliance Industries Ltd.		700	568	0,18	Greenko Wind Projects Mauritius Ltd.				5.500 % fällig am 06.04.2025				1.900				1.784				0,57				Globe Telecom, Inc.				3.000 % fällig am 23.07.2035				600				437				0,14							
2.875 % fällig am 12.01.2032					STAATSEMISSIONEN				Export-Import Bank of India				2.250 % fällig am 13.01.2031				1.300				1.027				0,33				4.200 % fällig am 02.08.2026 (c)				900				808				0,26							
ReNew Power Pvt Ltd.		2.200	2.115	0,67	PHILIPPINEN				Summe Indien				23.988				7,64				Development Bank of the Philippines				2.375 % fällig am 11.03.2031				990				748				0,24											
5.875 % fällig am 05.03.2027					UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				22.961				7,31				SMC Global Power Holdings Corp.				5.450 % fällig am 09.12.2026 (c)				300				201				0,06															
Shriram Finance Ltd.		958	884	0,28	SINGAPUR				Summe Indonesien				29.585				9,42				United Overseas Bank Ltd.				1.750 % fällig am 16.03.2031 (e)				800				708				0,23											
4.150 % fällig am 18.07.2025					UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				22.961				7,31				Summe Singapur				9.540				3,04				7.000 % fällig am 21.10.2025 (c)				200				153				0,05							
STAATSEMISSIONEN				Export-Import Bank of India				2.250 % fällig am 13.01.2031				1.300				1.027				0,33				ABJA Investment Co. Pte. Ltd.				5.450 % fällig am 24.01.2028				200				196				0,06								
INDONESIEN				Summe Indien				23.988				7,64				PHILIPPINEN				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				LMIRT Capital Pte. Ltd.				7.500 % fällig am 09.02.2026				800				486				0,16								
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT				2.420				2.251				0,72				Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd.				4.250 % fällig am 19.06.2024 (e)				2.100				2.074				0,66												
3.750 % fällig am 30.03.2026 (e)				4.900 % fällig am 24.03.2027 (c)(e)				450				356				0,11				TML Holdings Pte. Ltd.				5.500 % fällig am 03.06.2024				1.400				1.363				0,43												
Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT				3.200				3.190				1,01				United Overseas Bank Ltd.				1.750 % fällig am 16.03.2031 (e)				800				708				0,23																
Bukit Makmur Mandiri Utama PT				1.400				1.204				0,38				Summe Singapur				9.540				3,04				Indika Energy Capital Pte. Ltd.				8.250 % fällig am 22.10.2025				1.950				1.929				0,61				
7.750 % fällig am 10.02.2026				Cikarang Listrindo Tbk PT				400				374				0,12				Greenko Investment Co.				4.875 % fällig am 16.08.2023				2.200				2.159				0,69												
4.950 % fällig am 14.09.2026				Freeport Indonesia PT				900				869				0,28				Greenko Solar Mauritius Ltd.				5.950 % fällig am 29.07.2026				1.200				1.099				0,35												
4.763 % fällig am 14.04.2027				5.315 % fällig am 14.04.2032				1.600				1.476				0,47				Greenko Wind Projects Mauritius Ltd.				5.500 % fällig am 06.04.2025				1.900				1.784				0,57												
Indofood CBP Sukses Makmur Tbk PT				3.541 % fällig am 27.04.2032				700				578				0,18				Greenko Dutch BV				3.850 % fällig am 29.03.2026				2.197				1.911				0,61												
Indonesia Asahan Aluminium Persero PT				5.800 % fällig am 15.05.2050				1.200				1.008				0,32				Greenko Investment Co.				4.875 % fällig am 16.08.2023				2.200				2.159				0,69												
LLPL Capital Pte. Ltd.				6.875 % fällig am 04.02.2039				1.024				904				0,29				Greenko Solar Mauritius Ltd.				5.950 % fällig am 29.07.2026				1.200				1.099				0,35												
Medco Oak Tree Pte. Ltd.				7.375 % fällig am 14.05.2026				2.000				1.908				0,61				Greenko Wind Projects Mauritius Ltd.				5.500 % fällig am 06.04.2025				1.900				1.784				0,57												
Minejesa Capital BV				4.625 % fällig am 10.08.2030				400				352				0,11				Greenko Dutch BV				3.850 % fällig am 29.03.2026				2.197				1.911				0,61												
Pakuwon Jati Tbk PT				4.875 % fällig am 29.04.2028				200				177				0,06				Greenko Investment Co.				4.875 % fällig am 16.08.2023				2.200				2.159				0,69												
Pelabuhan Indonesia Persero PT				4.875 % fällig am 01.10.2024				700				692				0,22				Greenko Solar Mauritius Ltd.				5.950 % fällig am 29.07.2026				1.200				1.099				0,35												
Pertamina Persero PT				1.400 % fällig am 09.02.2026				700				626				0,20				Greenko Wind Projects Mauritius Ltd.				5.500 % fällig am 06.04.2025				1.900				1.784				0,57												

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Asia Strategic Interest Bond Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
SÜDKOREA				GROSSBRITANNIEN				JUNGFERNINSELN (BRITISCH)			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Hana Bank				GC Treasury Center Co. Ltd.				1MDB Global Investments Ltd.			
3,250 % fällig am 30.03.2027	\$ 2.500	\$ 2.332	0,74	2,980 % fällig am 18.03.2031	\$ 1.900	\$ 1.537	0,49	4,400 % fällig am 09.03.2023	\$ 4.300	\$ 4.210	1,34
KB Capital Co. Ltd.				5,200 % fällig am 30.03.2052	400	322	0,10	Celestial Miles Ltd.			
1,500 % fällig am 28.10.2025	900	796	0,25	Kasikornbank PCL				5,750 % fällig am 31.01.2024 (c)	2.300	2.208	0,70
Kookmin Bank				5,275 % fällig am 14.10.2025 (c)(e)	1.100	1.036	0,33	NWD Finance BVI Ltd.			
2,500 % fällig am 04.11.2030 (e)	1.400	1.117	0,36	Minor International PCL				4,800 % fällig am 09.09.2023 (c)	1.600	978	0,31
Kyobo Life Insurance Co. Ltd.				2,700 % fällig am 19.04.2026 (c)	800	704	0,23	5,250 % fällig am 22.03.2026 (c)	2.700	2.349	0,75
5,900 % fällig am 15.06.2052	400	371	0,12	Muang Thai Life Assurance PCL				Peak RE BVI Holding Ltd.			
LG Chem Ltd.				3,552 % fällig am 27.01.2037 (e)	2.600	2.194	0,70	5,350 % fällig am 28.10.2025 (c)	1.300	1.061	0,34
2,375 % fällig am 07.07.2031	2.000	1.576	0,50	Summe Thailand		8.877	2,83	RKPF Overseas Ltd.			
Shinhan Bank Co. Ltd.				GROSSBRITANNIEN				5,125 % fällig am 26.07.2026	600	431	0,14
4,000 % fällig am 23.04.2029 (e)	200	179	0,06	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				5,900 % fällig am 05.03.2025	1.005	842	0,27
Shinhan Card Co. Ltd.				HSBC Holdings PLC				Star Energy Geothermal Wayang Windu Ltd.			
2,500 % fällig am 27.01.2027	3.600	3.154	1,01	6,000 % fällig am 22.05.2027 (c)(e)	900	828	0,26	6,750 % fällig am 24.04.2033	2.189	2.073	0,66
SK Hynix, Inc.				Jaguar Land Rover Automotive PLC				Studio City Co. Ltd.			
2,375 % fällig am 19.01.2031	1.700	1.248	0,40	4,500 % fällig am 01.10.2027	500	382	0,12	7,000 % fällig am 15.02.2027	200	187	0,06
Tongyang Life Insurance Co. Ltd.				Prudential PLC				Studio City Finance Ltd.			
5,250 % fällig am 22.09.2025 (c)	600	483	0,15	2,950 % fällig am 03.11.2033	700	574	0,18	5,000 % fällig am 15.01.2029	1.300	962	0,31
		11.256	3,59	Standard Chartered PLC				6,000 % fällig am 15.07.2025	300	261	0,08
				1,822 % fällig am 23.11.2025	1.400	1.280	0,41	TSMC Global Ltd.			
				6,000 % fällig am 26.07.2025 (c)(e)	700	675	0,21	1,750 % fällig am 23.04.2028	1.800	1.525	0,48
				7,776 % fällig am 16.11.2025	200	206	0,07	Wheelock MTN BVI Ltd.			
				Vedanta Resources Finance PLC				2,375 % fällig am 25.01.2026	1.500	1.377	0,44
				8,950 % fällig am 11.03.2025	2.250	1.531	0,49	Summe Jungferninseln (Britisch)		18.464	5,88
				Summe Großbritannien		5.476	1,74	Summe Übertragbare Wertpapiere		\$ 276.959	88,21
				USA				AKTIEN			
				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				INVESTMENTFONDS			
				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN			
				BOC Aviation USA Corp.				PIMCO Select Funds plc - PIMCO			
				1,625 % fällig am 29.04.2024	800	760	0,24	US Dollar Short-Term Floating			
				DAE Funding LLC				NAV Fund (d)	2.885.359	28.720	9,14
				1,550 % fällig am 01.08.2024	500	465	0,15	PIMCO Specialty Funds Ireland p.l.c. -			
				Hyundai Capital America				PIMCO China Bond Fund (d)	1.880	25	0,01
				2,750 % fällig am 27.09.2026	700	627	0,20				
				Stillwater Mining Co.							
				4,000 % fällig am 16.11.2026	800	707	0,22				
						2.559	0,81				
				US-SCHATZOBBLIGATIONEN				BÖRSENGEHANDELTE FONDS			
				U.S. Treasury Bonds				PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar			
				1,875 % fällig am 15.11.2051	600	380	0,12	Short Maturity UCITS ETF (d)	10.100	1.001	0,32
				2,250 % fällig am 15.08.2049	20	14	0,01	Summe Investmentfonds		\$29.746	9,47
				U.S. Treasury Inflation Protected Securities (b)							
				0,125 % fällig am 15.01.2032	4.192	3.675	1,17				
				U.S. Treasury Notes							
				3,250 % fällig am 31.08.2024	6.100	5.974	1,90				
				Summe USA		10.043	3,20				
						12.602	4,01				

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft ⁽¹⁾	% des Nettovermögens
SSB	1,900 %	30.12.2022	03.01.2023	\$ 820	U.S. Treasury Notes 1,875 % fällig am 30.06.2026	\$ (836)	\$ 820	\$ 820	0,26
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (836)	\$ 820	\$ 820	0,26

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (abnahme)	% des Nettovermögens
Euro-Bobl March Futures	Short	03.2023	6	\$ 23	0,01
Euro-Bund 10-Year Bond March Futures	Short	03.2023	3	28	0,01
Euro-Buxl 30-Year Bond March Futures	Short	03.2023	4	108	0,03

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
U.S. Treasury 2-Year Note March Futures	Long	03.2023	32	\$ (1)	0,00
U.S. Treasury 5-Year Note March Futures	Long	03.2023	84	(4)	0,00
U.S. Treasury 10-Year Note March Futures	Long	03.2023	130	(235)	(0,08)
U.S. Treasury 30-Year Bond March Futures	Long	03.2023	40	3	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond March Futures	Long	03.2023	53	(75)	(0,02)
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond March Futures	Short	03.2023	32	6	0,00
				<u>\$ (147)</u>	<u>(0,05)</u>
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				<u>\$ (147)</u>	<u>(0,05)</u>

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Atlantia SpA	1,000 %	20.06.2025	€ 100	\$ 6	0,00
Jaguar Land Rover Automotive PLC	5,000	20.06.2026	400	(78)	(0,02)
				<u>\$ (72)</u>	<u>(0,02)</u>

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt	variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	1-Day	INR-MIBOR Compounded-OIS	6,250 %	21.12.2027	INR 585.400	\$ 49	0,02
Zahlung	1-Day	USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,500	15.06.2024	\$ 10.900	(305)	(0,10)
Erhalt	1-Day	USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2029	17.600	553	0,18
Erhalt	3-Month	CNY-CNREPOFIX	2,500	16.03.2027	CNY 24.900	40	0,01
Erhalt	6-Month	AUD-BBR-BBSW	0,500	16.12.2025	AUD 800	64	0,02
						<u>\$ 401</u>	<u>0,13</u>
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate						<u>\$ 329</u>	<u>0,11</u>

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

⁽²⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definieren.

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

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

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZKAUF⁽¹⁾

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽²⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettovermögens
BOA	Saudi Arabia Government International Bond	(1,000) %	20.12.2027	\$ 5.700	\$ (67)	\$ (33)	\$ (100)	(0,03)
BRC	South Korea Government International Bond	(1,000)	20.12.2027	1.000	(20)	(1)	(21)	(0,01)
					<u>\$ (87)</u>	<u>\$ (34)</u>	<u>\$ (121)</u>	<u>(0,04)</u>

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽²⁾

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽²⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettovermögens
BPS	Longfor Group Holdings Ltd,	1,000 %	20.06.2026	\$ 600	\$ (10)	\$ (72)	\$ (82)	(0,03)
	Philippines Government International Bond	1,000	20.12.2027	2.700	(28)	32	4	0,00
BRC	BOC Aviation Ltd,	1,000	20.06.2026	2.000	(7)	1	(6)	0,00
CBK	Vietnam Government International Bond	1,000	20.12.2027	1.400	(41)	16	(25)	(0,01)
					<u>\$ (86)</u>	<u>\$ (23)</u>	<u>\$ (109)</u>	<u>(0,04)</u>

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

⁽²⁾ Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definieren, dann zahlt der Teilfonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Asia Strategic Interest Bond Fund (Forts.)

(ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

(3) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert.

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2023	€ 4	\$ 4	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	01.2023	\$ 5	€ 5	0	0	0	0,00
	02.2023	¥ 88.900	\$ 646	0	(31)	(31)	(0,01)
BPS	01.2023	THB 16	\$ 0	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 1	SGD 1	0	0	0	0,00
	02.2023	1.620	¥ 212.283	0	(2)	(2)	0,00
BRC	03.2023	TWD 988	\$ 33	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 835	CNH 5.824	7	0	7	0,00
	01.2023	1.171	€ 1.108	12	0	12	0,00
CBK	02.2023	AUD 1.425	\$ 954	0	(14)	(14)	0,00
	01.2023	\$ 3.243	THB 112.559	12	0	12	0,00
	02.2023	1.369	¥ 188.116	65	0	65	0,02
GLM	01.2023	HKD 334	\$ 43	0	0	0	0,00
	01.2023	THB 7.389	\$ 212	0	(2)	(2)	0,00
	01.2023	\$ 869	CNH 6.045	6	0	6	0,00
JPM	01.2023	564	CNY 3.928	5	0	5	0,00
	02.2023	TWD 29.206	\$ 962	8	0	8	0,00
	03.2023	\$ 1.014	CNY 7.011	6	0	6	0,00
MBC	03.2023	1.214	IDR 18.994.278	14	0	14	0,01
	06.2023	1.586	VND 38.064.888	1	0	1	0,00
	01.2023	€ 3.668	\$ 3.844	0	(72)	(72)	(0,02)
MYI	01.2023	HKD 1.386	\$ 178	0	0	0	0,00
	03.2023	\$ 736	IDR 11.528.542	9	0	9	0,00
	05.2023	CNH 15.911	\$ 2.371	49	0	49	0,02
SCX	01.2023	€ 32	\$ 34	0	0	0	0,00
	01.2023	PHP 88.640	1.584	0	(11)	(11)	0,00
	02.2023	TWD 53.996	1.771	7	0	7	0,00
UAG	03.2023	\$ 1.036	IDR 16.243.510	14	0	14	0,01
	01.2023	SGD 10	\$ 7	0	0	0	0,00
	02.2023	\$ 23	IDR 366.568	1	0	1	0,00
				\$ 216	\$ (132)	\$ 84	0,03

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) ausschüttend und E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2023	€ 104	\$ 110	\$ 0	\$ (1)	\$ (1)	0,00
	01.2023	\$ 281	€ 270	8	0	8	0,00
CBK	01.2023	€ 44	\$ 47	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 33.359	€ 32.126	944	0	944	0,30
GLM	01.2023	1.320	1.272	37	0	37	0,01
	01.2023	€ 440	\$ 470	0	0	0	0,00
MBC	01.2023	\$ 35.470	€ 33.836	656	0	656	0,21
	01.2023	35	33	0	0	0	0,00
MYI	01.2023	34.658	33.298	894	0	894	0,29
	01.2023	€ 6	\$ 6	0	0	0	0,00
UAG	01.2023	\$ 918	€ 860	1	0	1	0,00
				\$ 2.540	\$ (1)	\$ 2.539	0,81

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilsklasse Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2023	\$ 82	£ 68	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
MBC	01.2023	78	65	0	0	0	0,00
MYI	01.2023	14	11	0	0	0	0,00
UAG	01.2023	67	55	0	0	0	0,00
				\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional SGD (Hedged) ausschüttend und E SGD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2023	\$ 915	SGD 1.256	\$ 21	\$ 0	\$ 21	0,01
GLM	01.2023	1.041	1.423	20	0	20	0,01

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
MBC	01.2023	SGD 15	\$ 11	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	01.2023	\$ 977	SGD 1.335	19	0	19	0,01
SCX	01.2023	1	2	0	0	0	0,00
UAG	01.2023	SGD 11	\$ 8	0	0	0	(0,01)
	01.2023	\$ 9	SGD 12	0	0	0	0,00
				\$ 60	\$ 0	\$ 60	0,02
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						\$ 2.453	0,78
Summe Anlagen						\$ 310.160	98,78
Sonstige Aktiva und Passiva						\$ 3.827	1,22
Nettovermögen						\$ 313.987	100,00

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

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

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Nullkuponwertpapier.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

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

(d) Mit dem Fonds verbunden.

(e) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(f) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2021: 0,10 %):

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeitsdatum	Kaufdatum	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
Flourish Century	6,600 %	04.02.2049	25.08.2021 - 27.08.2021	\$ 1.676	\$ 189	0,06

Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von 0 USD (31. Dezember 2021: 992 USD) wurden gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen zum 31. Dezember 2022 als Sicherheiten verpfändet.

Barmittel in Höhe von 1.987 USD (31. Dezember 2021: 1.398 USD) wurden zum 31. Dezember 2022 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Wertpapier mit einem Gesamtmarktwert von 0 USD (31. Dezember 2021: 301 USD) und Barmittel in Höhe von 30 USD (31. Dezember 2021: 530 USD) wurden gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. zum 31. Dezember 2022 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 276.388	\$ 571	\$ 276.959
Investmentfonds	28.745	1.001	0	29.746
Pensionsgeschäfte	0	820	0	820
Finanzderivate ⁽³⁾	160	2.557	(82)	2.635
Summen	\$ 28.905	\$ 280.766	\$ 489	\$ 310.160

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

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 321.481	\$ 0	\$ 321.481
Investmentfonds	33.109	0	0	33.109
Pensionsgeschäfte	0	837	0	837
Finanzderivate ⁽³⁾	135	574	7	716
Summen	\$ 33.244	\$ 322.892	\$ 7	\$ 356.143

⁽¹⁾ Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

⁽²⁾ Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

⁽³⁾ Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Asia Strategic Interest Bond Fund (Forts.)

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung des Marktwerts der außerbörslich gehandelten Finanzderivate und (erhaltenen)/verpfändeten Sicherheiten nach Kontrahenten zum 31. Dezember 2022 und 31. Dezember 2021:

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2022			Zum 31. Dez. 2021		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement ⁽¹⁾	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement ⁽¹⁾
BOA	\$ (103)	\$ 0	\$ (103)	\$ 237	\$ 0	\$ 237
BPS	(80)	0	(80)	(398)	530	132
BRC	(20)	30	10	7	0	7
CBK	917	(820)	97	10	0	10
DBL	k. A.	k. A.	k. A.	35	0	35
DUB	77	0	77	5	0	5
GLM	61	(250)	(189)	271	0	271
GST	k. A.	k. A.	k. A.	(51)	0	(51)
HUS	k. A.	k. A.	k. A.	(38)	0	(38)
JPM	34	0	34	13	0	13
MBC	661	(670)	(9)	k. A.	k. A.	k. A.
MYI	10	(129)	(119)	65	0	65
SCX	894	(680)	214	269	0	269
UAG	2	0	2	(20)	301	281

⁽¹⁾ Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2022:

	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	75,24	66,89
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	12,97	22,16
Investmentfonds	9,47	9,17
Pensionsgeschäfte	0,26	0,23
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,05)	0,07
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,11	0,02
Freiverkehrsfinanzderivate	0,78	0,11
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	k. A.	(0,28)

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2022 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
Australien	2,17	2,16
Bahamas	k. A.	0,22
Brasilien	0,10	0,40
Cayman-Inseln	17,23	16,05
China	4,71	11,02
Frankreich	0,56	0,14
Deutschland	0,68	0,75
Hongkong	5,57	6,17
Indien	7,64	6,86
Indonesien	9,42	5,98
Israel	0,15	0,14
Japan	2,19	1,89
Jersey, Kanalinseln	0,38	k. A.
Luxemburg	0,22	0,60
Malaysia	2,11	2,17
Mauritius	4,60	2,61
Mexiko	0,24	0,47
Mongolei	0,53	0,54
Niederlande	1,40	0,79
Oman	k. A.	0,32
Pakistan	0,87	1,39
Philippinen	1,62	2,83
Singapur	3,04	3,02
Südafrika	k. A.	0,47
Südkorea	7,62	2,67
Sri Lanka	0,70	0,74
Thailand	2,83	2,46
Großbritannien	1,74	3,25
USA	4,01	1,68
Jungferninseln (Britisch)	5,88	6,13
Kurzfristige Instrumente	k. A.	5,13
Investmentfonds	9,47	9,17
Pensionsgeschäfte	0,26	0,23
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,05)	0,07
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	(0,02)	0,01
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	k. A.	0,01
Zinsswaps	0,13	0,00

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen - Schutzkauf	(0,04)	k. A.
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	(0,04)	(0,02)
Zinsswaps	k. A.	0,01
Total Return Swaps auf Wertpapiere	k. A.	0,01
Devisenterminkontrakte	0,03	0,01
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,83	0,10
Sonstige Aktiva und Passiva	1,22	1,35
Nettovermögen	100,00	100,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO Capital Securities Fund

BESCHREIBUNG	% DES			BESCHREIBUNG	% DES			BESCHREIBUNG	% DES					
	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTO-VERMÖGENS		PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTO-VERMÖGENS		PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTO-VERMÖGENS			
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE				BELGIEN				ITALIEN						
ÖSTERREICH				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL						
Erste Group Bank AG				BNP Paribas S.A.				Atlantia SpA						
4,250 % fällig am 15.10.2027 (c)(e)	€	112.200	95.239	1,66	2,871 % fällig am 19.04.2032	\$	2.100	1.647	0,03	1,875 % fällig am 12.02.2028	€	15.800	14.059	0,25
6,500 % fällig am 15.04.2024 (c)(e)		10.200	10.650	0,19	3,132 % fällig am 20.01.2033		23.400	18.534	0,32	Banca Monte dei Paschi di Siena SpA				
					4,625 % fällig am 12.01.2027 (c)(e)		38.900	32.092	0,56	5,375 % fällig am 18.01.2028		7.208	6.220	0,11
Summe Österreich				1,85	4,625 % fällig am 25.02.2031 (c)(e)		26.900	20.850	0,36	8,000 % fällig am 22.01.2030		10.300	9.645	0,17
BELGIEN				KANADA				JERSEY, KANALINSELN						
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL						
KBC Group NV				Bank of Nova Scotia				HSBC Bank Capital Funding Sterling LP						
4,250 % fällig am 14.10.2025 (c)(e)		72.800	67.595	1,18	3,625 % fällig am	\$	21.700	15.835	0,27	5,844 % fällig am 05.11.2031 (c)	£	66.532	81.904	1,43
4,750 % fällig am 05.03.2024 (c)(e)		12.800	13.061	0,23	27.10.2081 (e)(f)(g)		27.300	26.242	0,46	HSBC Capital Funding Dollar LP				
				1,41	4,900 % fällig am 04.06.2025 (c)(e)				0,46	10,176 % fällig am 30.06.2030 (c)	\$	3.817	4.600	0,08
Summe Belgien				1,41	Scottiabank Capital Trust				0,23	Summe Jersey, Kanalinseln				1,51
KANADA				CAYMAN INSELN				LUXEMBURG						
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL						
Bank of Nova Scotia				CIFI Holdings Group Co. Ltd.				CPI Property Group S.A.						
3,625 % fällig am				5,250 % fällig am 13.05.2026 ^		700	185	0,01	4,875 % fällig am 16.07.2025 ^					
27.10.2081 (e)(f)(g)	\$	21.700	15.835	0,27	6,000 % fällig am 16.07.2025 ^		300	79	0,00	4,875 % fällig am 18.08.2025 (c)	€	21.800	11.853	0,21
4,900 % fällig am 04.06.2025 (c)(e)		27.300	26.242	0,46	Country Garden Holdings Co. Ltd.				0,03	6,150 % fällig am 17.09.2025		17.200	9.329	0,16
				0,23	2,700 % fällig am 12.07.2026		800	458	0,01	8,000 % fällig am 27.01.2024		1.900	1.248	0,02
Summe Kanada				1,20	5,125 % fällig am 17.01.2025		2.200	1.490	0,03	New Metro Global Ltd.		1.500	1.163	0,02
CHINA				DEUTSCHLAND				MEXIKO						
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL						
New Metro Global Ltd.				Commerzbank AG				Banco Mercantil del Norte S.A.						
4,800 % fällig am 15.12.2024		800	620	0,01	6,500 % fällig am 09.10.2029 (c)(e)	€	33.800	32.615	0,57	5,875 % fällig am 24.01.2027 (c)(e)	\$	10.800	9.650	0,17
					6,500 % fällig am 06.12.2032		17.900	18.861	0,33	6,625 % fällig am 24.01.2032 (c)(e)		9.000	7.468	0,13
DÄNEMARK				HONGKONG				MEXIKO						
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL						
Nykkredit Realkredit A/S				Hongkong & Shanghai Banking Corp. Ltd.				Lincoln Financing SARL						
4,125 % fällig am 15.04.2026 (c)(e)	€	25.600	24.997	0,44	4,625 % fällig am 27.01.2023 (c)(g)		10.165	7.095	0,12	3,625 % fällig am 01.04.2024		3.600	3.805	0,07
					IRLAND				0,28	Summer BC Holdco SARL				
FINNLAND				ISRAEL				NIEDERLANDE						
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL						
Nordea Bank Abp				Bank Hapoalim B.M.				Abertis Infraestructuras Finance BV						
3,750 % fällig am				3,255 % fällig am 21.01.2032 (e)		17.000	14.701	0,26	2,625 % fällig am 26.01.2027 (c)	€	35.800	29.651	0,52	
01.03.2029 (c)(e)(g)	\$	60.900	47.170	0,82						ABN AMRO Bank NV		39.600	35.987	0,63
										4,750 % fällig am 22.09.2027 (c)(e)				
FRANKREICH				ISRAEL				NIEDERLANDE						
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL						
Altice France S.A.				Zurich Finance Ireland Designated Activity Co.				ASR Nederland NV						
4,250 % fällig am 15.10.2029 (g)	€	8.800	7.081	0,12	6,000 % fällig am 01.09.2025 (c)(e)	€	11.391	11.344	0,20	4,625 % fällig am 19.10.2027 (c)(e)		45.050	40.611	0,71
5,500 % fällig am 15.10.2029 (g)	\$	17.900	13.681	0,24	6,750 % fällig am 01.03.2033		8.300	8.819	0,16	7,000 % fällig am 07.12.2043		13.700	14.680	0,26
					7,500 % fällig am 19.05.2025 (c)(e)		76.500	79.556	1,39	Athora Netherlands NV				
					Permanent TSB Group Holdings PLC				0,63	7,000 % fällig am 19.06.2025 (c)(e)		34.765	36.319	0,63
					13,250 % fällig am		24.600	28.242	0,49	Cooperative Rabobank UA				
					26.10.2027 (c)(e)				0,64	3,100 % fällig am 29.06.2028 (c)(e)		44.200	36.596	0,64
					Summe Irland		203.689	3,56	3,250 % fällig am 29.12.2026 (c)(e)		3.000	2.738	0,05	
									0,11	4,375 % fällig am 29.06.2027 (c)(e)		32.400	30.866	0,54
									0,10	4,875 % fällig am 29.06.2029 (c)(e)		41.000	37.646	0,66
									0,32	de Volksbank NV				
									0,26	7,000 % fällig am 15.12.2027 (c)(e)		19.000	18.262	0,32
									0,40	ING Groep NV				
									0,27	3,875 % fällig am 16.05.2027 (c)(e)	\$	31.568	23.159	0,40
									0,92	4,125 % fällig am 24.08.2033		15.400	15.506	0,27
									0,26	4,250 % fällig am 16.05.2031 (c)(e)	\$	76.000	52.345	0,92

Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO Capital Securities Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
4,317 % fällig am 09.03.2023 (a)(b)	\$ 33.800	\$33.541	0,59	INVESTMENTFONDS			
4,321 % fällig am 02.03.2023 (a)(b)	39.700	39.429	0,69	ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN			
4,445 % fällig am 30.03.2023 (a)(b)	13.700	13.560	0,24	PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (d)	14.017	\$ 140	0,00
Summe kurzfristige Instrumente		927.672	16,21	Summe Investmentfonds		\$ 140	0,00
Summe Übertragbare Wertpapiere		\$ 6.129.600	107,13				

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kapital- betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions- geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions- geschäft ⁽¹⁾	% des Nettovermögens
FICC	1,900 %	30.12.2022	03.01.2023	\$ 10.172	U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 29.06.2023	\$ (10.375)	\$ 10.172	\$ 10.173	0,18
Total Repurchase Agreements						\$ (10.375)	\$ 10.172	\$ 10.173	0,18

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Canada Government 10-Year Bond March Futures	Long	03.2023	231	\$ (356)	(0,01)
Euro-Bobl March Futures	Short	03.2023	2.626	9.852	0,17
Euro-Bund 10-Year Bond March Futures	Long	03.2023	724	(7.071)	(0,12)
Euro-Buxl 30-Year Bond March Futures	Short	03.2023	461	10.670	0,19
Euro-OAT France Government 10-Year Bond March Futures	Short	03.2023	1.385	13.613	0,24
U.S. Treasury 2-Year Note March Futures	Long	03.2023	6.650	(36)	0,00
U.S. Treasury 5-Year Note March Futures	Short	03.2023	1.655	801	0,01
U.S. Treasury 10-Year Note March Futures	Long	03.2023	3.048	(3.128)	(0,05)
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond March Futures	Long	03.2023	726	(881)	(0,02)
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond March Futures	Short	03.2023	1.486	2.007	0,03
United Kingdom Long Gilt March Futures	Long	03.2023	204	(1.322)	(0,02)
				\$ 24.149	0,42
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ 24.149	0,42

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Jaguar Land Rover Automotive PLC	5,000 %	20.06.2027	€ 20.000	\$ (1.677)	(0,03)

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt	variabler Zinssatz	variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS		0,750 %	15.09.2051	£ 3.800	\$ 1.067	0,02
Erhalt ⁽³⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS		2,000	15.03.2033	113.200	(1.550)	(0,03)
Erhalt ⁽³⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS		2,000	15.03.2053	32.500	679	0,01
Erhalt ⁽³⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS		2,250	15.03.2028	102.900	(2.054)	(0,03)
Zahlung ⁽³⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS		2,500	15.03.2025	20.900	(280)	0,00
Erhalt ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR		1,500	15.03.2053	€ 74.000	6.521	0,11
						\$ 4.383	0,08
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate						\$ 2.706	0,05

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definieren.

(3) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

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

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

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Kontrahent	Referenzzeit	Zu erhaltender Festzinsatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽²⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BPS	Deutsche Bank AG	1,000 %	20.12.2026	€ 4.700	\$ (119)	\$ (132)	\$ (251)	0,00
	Deutsche Bank AG	1,000	20.06.2027	24.700	(3.307)	1.646	(1.661)	(0,03)
GST	Deutsche Bank AG	1,000	20.12.2026	5.000	(129)	(139)	(268)	(0,01)
					\$ (3.555)	\$ 1.375	\$ (2.180)	(0,04)

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

⁽²⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definieren.

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	01.2023	AUD 140	\$ 95	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
BOA	01.2023	£ 7.719	\$ 9.364	\$ 78	\$ 0	\$ 78	0,00
	01.2023	\$ 2.342	£ 1.902	0	(54)	(54)	0,00
BPS	01.2023	€ 5.397	\$ 5.759	0	(4)	(4)	0,00
	01.2023	\$ 14.826	€ 13.909	24	0	24	0,00
	01.2023	£ 4.691	€ 3.889	0	(12)	(12)	0,00
BRC	01.2023	CNH 350	\$ 50	0	(1)	(1)	0,00
	01.2023	€ 2.140	\$ 2.289	4	0	4	0,00
	01.2023	£ 488	\$ 587	0	0	0	0,00
	01.2023	SGD 1.848	\$ 1.372	0	(6)	(6)	0,00
	01.2023	\$ 2.262	€ 2.128	10	0	10	0,00
CBK	01.2023	CAD 902	\$ 667	1	0	1	0,00
	01.2023	CHF 940	\$ 996	0	(22)	(22)	0,00
	01.2023	€ 504.378	\$ 522.936	0	(15.591)	(15.591)	(0,27)
	01.2023	SEK 5.705	\$ 548	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 68.127	€ 64.201	421	0	421	0,01
GLM	01.2023	CNH 300	\$ 43	0	0	0	0,00
JPM	01.2023	\$ 63	CNY 436	1	0	1	0,00
	03.2023	113	778	1	0	1	0,00
MBC	01.2023	AUD 674	\$ 459	2	0	2	0,00
	01.2023	€ 93.766	\$ 98.597	0	(1.517)	(1.517)	(0,03)
	01.2023	£ 17.748	\$ 21.638	286	0	286	0,01
	01.2023	\$ 12.282	€ 11.533	32	0	32	0,00
	01.2023	9.381	£ 7.694	0	(125)	(125)	0,00
	05.2023	43	CNH 290	0	(1)	(1)	0,00
MYI	01.2023	€ 1.050	\$ 1.118	0	(2)	(2)	0,00
	01.2023	£ 17.563	\$ 21.617	487	0	487	0,01
	01.2023	SGD 250	\$ 185	0	(1)	(1)	0,00
	01.2023	\$ 913	£ 757	0	(2)	(2)	0,00
RBC	01.2023	1.259	CAD 1.689	0	(12)	(12)	0,00
SCX	01.2023	CAD 6.303	\$ 4.692	40	0	40	0,00
	01.2023	€ 1.763.850	\$ 1.835.903	0	(47.369)	(47.369)	(0,83)
	01.2023	\$ 50	CNH 350	0	0	0	0,00
TOR	01.2023	CAD 16.022	\$ 11.919	93	0	93	0,00
	01.2023	£ 521.409	\$ 626.884	0	(419)	(419)	(0,01)
	01.2023	\$ 14.850	€ 13.953	48	0	48	0,00
UAG	01.2023	6.843	£ 5.535	0	(184)	(184)	0,00
				\$ 1.528	\$ (65.322)	\$ (63.794)	(1,11)

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilsklassen Investor AUD (Hedged) ausschüttend und die Z AUD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	01.2023	\$ 19.576	AUD 29.061	\$ 136	\$ 0	\$ 136	0,00
BOA	01.2023	AUD 263	\$ 177	0	(1)	(1)	0,00
CBK	01.2023	910	618	1	0	1	0,00
	01.2023	\$ 636	AUD 947	6	0	6	0,00
MBC	01.2023	AUD 60	\$ 41	1	0	1	0,00
	01.2023	\$ 10.699	AUD 15.893	93	(11)	82	0,00
MYI	01.2023	24.228	36.077	244	0	244	0,01
RBC	01.2023	3.937	5.871	46	0	46	0,00
TOR	01.2023	21.853	32.378	109	0	109	0,00
				\$ 636	\$ (12)	\$ 624	0,01

Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO Capital Securities Fund (Forts.)

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilsklasse Institutional BRL (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	01.2023	BRL 1.774	\$ 332	\$ 1	\$ (5)	\$ (4)	0,00
	02.2023	\$ 148	BRL 781	0	(1)	(1)	0,00
CBK	01.2023	BRL 88.384	\$ 16.729	68	(80)	(12)	0,00
	01.2023	\$ 8.091	BRL 44.625	361	0	361	0,01
GLM	02.2023	16.626	88.384	85	(61)	24	0,00
	01.2023	BRL 43.963	\$ 8.302	0	(25)	(25)	(0,01)
JPM	01.2023	\$ 8.316	BRL 45.655	335	(4)	331	0,01
	02.2023	BRL 51	\$ 10	0	0	0	0,00
MYI	02.2023	\$ 8.189	BRL 43.632	30	0	30	0,00
	01.2023	BRL 1.596	\$ 304	4	(2)	2	0,00
MYI	01.2023	\$ 7.355	BRL 40.591	334	0	334	0,01
	02.2023	173	904	0	(3)	(3)	0,00
	01.2023	917	4.846	1	0	1	0,00
				\$ 1.219	\$ (181)	\$ 1.038	0,02

Zum 31. Dezember 2022 standen für die ausschüttende Investor CAD (Hedged) Class die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2023	\$ 1.014	CAD 1.371	\$ 0	\$ (2)	\$ (2)	0,00
CBK	01.2023	CAD 41	\$ 30	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 601	CAD 812	0	(2)	(2)	0,00
MBC	01.2023	1.114	1.507	0	(2)	(2)	0,00
MYI	01.2023	CAD 41	\$ 30	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 6	CAD 8	0	0	0	0,00
SCX	01.2023	286	385	0	(2)	(2)	0,00
				\$ 0	\$ (8)	\$ (8)	0,00

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional CHF (Hedged) thesaurierend und Class E CHF (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2023	\$ 20.441	CHF 19.341	\$ 477	\$ 0	\$ 477	0,01
CBK	01.2023	CHF 186	\$ 198	0	(3)	(3)	0,00
	01.2023	\$ 38.990	CHF 36.842	856	0	856	0,01
MBC	01.2023	CHF 244	\$ 263	0	(1)	(1)	0,00
	01.2023	\$ 438	CHF 409	4	0	4	0,00
MYI	01.2023	CHF 57	\$ 60	0	(1)	(1)	0,00
	01.2023	\$ 4.815	CHF 4.526	81	0	81	0,00
SCX	01.2023	CHF 27	\$ 29	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 28	CHF 26	0	0	0	0,00
UAG	01.2023	CHF 86	\$ 93	0	0	0	0,00
				\$ 1.418	\$ (5)	\$ 1.413	0,02

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend II, Investor EUR (Hedged) thesaurierend, Administrative EUR (Hedged) thesaurierend, E EUR (Hedged) thesaurierend, E EUR (Hedged) ausschüttend, R EUR (Hedged) ausschüttend und T EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2023	€ 2.726	\$ 2.875	\$ 0	\$ (36)	\$ (36)	0,00
BPS	01.2023	\$ 6.485	€ 6.078	4	0	4	0,00
	01.2023	€ 6.151	\$ 6.518	0	(49)	(49)	0,00
MBC	01.2023	\$ 704.913	€ 679.755	20.866	0	20.866	0,36
	01.2023	€ 9.302	\$ 9.877	1	(56)	(55)	0,00
SCX	01.2023	\$ 823.442	€ 785.685	15.438	0	15.438	0,27
	01.2023	744.914	715.679	19.220	0	19.220	0,34
				\$ 55.529	\$ (141)	\$ 55.388	0,97

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend, Institutional GBP (Hedged) ausschüttend, Investor GBP (Hedged) ausschüttend und R GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2023	£ 480	\$ 578	\$ 1	\$ 0	\$ 1	0,00
BPS	01.2023	\$ 273	£ 225	0	(2)	(2)	0,00
	01.2023	£ 4	\$ 5	0	0	0	0,00
BRC	01.2023	737	888	1	0	1	0,00
	01.2023	\$ 25	£ 21	0	0	0	0,00
JPM	01.2023	43.529	36.048	0	(160)	(160)	0,00
MBC	01.2023	£ 423	\$ 515	6	0	6	0,00
	01.2023	\$ 43.025	£ 35.842	165	(69)	96	0,00
MYI	01.2023	£ 252	\$ 310	7	0	7	0,00
	01.2023	\$ 2.073	£ 1.687	0	(43)	(43)	0,00

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
TOR	01.2023	\$ 43.206	£ 35.937	\$ 29	\$ 0	\$ 29	0,00
UAG	01.2023	£ 1	\$ 2	0	0	0	0,00
				\$ 209	\$ (274)	\$ (65)	0,00

Zum 31. Dezember 2022 standen fur die ausschuttende Investor RMB (Hedged) Class die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
BRC	01.2023	\$ 1.349	CNH 9.527	\$ 29	\$ 0	\$ 29	0,00
GLM	01.2023	175	1.236	4	0	4	0,00
MBC	01.2023	CNH 342	\$ 50	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 1.508	CNH 10.788	52	0	52	0,00
UAG	01.2023	CNH 58	\$ 8	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 1.490	CNH 10.538	34	0	34	0,00
				\$ 119	\$ 0	\$ 119	0,00

Zum 31. Dezember 2022 standen fur die Anteilsklassen Institutional SGD (Hedged) ausschuttend, Investor SGD (Hedged) ausschuttend, Administrative SGD (Hedged) ausschuttend II und M Retail SGD (Hedged) ausschuttend II die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
AZD	01.2023	\$ 51	SGD 69	\$ 1	\$ 0	\$ 1	0,00
BOA	01.2023	23.702	32.544	567	0	567	0,01
BPS	01.2023	27.032	37.051	597	0	597	0,01
GLM	01.2023	716	976	12	0	12	0,00
MBC	01.2023	SGD 503	\$ 375	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 26.229	SGD 35.851	506	0	506	0,01
UAG	01.2023	SGD 471	\$ 344	0	(7)	(7)	0,00
	01.2023	\$ 925	SGD 1.253	10	0	10	0,00
				\$ 1.693	\$ (7)	\$ 1.686	0,03

Summe Freiverkehrsfina n zderivate

\$ (5.779) (0,10)

Summe Anlagen

\$ 6.160.988 107,68

Sonstige Aktiva und Passiva

\$ (439.397) (7,68)

Nettovermogen

\$ 5.721.591 100,00

ERLAUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend*):

* Auf null lautende Saldi konnen fur faktisch vorhandene Betrage stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

- (a) Nullkuponwertpapier.
- (b) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfalligkeit dar.
- (c) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nachsten vertraglichen Kundigungstermin dar.
- (d) Mit dem Fonds verbunden.
- (e) Bedingt wandelbares Wertpapier.
- (f) Eingeschrankte Wertpapiere (31. Dezember 2021: 0,23 %):

Emittentenbeschreibung	Kupon	Falligkeitsdatum	Kaufdatum	Kosten	Marktwert	% des Nettovermogens
Bank of Nova Scotia	3,625 %	27.10.2081	29.09.2021	\$ 21.700	\$ 15.835	0,27
Deutsche Bank AG	3,729	14.01.2032	12.08.2022 - 17.10.2022	21.750	22.314	0,39
				\$ 43.450	\$ 38.149	0,66

(g) Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von 627.510 USD (31. Dezember 2021: 23.072 USD) wurden gema den Rahmenvertragen und/oder globalen Rahmenvertragen zum 31. Dezember 2022 als Sicherheiten verpfandet.

Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von 0 USD (31. Dezember 2021: 14.581 USD) und Barmittel in Hohe von 29.992 USD (31. Dezember 2021: 14.640 USD) wurden gema den Rahmenvertragen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. zum 31. Dezember 2021 als Sicherheiten fur Finanzderivate verpfandet.

Barmittel in Hohe von 18.271 USD (31. Dezember 2021: 0 USD) wurden gema den Rahmenvertragen und/oder globalen Rahmenvertragen zum 31. Dezember 2022 als Sicherheiten erhalten.

Barmittel in Hohe von 80.890 USD (31. Dezember 2021: 117.977 USD) wurden zum 31. Dezember 2022 als Sicherheit fur borsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfandet.

Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO Capital Securities Fund (Forts.)

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 6.129.600	\$ 0	\$ 6.129.600
Investmentfonds	140	0	0	140
Pensionsgeschäfte	0	10.172	0	10.172
Finanzderivate ⁽³⁾	25.386	(4.310)	0	21.076
Summen	\$ 25.526	\$ 6.135.462	\$ 0	\$ 6.160.988

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

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 231.912	\$ 8.191.098	\$ 0	\$ 8.423.010
Investmentfonds	481.206	0	0	481.206
Pensionsgeschäfte	0	62.523	0	62.523
Finanzderivate ⁽³⁾	11.041	3.107	0	14.148
Summen	\$ 724.159	\$ 8.256.728	\$ 0	\$ 8.980.887

⁽¹⁾ Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

⁽²⁾ Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

⁽³⁾ Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions- geschäften	% des Nettovermögens
BPS	2,000 %	21.12.2022	TBD ⁽¹⁾	€ (6.701)	\$ (7.156)	(0,13)
		4.250	05.10.2022	\$ (30.178)	(30.491)	(0,53)
		5.480	05.01.2023	(33.701)	(33.701)	(0,59)
BRC		1.200	20.09.2022	€ (4.545)	(4.860)	(0,08)
BYR		4.960	05.10.2022	\$ (59.439)	(59.977)	(1,05)
FBF		1.500	02.11.2022	€ (2.672)	(2.857)	(0,05)
IND		4.400	11.10.2022	\$ (13.157)	(13.289)	(0,23)
		4.400	21.10.2022	(59.799)	(60.326)	(1,05)
		4.600	07.11.2022	(96.816)	(97.496)	(1,70)
JML		4.163	11.10.2022	(133.869)	(135.138)	(2,36)
SCX		4.190	07.10.2022	(36.102)	(36.463)	(0,64)
		4.190	21.10.2022	(11.741)	(11.839)	(0,21)
		4.230	11.10.2022	(80.329)	(81.103)	(1,42)
		4.230	21.10.2022	(3.747)	(3.779)	(0,07)
Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte					\$ (578.475)	(10,11)

⁽¹⁾ Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung des Marktwerts der außerbörslich gehandelten Finanzderivate und (erhaltenen)/verpfändeten Sicherheiten nach Kontrahenten zum 31. Dezember 2022 und 31. Dezember 2021:

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2022			Zum 31. Dez. 2021		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement ⁽¹⁾	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement ⁽¹⁾
AZD	\$ 137	\$ 0	\$ 137	\$ k. A.	\$ k. A.	\$ k. A.
BOA	1.028	(1.010)	18	566	(340)	226
BPS	(1.308)	1.490	182	(24.905)	14.350	(10.555)
BRC	37	(10)	27	(7.345)	4.340	(3.005)
CBK	6.857	(6.830)	27	(240)	0	(240)
FBF	k. A.	k. A.	k. A.	32	0	32
GLM	352	(400)	(48)	(14)	472	458
GST	(268)	262	(6)	(92)	0	(92)
HUS	k. A.	k. A.	k. A.	1.081	(820)	261
JPM	175	(340)	(165)	(22)	290	268
MBC	14.804	(13.250)	1.554	k. A.	k. A.	k. A.
MYI	771	(650)	121	715	(480)	235
RBC	34	0	34	9.700	(7.750)	1.950
SCX	(28.111)	26.890	(1.221)	12.393	(7.760)	4.633
SSB	k. A.	k. A.	k. A.	(53)	80	27
TOR	(140)	1.350	1.210	10.924	(7.040)	3.884
UAG	(147)	0	(147)	(13.336)	9.689	(3.647)

⁽¹⁾ Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2022:

	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	82,69	81,02
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	24,44	11,44
Investmentfonds	0,00	5,28
Pensionsgeschäfte	0,18	0,69
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,42	0,16
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,05	0,11
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,10)	(0,12)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(10,11)	(0,26)

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2022 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
Österreich	1,85	1,19
Belgien	1,41	0,99
Kanada	1,20	0,82
Cayman-Inseln	0,11	0,06
China	0,01	k. A.
Dänemark	0,44	0,58
Finnland	0,82	0,42
Frankreich	13,26	8,34
Deutschland	3,81	2,68
Hongkong	0,12	0,02
Irland	3,56	2,75
Israel	0,26	0,19
Italien	7,66	7,95
Japan	k. A.	0,21
Jersey, Kanalinseln	1,51	1,44
Luxemburg	0,64	1,16
Mexiko	0,71	0,47
Niederlande	15,07	13,49
Norwegen	0,36	0,12
Portugal	0,16	0,13
Slowenien	0,60	0,35
Spanien	8,65	10,15
Schweden	0,72	0,74
Schweiz	7,67	7,68
Großbritannien	18,81	22,43
USA	1,51	3,97
Kurzfristige Instrumente	16,21	4,13
Investmentfonds	0,00	5,28
Pensionsgeschäfte	0,18	0,69
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,42	0,16
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	(0,03)	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf	k. A.	0,02
Zinsswaps	0,08	0,09
Freiverkehrsfinanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	(0,04)	(0,01)
Devisenterminkontrakte	(1,11)	(0,55)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	1,05	0,44
Sonstige Aktiva und Passiva	(7,68)	1,42
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
CPI Property Group S.A.				Nationale-Niederlanden Bank NV				International Development Association			
1,750 % fällig am 14.01.2030	€ 600	\$ 391	0,13	0,500 % fällig am 21.09.2028	€ 1.100	\$ 953	0,33	0,750 % fällig am 21.09.2028	€ 1.450	\$ 1.432	0,49
2,750 % fällig am 22.01.2028	€ 900	725	0,25	1,875 % fällig am 17.05.2032	200	190	0,06	Summe Supranational		14.549	4,97
Logicoor Financing SARL				NE Property BV				SCHWEDEN			
2,000 % fällig am 17.01.2034	€ 1.100	747	0,25	2,000 % fällig am 20.01.2030	1.400	1.037	0,35	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Prologis International Funding S.A.				TenneT Holding BV				Castellum AB			
0,750 % fällig am 23.03.2033	475	340	0,12	4,500 % fällig am 28.10.2034	700	779	0,27	0,750 % fällig am 04.09.2026	€ 1.100	912	0,31
0,875 % fällig am 09.07.2029	125	108	0,04	Thermo Fisher Scientific Finance BV				EQT AB			
1,625 % fällig am 17.06.2032	1.425	1.157	0,39	0,000 % fällig am 18.11.2025 (a)	1.400	1.355	0,46	0,875 % fällig am 14.05.2031	1.200	890	0,30
2,750 % fällig am 22.02.2032	€ 200	193	0,07	Vesteda Finance BV				Skandinaviska Enskilda Banken AB			
3,625 % fällig am 07.03.2030	€ 200	202	0,07	0,750 % fällig am 18.10.2031	1.200	933	0,32	4,000 % fällig am 09.11.2026	300	322	0,11
Segro Capital SARL				VIA Outlets BV				Volvo Car AB			
0,500 % fällig am 22.09.2031	1.000	757	0,26	1,750 % fällig am 15.11.2028	1.100	889	0,30	2,500 % fällig am 07.10.2027	300	283	0,10
SELP Finance SARL				Wabtec Transportation Netherlands BV				Summe Schweden		3.517	1,20
0,875 % fällig am 27.05.2029	1.000	807	0,27	1,250 % fällig am 03.12.2027	1.900	1.724	0,59	SCHWEIZ			
Summe Luxemburg		8.463	2,89	Summe Niederlande		25.322	8,65	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
MAURITIUS				SINGAPUR				STAAITSEMISSIONEN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Svensk Exportkredit AB			
Greenko Solar Mauritius Ltd.				Clean Renewable Power Mauritius Pte. Ltd.				2,000 % fällig am 30.06.2027	1.100	1.110	0,38
5,950 % fällig am 29.07.2026	\$ 500	458	0,16	4,250 % fällig am 25.03.2027	\$ 669	581	0,20	Summe Schweden		3.517	1,20
India Green Energy Holdings				SÜDKOREA				SCHWEIZ			
5,375 % fällig am 29.04.2024	2.100	2.022	0,69	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
India Green Power Holdings				SK Hynix, Inc.				UBS AG			
4,000 % fällig am 22.02.2027	400	343	0,12	2,375 % fällig am 19.01.2031	300	220	0,08	5,125 % fällig am 15.05.2024 (d)	\$ 900	890	0,30
Summe Mauritius		2.823	0,97	Summe Südkorea		896	0,31	GROSSBRITANNIEN			
MEXIKO				STAAITSEMISSIONEN				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Korea Water Resources Corp.				Assura Financing PLC			
Nemak S.A.B. de C.V.				3,500 % fällig am 27.04.2025	700	676	0,23	1,625 % fällig am 30.06.2033	€ 1.100	885	0,30
2,250 % fällig am 20.07.2028	€ 1.000	851	0,29	Summe Südkorea		896	0,31	Atlantica Sustainable Infrastructure PLC			
Summe Mexiko				SPANIEN				4,125 % fällig am 15.06.2028	\$ 900	800	0,27
MULTINATIONAL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Berkeley Group PLC			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Acciona Energia Financiacion Filiales S.A.				2,500 % fällig am 11.08.2031	€ 1.300	1.050	0,36
Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC				1,375 % fällig am 26.01.2032	€ 500	427	0,15	British Land Co. PLC			
2,000 % fällig am 01.09.2028	500	432	0,15	Banco Santander S.A.				2,375 % fällig am 14.09.2029	1.400	1.329	0,45
3,000 % fällig am 01.09.2029	150	118	0,04	0,625 % fällig am 24.06.2029	900	790	0,27	Burberry Group PLC			
NXP BV				CaixaBank S.A.				1,125 % fällig am 21.09.2025	600	643	0,22
2,500 % fällig am 11.05.2031	\$ 1.200	959	0,33	0,500 % fällig am 09.02.2029	100	87	0,03	Chanel Ceres PLC			
5,000 % fällig am 15.01.2033	1.100	1.042	0,35	0,750 % fällig am 26.05.2028	900	809	0,28	1,000 % fällig am 31.07.2031	€ 2.200	1.814	0,62
Summe multinational		2.551	0,87	1,500 % fällig am 03.12.2026	€ 600	631	0,21	Compass Group PLC			
NIEDERLANDE				3,750 % fällig am 07.09.2029	€ 1.900	1.990	0,68	4,375 % fällig am 08.09.2032	€ 1.900	2.196	0,75
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Summe Spanien		4.734	1,62	Derwent London PLC			
ABN AMRO Bank NV				STAAITSEMISSIONEN				1,875 % fällig am 17.11.2031	1.200	1.020	0,35
2,470 % fällig am 13.12.2029	3.400	2.755	0,94	Spain Government International Bond				Grainger PLC			
Citycon Treasury BV				1,000 % fällig am 30.07.2042	1.700	1.104	0,38	3,375 % fällig am 24.04.2028	700	697	0,24
1,625 % fällig am 12.03.2028	€ 1.100	859	0,29	Xunta de Galicia				Lendlease Europe Finance PLC			
CTP NV				0,084 % fällig am 30.07.2027	50	46	0,01	3,500 % fällig am 02.12.2033	800	619	0,21
1,250 % fällig am 21.06.2029	2.300	1.636	0,56	Summe Spanien		5.884	2,01	London & Quadrant Housing Trust			
Digital Intrepid Holding BV				SUPRANATIONAL				2,000 % fällig am 31.03.2032	400	364	0,12
0,625 % fällig am 15.07.2031	1.500	1.102	0,38	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Marks & Spencer PLC			
DSV Finance BV				Eurofima Europäische Gesellschaft fuer die Finanzierung von Eisenbahnmateri				3,750 % fällig am 19.05.2026	800	841	0,29
0,500 % fällig am 03.03.2031	500	403	0,14	0,000 % fällig am 28.07.2026 (a)	100	95	0,03	4,500 % fällig am 10.07.2027	300	311	0,11
ENBW International Finance BV				0,010 % fällig am 23.06.2028	2.000	1.792	0,61	NatWest Group PLC			
3,625 % fällig am 22.11.2026	500	535	0,18	0,150 % fällig am 10.10.2034	500	373	0,13	2,057 % fällig am 09.11.2028	1.200	1.205	0,41
Enel Finance International NV				3,125 % fällig am 09.11.2031	800	846	0,29	Santander UK Group Holdings PLC			
0,000 % fällig am 17.06.2027 (a)	600	543	0,19	Europäische Investitionsbank				2,896 % fällig am 15.03.2032	\$ 2.400	1.860	0,64
0,875 % fällig am 28.09.2034	1.300	934	0,32	0,750 % fällig am 15.07.2027	AUD 500	289	0,10	Severn Trent Utilities Finance PLC			
1,375 % fällig am 12.07.2026	\$ 1.000	863	0,29	1,500 % fällig am 15.06.2032	€ 5.600	5.203	1,78	2,625 % fällig am 22.02.2033	€ 600	577	0,20
7,500 % fällig am 14.10.2032	500	530	0,18	2,250 % fällig am 15.03.2030	1.230	1.248	0,43	South Eastern Power Networks PLC			
ING Groep NV				Europäische Union				1,750 % fällig am 30.09.2034	2.100	1.764	0,60
1,125 % fällig am 07.12.2028	€ 200	193	0,07	0,000 % fällig am 04.10.2030 (a)	1.400	1.186	0,40	Standard Chartered PLC			
4,875 % fällig am 16.05.2029 (c)(d)	\$ 2.600	2.015	0,69	0,300 % fällig am 04.11.2050	100	51	0,02	0,800 % fällig am 17.11.2029	€ 1.800	1.529	0,52
JDE Peet's NV				0,400 % fällig am 04.02.2037	800	579	0,20	Travis Perkins PLC			
2,250 % fällig am 24.09.2031	1.000	758	0,26	2,625 % fällig am 04.02.2048	200	193	0,07	3,750 % fällig am 17.02.2026	€ 1.100	1.175	0,40
LeasePlan Corp. NV				2,750 % fällig am 04.02.2033	300	308	0,10	Vodafone Group PLC			
0,250 % fällig am 23.02.2026	€ 2.000	1.858	0,63	Internationale Bank für Wiederaufbau und Entwicklung				5,125 % fällig am 04.06.2081	\$ 950	693	0,24
0,250 % fällig am 07.09.2026	1.400	1.282	0,44	2,125 % fällig am 03.03.2025	\$ 1.000	954	0,32	Workspace Group PLC			
1,375 % fällig am 07.03.2024	100	104	0,04	Summe Niederlande		25.322	8,65	2,250 % fällig am 11.03.2028	€ 400	359	0,12
3,500 % fällig am 09.04.2025	700	732	0,25	Summe Schweden		3.517	1,20	Zenith Finco PLC			
Lseg Netherlands BV				Summe Südkorea		896	0,31	6,500 % fällig am 30.06.2027	700	660	0,23
0,250 % fällig am 06.04.2028	400	360	0,12	Summe Spanien		5.884	2,01	Summe Großbritannien		22.391	7,65

Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO Climate Bond Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
STAATSEMISSIONEN											
United Kingdom Gilt	£ 3.700	\$ 3.323	1,14	HAT Holdings LLC	\$ 3.200	\$ 2.357	0,81	Southwestern Public Service Co.	\$ 450	\$ 313	0,11
0,875 % fällig am 31.07.2033				3,75 % fällig am 15.09.2030		485	0,17	3,150 % fällig am 01.05.2050			
Summe Großbritannien		25.714	8,79	6,000 % fällig am 15.04.2025	500			TerraForm Power Operating LLC	1.650	1.488	0,51
				Hilton Domestic Operating Co., Inc.	500	419	0,14	5,000 % fällig am 31.01.2028			
				4,000 % fällig am 01.05.2031				Topaz Solar Farms LLC	808	768	0,26
				Host Hotels & Resorts LP	700	537	0,18	5,750 % fällig am 30.09.2039			
				2,900 % fällig am 15.12.2031		503	0,17	UDR, Inc.	900	643	0,22
				3,375 % fällig am 15.12.2029	600	1.717	0,59	1,900 % fällig am 15.03.2033	150	114	0,04
				3,500 % fällig am 15.09.2030	2.075			3,100 % fällig am 01.11.2034			
				Hudson Pacific Properties LP				Verizon Communications, Inc.	4.110	3.205	1,10
				3,950 % fällig am 01.11.2027	1.000	852	0,29	1,500 % fällig am 18.09.2030	900	623	0,21
				5,950 % fällig am 15.02.2028	800	748	0,26	2,850 % fällig am 03.09.2041			
				Kilroy Realty LP	2.000	1.425	0,49	Wisconsin Electric Power Co.	500	491	0,17
				2,500 % fällig am 15.11.2032	300	209	0,07	4,750 % fällig am 30.09.2032			
				2,650 % fällig am 15.11.2033				Wisconsin Public Service Corp.	450	290	0,10
				Leeward Renewable Energy Operations LLC	700	599	0,20	2,850 % fällig am 01.12.2051			
				4,250 % fällig am 01.07.2029						49.324	16,86
				Liberty Utilities Finance GP	2.475	1.865	0,64	KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL			
				2,050 % fällig am 15.09.2030				New York Water & Sewer System, New York Revenue Bonds, (BABs), Series 2010			
				MidAmerican Energy Co.	950	613	0,21	5,724 % fällig am 15.06.2042			
				2,700 % fällig am 01.08.2052	400	341	0,12	New York Water & Sewer System, New York Revenue Bonds, Series 2010			
				4,250 % fällig am 15.07.2049				5,882 % fällig am 15.06.2044			
				Mississippi Power Co.	900	577	0,20	San Francisco, California Public Utilities Commission Water Revenue Bonds, Series 2020			
				3,100 % fällig am 30.07.2051				1,988 % fällig am 01.11.2031			
				Moody's Corp.	300	238	0,08	2,825 % fällig am 01.11.2041			
				2,000 % fällig am 19.08.2031	840	533	0,18	State Board of Administration Finance Corp., Florida Revenue Notes, Series 2020			
				3,100 % fällig am 29.11.2061				2,154 % fällig am 01.07.2030			
				New York State Electric & Gas Corp.	1.100	860	0,29				
				2,150 % fällig am 01.10.2031	2.100	1.797	0,61				
				NextEra Energy Capital Holdings, Inc.							
				1,900 % fällig am 15.06.2028							
				Niagara Mohawk Power Corp.	700	702	0,24				
				5,783 % fällig am 16.09.2052							
				NiSource, Inc.	300	274	0,09				
				5,000 % fällig am 15.06.2052							
				Northern States Power Co.	600	500	0,17				
				2,250 % fällig am 01.04.2031	200	128	0,04				
				2,600 % fällig am 01.06.2051							
				NSTAR Electric Co.	1.070	741	0,25				
				3,100 % fällig am 01.06.2051	300	292	0,10				
				4,950 % fällig am 15.09.2052							
				Oberlin College	1.800	1.075	0,37				
				2,874 % fällig am 01.10.2051							
				PacifiCorp	600	394	0,13				
				2,900 % fällig am 15.06.2052							
				Public Service Co. of Colorado	75	49	0,02				
				2,700 % fällig am 15.01.2051	25	18	0,01				
				3,200 % fällig am 01.03.2050	1.000	954	0,33				
				3,700 % fällig am 15.06.2028							
				Public Service Co. of Oklahoma	2.050	1.638	0,56				
				2,200 % fällig am 15.08.2031							
				Solar Star Funding LLC	157	153	0,05				
				5,375 % fällig am 30.06.2035							
				Southern California Edison Co.	1.800	1.488	0,51				
				2,500 % fällig am 01.06.2031							

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft ⁽¹⁾	% des Nettovermögens
TDM	4,320 %	30.12.2022	03.01.2023	\$ 36.800	U.S. Treasury Bonds 4,625 % fällig am 15.02.2040	\$ (38.412)	\$ 36.800	\$ 36.818	12,57
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (38.412)	\$ 36.800	\$ 36.818	12,57

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
3-Month SOFR March Futures	Long	06.2023	107	\$ (14)	0,00
Euro-Bund 10-Year Bond March Futures	Short	03.2023	206	1.868	0,64
Euro-Buxl 30-Year Bond March Futures	Short	03.2023	9	246	0,08
Japan Government 10-Year Bond March Futures	Short	03.2023	2	43	0,01
U.S. Treasury 2-Year Note March Futures	Long	03.2023	40	(1)	0,00
U.S. Treasury 5-Year Note March Futures	Long	03.2023	455	(183)	(0,06)
U.S. Treasury 10-Year Note March Futures	Long	03.2023	186	(112)	(0,04)
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond March Futures	Short	03.2023	38	(12)	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond March Futures	Short	03.2023	7	4	0,00
United Kingdom Long Gilt March Futures	Short	03.2023	67	526	0,18
				\$ 2.365	0,81
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate					
				\$ 2.365	0,81

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	2,000 %	15.03.2053	£ 900	\$ 12	0,00
Zahlung	1-Day USD- Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2027	\$ 3.200	(174)	(0,06)
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,000	16.06.2026	CAD 900	(51)	(0,02)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,840	08.07.2051	\$ 500	156	0,05
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,943	15.06.2051	400	119	0,04
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	1,500	15.03.2028	€ 900	43	0,02
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	1,500	15.03.2053	2.000	72	0,03
					\$ 177	0,06
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate						
					\$ 177	0,06

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

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

DEWISENTERMIKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	02.2023	CAD 6.096	\$ 4.592	\$ 91	\$ 0	\$ 91	0,03
	02.2023	€ 5.037	5.287	0	(104)	(104)	(0,04)
	02.2023	£ 20.575	24.299	8	(486)	(478)	(0,16)
BPS	02.2023	\$ 2.189	€ 2.059	15	0	15	0,01
	02.2023	€ 90.273	\$ 93.607	0	(3.014)	(3.014)	(1,03)
	03.2023	MXN 7.361	365	0	(7)	(7)	0,00
BRC	01.2023	SGD 15	11	0	0	0	0,00
	02.2023	€ 1.580	1.637	0	(54)	(54)	(0,02)
	02.2023	\$ 198	€ 186	1	0	1	0,00
CBK	02.2023	AUD 1.771	\$ 1.186	0	(18)	(18)	(0,01)
	02.2023	£ 344	413	1	(3)	(2)	0,00
	02.2023	\$ 1.601	€ 1.501	5	0	5	0,00
DUB	02.2023	€ 319	£ 262	0	(4)	(4)	0,00
	02.2023	€ 29.732	\$ 30.808	0	(1.016)	(1.016)	(0,35)
	03.2023	\$ 364	MXN 7.488	15	0	15	0,01
MYI	01.2023	€ 102	\$ 109	0	0	0	0,00
	01.2023	£ 5	6	0	0	0	0,00
	01.2023	SGD 7	5	0	0	0	0,00
RBC	01.2023	\$ 66	€ 61	0	0	0	0,00
	01.2023	251	£ 209	0	0	0	0,00
	02.2023	1.620	€ 1.555	44	0	44	0,02
SCX	02.2023	951	£ 789	0	0	0	0,00
UAG	02.2023	€ 6.873	€ 6.487	70	0	70	0,02
	02.2023	€ 753	\$ 776	0	(30)	(30)	(0,01)
				\$ 250	\$ (4.736)	\$ (4.486)	(1,53)

Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO Climate Bond Fund (Forts.)

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRÄKTE

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilsklasse Institutional CHF (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2023	\$ 366	CHF 346	\$ 8	\$ 0	\$ 8	0,00
CBK	01.2023	640	604	14	0	14	0,01
				\$ 22	\$ 0	\$ 22	0,01

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend und E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2023	€ 18	\$ 19	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
BPS	01.2023	\$ 83	€ 77	0	0	0	0,00
CBK	01.2023	€ 121	\$ 128	0	(1)	(1)	0,00
	01.2023	\$ 53.684	€ 51.778	1.600	0	1.600	0,55
JPM	01.2023	3.593	3.456	96	0	96	0,03
MBC	01.2023	€ 518	\$ 551	0	(2)	(2)	0,00
	01.2023	\$ 65.553	€ 62.550	1.232	0	1.232	0,42
RYL	01.2023	€ 12.574	\$ 13.313	0	(113)	(113)	(0,04)
SCX	01.2023	\$ 61.271	€ 58.866	1.581	0	1.581	0,54
				\$ 4.509	\$ (116)	\$ 4.393	1,50

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend und Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2023	£ 4	\$ 4	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	01.2023	\$ 24.116	£ 19.978	0	(82)	(82)	(0,03)
BPS	01.2023	18	15	0	0	0	0,00
BRC	01.2023	£ 188	\$ 226	0	0	0	0,00
JPM	01.2023	\$ 21.713	£ 17.981	0	(80)	(80)	(0,03)
MBC	01.2023	24.166	20.137	95	(34)	61	0,02
MYI	01.2023	£ 1	\$ 1	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 66	£ 54	0	(1)	(1)	0,00
UAG	01.2023	£ 22	\$ 27	1	0	1	0,00
	01.2023	\$ 11	£ 9	0	0	0	0,00
				\$ 96	\$ (197)	\$ (101)	(0,04)

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional SEK (Hedged) thesaurierend und Administrative SEK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2023	SEK 10	\$ 1	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	01.2023	\$ 196	SEK 2.015	0	(2)	(2)	0,00
BRC	01.2023	8.517	89.198	47	0	47	0,01
CBK	01.2023	SEK 32	\$ 3	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 938	SEK 9.770	0	0	0	0,00
MBC	01.2023	SEK 37	\$ 4	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 9	SEK 90	0	0	0	0,00
SCX	01.2023	SEK 14	\$ 1	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 2.514	SEK 26.415	23	0	23	0,01
UAG	01.2023	SEK 8	\$ 1	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 15.827	SEK 166.043	115	0	115	0,04
				\$ 185	\$ (2)	\$ 183	0,06

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilsklasse Institutional SGD (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	01.2023	\$ 3	SGD 4	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
BOA	01.2023	1.292	1.773	30	0	30	0,01
GLM	01.2023	SGD 63	\$ 46	0	(1)	(1)	0,00
	01.2023	\$ 1.461	SGD 1.996	28	0	28	0,01
MBC	01.2023	1.375	1.880	27	0	27	0,01
RYL	01.2023	SGD 3	\$ 2	0	0	0	0,00
SCX	01.2023	\$ 3	SGD 5	0	0	0	0,00

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
UAG	01.2023	\$ 25	SGD 34	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
				\$ 85	\$ (1)	\$ 84	0,03
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						\$ 95	0,03
Summe Anlagen						\$ 287.718	98,31
Sonstige Aktiva und Passiva						\$ 4.937	1,69
Nettovermögen						\$ 292.655	100,00

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

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

- (a) Nullkuponwertpapier.
- (b) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.
- (c) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.
- (d) Bedingt wandelbares Wertpapier.

Barmittel in Höhe von 3.781 USD (31. Dezember 2021: 2.349 USD) wurden zum 31. Dezember 2022 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Wertpapier mit einem Gesamtmarktwert von 0 USD (31. Dezember 2021: 22 USD) und Barmittel in Höhe von 4.260 USD (31. Dezember 2021: 0 USD) wurden gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. zum 31. Dezember 2022 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 248.281	\$ 0	\$ 248.281
Pensionsgeschäfte	0	36.800	0	36.800
Finanzderivate ⁽³⁾	2.683	(46)	0	2.637
Summen	\$ 2.683	\$ 285.035	\$ 0	\$ 287.718

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

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 321.810	\$ 0	\$ 321.810
Finanzderivate ⁽³⁾	836	3.725	0	4.561
Summen	\$ 836	\$ 325.535	\$ 0	\$ 326.371

⁽¹⁾ Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

⁽²⁾ Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

⁽³⁾ Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung des Marktwerts der außerbörslich gehandelten Finanzderivate und (erhaltenen)/verpfändeten Sicherheiten nach Kontrahenten zum 31. Dezember 2022 und 31. Dezember 2021:

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2022			Zum 31. Dez. 2021		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement ⁽¹⁾	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement ⁽¹⁾
BOA	\$ (522)	\$ 560	\$ 38	\$ 16	\$ 0	\$ 16
BPS	(3.021)	2.670	(351)	305	(260)	45
BRC	(6)	40	34	637	(400)	237
CBK	1.594	(1.510)	84	(47)	0	(47)
DUB	(1.016)	990	(26)	k. A.	k. A.	k. A.
GLM	42	(110)	(68)	(41)	0	(41)
HUS	k. A.	k. A.	k. A.	988	(1.290)	(302)
JPM	16	0	16	13	0	13
MBC	1.318	(1.270)	48	k. A.	k. A.	k. A.
MYI	43	(20)	23	(19)	22	3
RBC	0	0	0	699	(460)	239
RYL	(113)	0	(113)	k. A.	k. A.	k. A.
SCX	1.674	(1.560)	114	994	(810)	184
UAG	86	0	86	(2)	(260)	(262)

⁽¹⁾ Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2022:

	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	73,76	74,31
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	11,04	23,74
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,04	0,04
Pensionsgeschäfte	12,57	k. A.
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,81	0,29
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,06	0,02
Freiverkehrsfinanzderivate	0,03	1,08

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2022 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
Australien	0,31	1,49
Österreich	0,21	0,24
Belgien	0,40	0,62
Brasilien	0,07	0,66
Kanada	1,62	k. A.
Chile	0,70	0,85
China	k. A.	0,39
Zypern	0,28	k. A.
Finnland	0,28	1,82
Frankreich	6,29	7,69
Deutschland	11,61	2,48
Hongkong	k. A.	0,41
Indien	1,30	0,97
Irland	1,49	1,98
Italien	1,97	1,59
Japan	3,29	2,04
Jersey, Kanalinseln	0,36	0,40
Luxemburg	2,89	2,99
Mauritius	0,97	1,92
Mexiko	0,29	0,34
Multinational	0,87	0,59
Niederlande	8,65	10,39
Singapur	0,20	0,53
Südkorea	0,31	0,21
Spanien	2,01	3,13
Supranational	4,97	2,59
Schweden	1,20	0,79
Schweiz	0,30	0,85
Großbritannien	8,79	9,61
USA	21,97	33,05
Jungfernsinseln (Britisch)	0,26	0,28
Kurzfristige Instrumente	0,98	7,19
Pensionsgeschäfte	12,57	k. A.
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,81	0,29
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen		
– Schutzverkauf	k. A.	0,00
Zinsswaps	0,06	0,02
Freiverkehrsfinanzderivate		
Devisenterminkontrakte	(1,53)	0,23
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	1,56	0,85
Other Current Assets & Liabilities	1,69	0,52
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE			
AUSTRALIEN			
STAATSEMISSIONEN			
Australia Government International Bond 0,250 % fällig am 21.11.2032	AUD 8.918	\$ 3.128	0,23
0,750 % fällig am 21.11.2027	6.370	2.684	0,19
3,000 % fällig am 20.09.2025	2.202	1.193	0,09
Summe Australien		7.005	0,51
KANADA			
STAATSEMISSIONEN			
Canadian Government Real Return Bond 0,500 % fällig am 01.12.2050 (a)	CAD 237	146	0,01
4,250 % fällig am 01.12.2026 (a)	2.801	2.281	0,17
Summe Kanada		2.427	0,18
CAYMAN INSELN			
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE			
Allegro CLO Ltd. 5,244 % fällig am 16.10.2031	\$ 500	491	0,04
Anchorage Capital CLO Ltd. 5,465 % fällig am 22.07.2032	2.200	2.153	0,16
Atlas Senior Loan Fund Ltd. 5,169 % fällig am 15.01.2031	6.458	6.335	0,46
5,229 % fällig am 16.01.2030	1.190	1.178	0,09
Barings CLO Ltd. 5,043 % fällig am 20.10.2028	1.712	1.704	0,12
BlueMountain CLO Ltd. 5,505 % fällig am 22.10.2030	1.912	1.885	0,14
Carbone CLO Ltd. 5,383 % fällig am 20.01.2031	4.700	4.636	0,34
Carlyle Global Market Strategies CLO Ltd. 5,079 % fällig am 15.01.2031	591	585	0,04
Catamaran CLO Ltd. 5,425 % fällig am 22.04.2030	2.786	2.746	0,20
Cedar Funding CLO Ltd. 5,179 % fällig am 17.07.2031	700	688	0,05
CIFC Funding Ltd. 5,194 % fällig am 18.04.2031	2.600	2.554	0,19
5,418 % fällig am 27.04.2031	1.200	1.185	0,09
Dryden CLO Ltd. 5,616 % fällig am 15.05.2031	700	690	0,05
Elevation CLO Ltd. 5,355 % fällig am 15.10.2029	1.975	1.963	0,14
Greystones Commercial Real Estate Notes Ltd. 5,498 % fällig am 15.09.2037	2.509	2.471	0,18
ICG U.S. CLO Ltd. 5,405 % fällig am 22.07.2031	2.500	2.447	0,18
LCM LP 5,209 % fällig am 15.10.2031	1.200	1.175	0,09
5,283 % fällig am 20.07.2031	3.300	3.252	0,24
Madison Park Funding Ltd. 0,000 % fällig am 29.07.2030	400	394	0,03
4,829 % fällig am 15.04.2029	4.498	4.451	0,32
5,155 % fällig am 22.04.2027	418	414	0,03
Magnetite Ltd. 5,059 % fällig am 15.04.2031	297	292	0,02
Marathon CLO Ltd. 5,545 % fällig am 21.11.2027	40	40	0,00
Octagon Investment Partners Ltd. 5,039 % fällig am 16.04.2031	3.500	3.452	0,25
Octagon Loan Funding Ltd. 5,854 % fällig am 18.11.2031	2.500	2.466	0,18
OZLM Ltd. 5,159 % fällig am 17.04.2031	2.759	2.698	0,20
5,395 % fällig am 20.01.2031	3.400	3.345	0,24
Regatta Funding Ltd. 5,329 % fällig am 17.10.2030	4.300	4.253	0,31
Sound Point CLO Ltd. 5,344 % fällig am 18.04.2031	2.200	2.153	0,16
5,363 % fällig am 21.01.2031	1.400	1.367	0,10
5,427 % fällig am 26.07.2031	1.500	1.460	0,11
TIAA CLO Ltd. 5,443 % fällig am 20.07.2031	500	492	0,04

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
TICP CLO Ltd. 5,083 % fällig am 20.04.2028	\$ 561	\$ 559	0,04
Venture CLO Ltd. 4,959 % fällig am 15.07.2027	26	27	0,00
Voya CLO Ltd. 5,111 % fällig am 14.07.2031	495	488	0,03
5,289 % fällig am 15.10.2030	1.992	1.970	0,14
Summe Cayman Inseln		68.459	0,50
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Avolon Holdings Funding Ltd. 2,528 % fällig am 18.11.2027	258	207	0,01
Summe Cayman Inseln		68.666	0,51
DÄNEMARK			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Jyske Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK 30.616	3.238	0,24
1,000 % fällig am 01.10.2053	6.320	623	0,05
1,500 % fällig am 01.10.2053	14.417	1.541	0,11
2,000 % fällig am 01.10.2053	2.785	318	0,02
2,500 % fällig am 01.10.2047	1	0	0,00
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab 0,500 % fällig am 01.10.2043	6.846	751	0,05
1,000 % fällig am 01.10.2050	0	0	0,00
1,500 % fällig am 01.10.2053	3.900	401	0,03
2,000 % fällig am 01.10.2053	1.000	114	0,01
2,500 % fällig am 01.10.2047	3	0	0,00
Nykredit Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.10.2050	145.960	15.440	1,13
1,000 % fällig am 01.10.2053	6.879	721	0,05
1,500 % fällig am 01.10.2053	129.152	13.569	0,99
2,000 % fällig am 01.10.2053	6.082	674	0,05
2,500 % fällig am 01.10.2047	13	2	0,00
3,500 % fällig am 01.10.2053	22.504	2.969	0,22
Realkredit Danmark A/S 1,000 % fällig am 01.10.2050	55.013	5.824	0,43
1,000 % fällig am 01.10.2053	5.286	530	0,04
1,500 % fällig am 01.10.2053	17.923	1.942	0,14
2,000 % fällig am 01.10.2053	3.924	430	0,03
2,500 % fällig am 01.04.2047	13	2	0,00
Summe Dänemark		49.089	0,35
STAATSEMISSIONEN			
Denmark Government International Bond 0,100 % fällig am 15.11.2023 (a)	13.467	1.941	0,14
Summe Dänemark		51.030	0,37
FRANKREICH			
STAATSEMISSIONEN			
France Government International Bond 0,100 % fällig am 01.03.2025 (a)	€ 19.368	20.850	1,52
0,100 % fällig am 25.07.2031 (a)	9.547	9.756	0,71
0,100 % fällig am 25.07.2038 (a)	6.889	6.591	0,48
2,100 % fällig am 25.07.2023 (a)	33.178	36.276	2,65
Summe Frankreich		73.473	5,36
DEUTSCHLAND			
STAATSEMISSIONEN			
Bundesrepublik Deutschland 0,100 % fällig am 15.04.2023 (a)	13.849	14.662	1,07
IRLAND			
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE			
Ares European CLO 2,038 % fällig am 15.10.2030	1.396	1.454	0,11
Ares European CLO DAC 1,988 % fällig am 15.04.2030	692	718	0,05
2,158 % fällig am 15.10.2031	4.000	4.138	0,30
2,306 % fällig am 20.04.2032	2.100	2.177	0,16
Armada Euro CLO DAC 2,098 % fällig am 15.07.2031	500	518	0,04
Bain Capital Euro CLO DAC 2,602 % fällig am 24.01.2033	1.300	1.356	0,10

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Black Diamond CLO DAC 2,316 % fällig am 20.01.2032	€ 2.266	\$ 2.365	0,17
2,778 % fällig am 15.05.2032	2.600	2.690	0,20
2,834 % fällig am 03.10.2029	11	11	0,00
4,793 % fällig am 03.10.2029	7	7	0,00
BlueMountain Fuji EUR CLO DAC 1,050 % fällig am 15.01.2031	€ 1.000	960	0,07
2,098 % fällig am 15.01.2031	2.099	2.179	0,16
BNPP AM Euro CLO DAC 1,978 % fällig am 15.04.2031	1.600	1.655	0,12
Cairn CLO BV 2,158 % fällig am 15.10.2031	2.300	2.403	0,18
Cairn CLO DAC 2,688 % fällig am 20.10.2028	48	51	0,00
Carlyle Euro CLO DAC 2,078 % fällig am 15.01.2031	2.199	2.290	0,17
2,688 % fällig am 15.08.2032	900	933	0,07
Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd. 2,548 % fällig am 15.11.2031	3.850	3.982	0,29
CVC Cordatus Loan Fund DAC 2,788 % fällig am 26.08.2032	500	516	0,04
Dryden Euro CLO DAC 2,512 % fällig am 15.05.2032	1.332	1.382	0,10
2,622 % fällig am 15.05.2034	2.400	2.489	0,18
Harvest CLO DAC 1,040 % fällig am 15.07.2031	700	675	0,05
2,138 % fällig am 15.07.2031	1.400	1.443	0,10
2,433 % fällig am 18.11.2029	239	252	0,02
2,775 % fällig am 26.06.2030	1.544	1.611	0,12
Invesco Euro CLO DAC 2,298 % fällig am 15.07.2032	2.600	2.695	0,20
Jubilee CLO DAC 2,846 % fällig am 15.12.2029	1.651	1.729	0,13
Laurelin DAC 2,176 % fällig am 20.10.2031	1.200	1.242	0,09
Madison Park Euro Funding DAC 2,178 % fällig am 15.07.2032	700	724	0,05
Man GLG Euro CLO DAC 2,248 % fällig am 15.01.2030	143	149	0,01
Oak Hill European Credit Partners DAC 2,196 % fällig am 20.10.2031	1.100	1.139	0,08
OCF Euro CLO DAC 2,382 % fällig am 22.09.2034	2.600	2.697	0,20
Palmer Square European Loan Funding DAC 2,098 % fällig am 15.10.2031	880	911	0,07
Rockford Tower Europe CLO DAC 3,077 % fällig am 20.12.2031	2.700	2.808	0,20
Segovia European CLO DAC 2,336 % fällig am 20.07.2032	2.300	2.377	0,17
Tikehau CLO DAC 2,596 % fällig am 04.08.2034	2.600	2.694	0,20
Toro European CLO DAC 2,298 % fällig am 15.07.2030	844	885	0,06
2,572 % fällig am 15.02.2034	3.700	3.809	0,28
Summe Irland		62.114	4,54
NON-AGENCY-MBS			
European Loan Conduit DAC 2,803 % fällig am 17.02.2030	587	599	0,04
Summe Irland		62.713	4,58
ITALIEN			
STAATSEMISSIONEN			
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,400 % fällig am 15.05.2030 (a)	18.193	17.000	1,24
0,450 % fällig am 22.05.2023 (a)	3.613	3.835	0,28
1,400 % fällig am 26.05.2025 (a)	30.238	31.860	2,33
2,350 % fällig am 15.09.2024 (a)	25.854	28.436	2,08
2,550 % fällig am 15.09.2041 (a)	1.440	1.561	0,11
2,600 % fällig am 15.09.2023 (a)	11.694	12.733	0,93
Summe Italien		95.425	6,97

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Commodity Real Return Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
JAPAN			
STAATSEMISSIONEN			
Japan Government International Bond 0,005 % fällig am 10.03.2031 (a)	¥ 344.434	\$ 2.706	0,20
0,100 % fällig am 10.09.2024 (a)	926.640	7.198	0,52
0,100 % fällig am 10.03.2025 (a)	1.007.525	7.827	0,57
0,100 % fällig am 10.03.2026 (a)	763.284	5.990	0,44
0,100 % fällig am 10.03.2028 (a)	1.320.329	10.352	0,76
0,100 % fällig am 10.03.2029 (a)	4.185.494	32.927	2,40
Summe Japan		67.000	4,89

NIEDERLANDE			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Syngenta Finance NV 4,441 % fällig am 24.04.2023	\$ 400	398	0,03

NEUSEELAND			
STAATSEMISSIONEN			
New Zealand Government International Bond 2,000 % fällig am 20.09.2025	NZD 4.748	1.920	0,14

PERU			
STAATSEMISSIONEN			
Peru Government International Bond 5,940 % fällig am 12.02.2029	PEN 2.200	530	0,04

KATAR			
STAATSEMISSIONEN			
Qatar Government International Bond 3,875 % fällig am 23.04.2023	\$ 300	299	0,02

SAUDI-ARABIEN			
STAATSEMISSIONEN			
Saudi Arabia Government International Bond 4,000 % fällig am 17.04.2025	310	306	0,02

SPANIEN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. 5,875 % fällig am 24.09.2023 (b)(d)	€ 400	411	0,03

STAATSEMISSIONEN			
Spain Government International Bond 0,150 % fällig am 30.11.2023 (a)	16.449	17.694	1,29
0,500 % fällig am 30.04.2030	2.500	2.186	0,16
0,650 % fällig am 30.11.2027 (a)	26.422	27.874	2,04
0,700 % fällig am 30.11.2033 (a)	1.302	1.299	0,09
Summe Spanien		49.464	3,61

SCHWEDEN			
STAATSEMISSIONEN			
Sweden Government International Bond 0,125 % fällig am 01.06.2026	SEK 2.937	285	0,02
0,125 % fällig am 01.12.2027	15.332	1.477	0,11
1,000 % fällig am 01.06.2025	119.286	11.842	0,86
Summe Schweden		13.604	0,99

GROSSBRITANNIEN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
NatWest Group PLC 4,519 % fällig am 25.06.2024	\$ 400	397	0,03
6,274 % fällig am 25.06.2024	600	600	0,04
Summe		997	0,07

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
NON-AGENCY-MBS			
Great Hall Mortgages PLC 3,675 % fällig am 18.03.2039	£ 9	\$ 11	0,00
3,695 % fällig am 18.06.2038	9	11	0,00
Polaris PLC 4,232 % fällig am 23.10.2059	3.541	4.165	0,30
Towd Point Mortgage Funding PLC 4,071 % fällig am 20.10.2051	1.007	1.204	0,09
Summe		5.391	0,39

AKTIEN			
VORZUGSWERTPAPIERE			
Nationwide Building Society 10,250 %	7.021	1.058	0,08

STAATSEMISSIONEN			
United Kingdom Gilt 0,125 % fällig am 22.03.2024 (a)	£ 16.752	20.486	1,49
0,125 % fällig am 22.03.2026 (a)	12.819	15.566	1,14
0,125 % fällig am 10.08.2028 (a)	4.270	5.150	0,38
0,125 % fällig am 10.08.2041 (a)	4.321	4.899	0,36
1,250 % fällig am 22.11.2027 (a)	30.812	39.234	2,86
2,500 % fällig am 17.07.2024	22.090	29.004	2,12
Summe Großbritannien		114.339	8,35
Summe		121.785	8,89

USA			
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE			
ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust 5,439 % fällig am 25.12.2033	\$ 854	820	0,06
Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates 5,349 % fällig am 25.10.2035	1.300	1.169	0,09
Asset-Backed Funding Certificates Trust 4,529 % fällig am 25.10.2036	2.426	2.199	0,16
4,989 % fällig am 25.10.2034	203	203	0,01
CIT Mortgage Loan Trust 5,739 % fällig am 25.10.2037	110	110	0,01
Citigroup Mortgage Loan Trust 4,679 % fällig am 25.09.2036	509	484	0,04
Citigroup Mortgage Loan Trust Asset-Backed Pass-Through Certificates 5,334 % fällig am 25.10.2034	324	312	0,02
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc. 5,079 % fällig am 25.10.2035 ^	800	722	0,05
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust 5,349 % fällig am 25.02.2036	2.025	1.973	0,14
Ellington Loan Acquisition Trust 5,489 % fällig am 25.05.2037	649	624	0,05
First Franklin Mortgage Loan Trust 4,699 % fällig am 25.07.2036	158	148	0,01
5,664 % fällig am 25.07.2034	1.750	1.695	0,12
Home Equity Asset Trust 5,244 % fällig am 25.08.2034	108	105	0,01
5,409 % fällig am 25.03.2035	1.465	1.374	0,10
Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust 4,529 % fällig am 25.11.2036	702	627	0,05
Lehman XS Trust 6,689 % fällig am 25.12.2037	855	840	0,06
Mid-State Capital Corp. Trust 5,787 % fällig am 15.10.2040	86	84	0,01
Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust 5,049 % fällig am 25.01.2035	375	361	0,03
5,364 % fällig am 25.07.2034	143	136	0,01
New Century Home Equity Loan Trust 5,154 % fällig am 25.02.2035	493	471	0,03
Option One Mortgage Loan Trust 4,929 % fällig am 25.01.2036	1.700	1.506	0,11
Renaissance Home Equity Loan Trust 5,589 % fällig am 25.11.2034	187	162	0,01
Residential Asset Securities Corp. Trust 5,274 % fällig am 25.08.2035	6	6	0,00
Saxon Asset Securities Trust 4,679 % fällig am 25.09.2036	3.000	2.742	0,20
4,699 % fällig am 25.09.2037	262	247	0,02

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust			
5,109 % fällig am 25.10.2035	\$ 1.495	\$ 1.302	0,09
5,364 % fällig am 25.08.2034	2.054	1.975	0,14
Summe		22.397	1,63

UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Broadcom, Inc. 3,137 % fällig am 15.11.2035	1.459	1.077	0,08
Lehman Brothers Holdings, Inc. 7,875 % fällig am 08.05.2018 ^	£ 100	1	0,00
Summe		1.078	0,08

KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL			
American Municipal Power, Inc., Ohio Revenue Bonds, Series 2010 7,734 % fällig am 15.02.2033	\$ 200	228	0,02
Bay Area Toll Authority, California Revenue Bonds, (BABs), Series 2010 6,918 % fällig am 01.04.2040	600	702	0,05
California State General Obligation Bonds, (BABs), Series 2009 7,300 % fällig am 01.10.2039	500	608	0,04
7,500 % fällig am 01.04.2034	100	121	0,01
7,550 % fällig am 01.04.2039	200	251	0,02
Los Angeles Department of Water & Power, California Revenue Bonds, Series 2010 5,516 % fällig am 01.07.2027	500	512	0,04
New York City Transitional Finance Authority Future Tax Secured, New York Revenue Bonds, (BABs), Series 2010 5,508 % fällig am 01.08.2037	200	206	0,01
New York State Urban Development Corp., Revenue Bonds, (BABs), Series 2009 5,770 % fällig am 15.03.2039	100	103	0,01
Summe		2.731	0,20

NON-AGENCY-MBS			
Banc of America Funding Trust 4,496 % fällig am 20.09.2034	7	7	0,00
BCAP LLC Trust 5,250 % fällig am 26.04.2037	195	117	0,01
Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust 3,255 % fällig am 25.05.2047 ^	6	5	0,00
3,575 % fällig am 25.09.2034	55	51	0,00
3,810 % fällig am 25.01.2035	22	20	0,00
4,089 % fällig am 25.02.2034	7	6	0,00
4,111 % fällig am 25.11.2034	5	4	0,00
Bear Stearns ALT-A Trust 3,044 % fällig am 25.10.2033	9	8	0,00
3,697 % fällig am 25.08.2036 ^	13	7	0,00
Chase Mortgage Finance Trust 3,393 % fällig am 25.03.2037 ^	5	4	0,00
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc. 3,440 % fällig am 25.09.2035	1	1	0,00
5,500 % fällig am 25.08.2034	382	352	0,03
Countrywide Alternative Loan Trust 3,435 % fällig am 25.02.2037 ^	6	5	0,00
4,563 % fällig am 20.07.2046 ^	9	7	0,00
4,769 % fällig am 25.09.2046 ^	8	8	0,00
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust 3,632 % fällig am 25.09.2047 ^	6	5	0,00
5,029 % fällig am 25.03.2035	66	59	0,01
5,149 % fällig am 25.09.2034	1	1	0,00
GreenPoint Mortgage Funding Trust 4,829 % fällig am 25.06.2045	72	66	0,01
GSR Mortgage Loan Trust 3,154 % fällig am 25.06.2034	4	4	0,00
3,652 % fällig am 25.07.2035	39	36	0,00
3,767 % fällig am 25.09.2035	2	2	0,00
HarborView Mortgage Loan Trust 5,253 % fällig am 20.06.2035	197	173	0,01
Impac CMB Trust 5,289 % fällig am 25.10.2033	1	1	0,00
IndyMac Mortgage Loan Trust 4,869 % fällig am 25.07.2035	1.352	1.247	0,09
5,029 % fällig am 25.07.2045	3	2	0,00

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	% DES		BESCHREIBUNG	PARI (000S)	% DES		BESCHREIBUNG	PARI (000S)	% DES	
		MARKT- WERT	NETTO- VERMÖ- GENS			MARKT- WERT	NETTO- VERMÖ- GENS			MARKT- WERT	NETTO- VERMÖ- GENS
JP Morgan Mortgage Trust 3,527 % fällig am 25.04.2035	\$ 20	\$ 19	0,00	Freddie Mac 3,848 % fällig am 01.01.2034	\$ 1	\$ 1	0,00	0,500 % fällig am 15.04.2024 (e)	68.442	\$ 49.664	4,86
4,236 % fällig am 25.08.2035	6	6	0,00	4,473 % fällig am 15.03.2024	1	1	0,00	0,500 % fällig am 15.01.2028	52.790	13.951	3,63
Mellon Residential Funding Corp. Mortgage Pass-Through Trust 4,758 % fällig am 15.12.2030	1	1	0,00	4,669 % fällig am 25.09.2031	8	8	0,00	0,625 % fällig am 15.04.2023	109.059	106.753	1,01
Merrill Lynch Mortgage Investors Trust 5,079 % fällig am 25.08.2036	3.500	3.286	0,24	4,768 % fällig am 15.12.2031	1	1	0,00	0,625 % fällig am 15.01.2024 (e)	20.466	19.651	7,79
New Residential Mortgage Loan Trust 4,500 % fällig am 25.05.2058	468	440	0,03	4,818 % fällig am 15.04.2028	4	4	0,00	0,625 % fällig am 15.01.2026	39.328	37.481	1,43
Opteum Mortgage Acceptance Corp. Asset-Backed Pass-Through Certificates				4,968 % fällig am 15.03.2032	51	51	0,00	0,750 % fällig am 15.07.2028	759	615	2,74
6,189 % fällig am 25.04.2035	500	472	0,04	5,000 % fällig am 15.01.2035	186	186	0,01	0,750 % fällig am 15.02.2045	3.703	3.040	0,05
Regal Trust 2,605 % fällig am 29.09.2031	7	6	0,00	6,000 % fällig am 15.04.2036	3	3	0,00	0,875 % fällig am 15.02.2047	1.509	1.283	0,22
Residential Funding Mortgage Securities, Inc. Trust 6,500 % fällig am 25.03.2032	6	6	0,00	Ginnie Mae 2,673 % fällig am 20.10.2043	438	418	0,03	1,000 % fällig am 15.02.2046	2.941	2.734	0,09
Sequoia Mortgage Trust 4,272 % fällig am 20.04.2035	19	18	0,00	3,858 % fällig am 20.08.2068	539	524	0,04	1,375 % fällig am 15.02.2044	26.857	26.838	0,20
4,753 % fällig am 20.07.2036	583	499	0,04	3,868 % fällig am 20.08.2062	896	890	0,07	1,625 % fällig am 15.10.2027	5.758	5.756	1,96
5,039 % fällig am 19.10.2026	3	3	0,00	4,603 % fällig am 20.02.2035	26	26	0,00	1,750 % fällig am 15.01.2028	524	555	0,42
Structured Asset Mortgage Investments Trust 4,919 % fällig am 19.07.2034	2	2	0,00	4,605 % fällig am 20.03.2060	21	20	0,00	2,125 % fällig am 15.02.2040	952	1.010	0,07
4,999 % fällig am 19.10.2034	8	7	0,00	4,605 % fällig am 20.03.2060	21	20	0,00	2,375 % fällig am 15.01.2025	16.914	16.931	1,24
5,039 % fällig am 19.03.2034	7	7	0,00	4,843 % fällig am 20.02.2038	14	14	0,00	2,500 % fällig am 15.01.2029	1.678	1.750	0,13
Towd Point Mortgage Trust 2,750 % fällig am 25.10.2056	453	446	0,03	4,911 % fällig am 20.07.2062	560	558	0,04	3,875 % fällig am 15.04.2029	1.180	1.327	0,10
3,250 % fällig am 25.03.2058	611	586	0,04	Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.01.2053	900	762	0,06				
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust 3,448 % fällig am 25.06.2042	1	1	0,00	3,000 % fällig am 01.02.2053	20.500	18.012	1,32	Summe USA		1.118.922	81,68
5,009 % fällig am 25.01.2045	11	10	0,00	4,000 % fällig am 01.03.2053	62.714	58.853	4,30	KURZFRISTIGE INSTRUMENTE			
5,129 % fällig am 25.01.2045	56	54	0,01	4,500 % fällig am 01.02.2053	4.700	4.525	0,33	COMMERCIAL PAPER			
5,169 % fällig am 25.10.2044	165	149	0,01	US-SCHATZobligationen				AT&T, Inc.			
		8.216	0,60	U.S. Treasury Inflation Protected Securities (a)				4,650 % fällig am 03.01.2023	440	440	0,03
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN				0,125 % fällig am 15.07.2024	37.396	36.195	2,64	Crown Castle International Corp.			
Fannie Mae				0,125 % fällig am 15.10.2024 (e)	125.546	120.922	8,83	5,100 % fällig am 05.01.2023	340	340	0,02
4,959 % fällig am 25.09.2036	1	1	0,00	0,125 % fällig am 15.04.2025	58.372	55.640	4,06	Enel Finance America LLC			
5,188 % fällig am 01.11.2034	163	162	0,01	0,125 % fällig am 15.10.2025	50.529	48.033	3,51	6,000 % fällig am 12.01.2023	510	509	0,04
6,000 % fällig am 25.02.2044	4	4	0,00	0,125 % fällig am 15.04.2026 (e)	69.684	65.533	4,78	Summe kurzfristige Instrumente		1.289	0,09
6,500 % fällig am 25.06.2028	5	5	0,00	0,125 % fällig am 15.07.2026	6.849	6.456	0,47	Summe Übertragbare Wertpapiere		\$ 1.750.918	127,81
				0,125 % fällig am 15.10.2026 (e)	196.281	184.045	13,44	AKTIEN			
				0,125 % fällig am 15.07.2031	1.134	1.003	0,07	INVESTMENTFONDS			
				0,125 % fällig am 15.02.2051	572	369	0,03	ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN			
				0,250 % fällig am 15.01.2025 (e)	64.161	61.556	4,49	PIMCO Select Funds plc - PIMCO			
				0,250 % fällig am 15.07.2029	1.875	1.718	0,13	US Dollar Short-Term Floating			
				0,250 % fällig am 15.02.2050	695	470	0,03	NAV Fund (c)	12.099	120	0,01
				0,375 % fällig am 15.07.2023	33.675	33.277	2,43	Summe Investmentfonds		\$ 120	0,01
				0,375 % fällig am 15.07.2025	19.581	18.810	1,37				
				0,375 % fällig am 15.01.2027	3.836	3.619	0,26				
				0,375 % fällig am 15.07.2027	6.432	6.064	0,44				

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kapital- betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions- geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions- geschäft ⁽¹⁾	% des Nettovermögens
FICC	1,900 %	30.12.2022	03.01.2023	\$ 613	U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 29.06.2023	\$ (625)	\$ 613	\$ 613	0,04
IND	4,290	30.12.2022	03.01.2023	58.500	U.S. Treasury Bonds 4,750 % fällig am 15.02.2041	(60.504)	58.500	58.528	4,28
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (61.129)	\$ 59.113	\$ 59.141	4,32

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablaufmonat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
3-Month Euribor March Futures	Long	03.2023	487	\$ (4.265)	(0,31)
Australia Government 3-Year Note March Futures	Short	03.2023	69	63	0,00
Australia Government 10-Year Bond March Futures	Short	03.2023	63	279	0,02
Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 146,000 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond February 2023 Futures ⁽¹⁾	Short	01.2023	13	10	0,00
Euro-Bobl March Futures	Long	03.2023	356	(915)	(0,07)
Euro-BTP Italy Government Bond March Futures	Short	03.2023	577	2.933	0,21
Euro-Bund 10-Year Bond March Futures	Short	03.2023	513	4.620	0,34
Euro-Buxl 30-Year Bond March Futures	Short	03.2023	196	4.464	0,33
Euro-OAT France Government 10-Year Bond March Futures	Short	03.2023	15	142	0,01
Euro-Schatz March Futures	Short	03.2023	920	744	0,05
Japan Government 10-Year Bond March Futures	Short	03.2023	64	1.298	0,09
Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 138,500 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond February 2023 Futures ⁽¹⁾	Short	01.2023	13	(67)	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Commodity Real Return Fund (Forts.)

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
U.S. Treasury 2-Year Note March Futures	Long	03.2023	131	\$ 25	0,00
U.S. Treasury 5-Year Note March Futures	Long	03.2023	74	(66)	0,00
U.S. Treasury 10-Year Note March Futures	Long	03.2023	704	(899)	(0,07)
U.S. Treasury 30-Year Bond March Futures	Short	03.2023	512	348	0,03
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond March Futures	Long	03.2023	10	(14)	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond March Futures	Short	03.2023	547	491	0,04
United Kingdom Long Gilt March Futures	Long	03.2023	47	(369)	(0,03)
				\$ 8.822	0,64
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ 8.822	0,64

(1) Future-Style-Option.

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
General Electric Co.	1,000 %	20.12.2023	\$ 200	\$ 14	0,00

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	0,500 %	16.03.2042	£ 7.200	\$ 89	0,01
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,300	20.09.2027	¥ 74.880	10	0,00
Erhalt	1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS	2,000	15.12.2047	\$ 1.750	383	0,03
Erhalt	1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS	2,428	20.12.2047	400	59	0,00
Erhalt	1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS	2,478	20.12.2047	1.115	152	0,01
Erhalt	1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS	2,499	20.12.2047	570	77	0,01
Zahlung	3-Month EUR-EURIBOR	0,526	21.11.2023	€ 9.900	(361)	(0,03)
Erhalt	3-Month NZD-BBR	3,250	21.03.2028	NZD 900	34	0,00
Erhalt ⁽³⁾	3-Month USD-LIBOR	1,840	21.11.2028	\$ 13.800	1.135	0,08
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,880	25.01.2052	5.000	(1.452)	(0,11)
Zahlung ⁽³⁾	3-Month USD-LIBOR	1,888	21.11.2053	2.800	(767)	(0,06)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,000	04.11.2032	€ 5.600	(1.568)	(0,11)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,000	08.11.2032	4.900	(1.322)	(0,10)
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,190	04.11.2052	900	400	0,03
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,195	04.11.2052	950	479	0,04
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,197	08.11.2052	1.600	708	0,05
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,550	10.08.2024	200	(9)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,650	12.04.2027	4.900	(502)	(0,04)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,650	11.05.2027	2.400	(245)	(0,02)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,700	11.04.2027	2.100	(211)	(0,02)
Erhalt ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	0,830	09.12.2052	7.000	208	0,02
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,000	13.05.2027	4.700	(416)	(0,03)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,000	18.05.2027	2.100	(186)	(0,01)
Zahlung ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	1,750	15.03.2033	68.200	(2.064)	(0,15)
Zahlung	CPTFEMU	1,066	15.02.2024	3.800	(573)	(0,04)
Zahlung	CPTFEMU	1,168	15.03.2024	3.300	(494)	(0,04)
Zahlung	CPTFEMU	1,380	15.03.2031	4.000	(819)	(0,06)
Zahlung	CPTFEMU	1,475	15.05.2023	1.900	(227)	(0,02)
Zahlung	CPTFEMU	1,535	15.06.2023	2.900	(333)	(0,02)
Zahlung	CPTFEMU	1,946	15.03.2048	60	(16)	0,00
Zahlung	CPTFEMU	2,421	15.05.2052	700	(82)	(0,01)
Erhalt	CPTFEMU	2,470	15.07.2032	11.900	260	0,02
Zahlung	CPTFEMU	2,488	15.05.2037	4.790	(285)	(0,02)
Erhalt	CPTFEMU	2,570	15.06.2032	8.800	254	0,02
Zahlung	CPTFEMU	2,580	15.03.2052	500	(42)	0,00
Zahlung	CPTFEMU	2,590	15.03.2052	4.940	(362)	(0,03)
Erhalt	CPTFEMU	2,600	15.05.2032	10.600	383	0,03
Zahlung	CPTFEMU	3,520	15.09.2024	13.600	(228)	(0,02)
Zahlung	CPTFEMU	3,720	15.09.2024	5.000	(55)	0,00
Zahlung	CPTFEMU	3,850	15.09.2024	19.500	(203)	(0,01)
Erhalt	CPTFEMU	4,375	15.06.2024	100.000	1.442	0,11
Erhalt	CPURNSA	1,798	25.08.2027	\$ 1.000	143	0,01
Erhalt	CPURNSA	1,890	27.08.2027	3.000	410	0,03
Zahlung	CPURNSA	1,954	03.06.2029	700	(91)	(0,01)
Zahlung	CPURNSA	1,998	25.07.2029	3.600	(448)	(0,03)
Zahlung	CPURNSA	2,155	17.10.2027	1.900	(214)	(0,02)
Erhalt	CPURNSA	2,210	05.02.2023	5.270	476	0,04
Erhalt	CPURNSA	2,263	27.04.2023	1.450	121	0,01
Erhalt	CPURNSA	2,263	09.05.2023	1.790	149	0,01
Erhalt	CPURNSA	2,311	24.02.2031	5.100	531	0,04
Zahlung	CPURNSA	2,335	05.02.2028	2.680	(244)	(0,02)
Zahlung	CPURNSA	2,353	09.05.2028	1.790	(153)	(0,01)

Zahlung/ Erhalt	variabler Zinssatz	Varibler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	CPURNSA		2,360 %	09.05.2028	\$ 2.690	\$ (228)	(0,02)
Zahlung	CPURNSA		2,364	10.05.2028	2.750	(232)	(0,02)
Erhalt	CPURNSA		2,419	05.03.2026	2.300	210	0,02
Erhalt	CPURNSA		2,573	26.08.2028	1.100	66	0,00
Erhalt	CPURNSA		2,645	10.09.2028	1.500	79	0,01
Erhalt	CPURNSA		2,690	01.06.2026	2.100	154	0,01
Erhalt	CPURNSA		2,703	25.05.2026	1.270	93	0,01
Erhalt	CPURNSA		2,768	13.05.2026	3.100	220	0,02
Erhalt	CPURNSA		2,813	14.05.2026	1.400	96	0,01
Erhalt	FRCPXTOB		1,030	15.03.2024	€ 3.300	323	0,02
Zahlung	FRCPXTOB		1,910	15.01.2038	390	(83)	(0,01)
Zahlung	UKRPI		3,100	15.06.2031	£ 2.300	(392)	(0,03)
Zahlung	UKRPI		3,400	15.06.2030	1.610	(344)	(0,02)
Zahlung	UKRPI		3,515	15.02.2041	2.700	(336)	(0,02)
Zahlung	UKRPI		3,530	15.10.2031	540	(121)	(0,01)
Zahlung	UKRPI		3,566	15.03.2036	2.700	(428)	(0,03)
Zahlung	UKRPI		3,580	15.03.2036	2.000	(393)	(0,03)
Zahlung	UKRPI		4,066	15.09.2031	300	(41)	0,00
Erhalt	UKRPI		4,125	15.09.2032	590	7	0,00
Erhalt	UKRPI		4,130	15.09.2032	2.610	30	0,00
Erhalt	UKRPI		4,143	15.10.2032	2.300	24	0,00
Erhalt	UKRPI		4,480	15.09.2023	1.500	236	0,02
Erhalt	UKRPI		5,200	15.06.2024	1.200	61	0,00
Erhalt	UKRPI		5,330	15.06.2024	14.700	700	0,05
Zahlung	UKRPI		6,500	15.03.2024	3.400	(237)	(0,02)
Erhalt	UKRPI		6,600	15.05.2024	12.400	645	0,05
						\$ (5.960)	(0,43)
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate						\$ (5.946)	(0,43)

- (1) Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.
- (2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.
- (3) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

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

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

OPTIONSKAUF

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Varibler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
BPS	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,000 %	15.03.2023	600	\$ 68	\$ 325	0,02
BRC	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,410	02.02.2023	30.200	151	0	0,00
CBK	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,720	23.02.2023	58.700	323	0	0,00
DUB	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,237	17.11.2023	10.300	639	2.291	0,17
GLM	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,200	26.04.2023	21.100	225	13	0,00
JPM	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,710	25.01.2023	62.600	382	0	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,000	15.03.2023	600	66	325	0,02
MYC	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,428	31.01.2023	30.000	153	0	0,00
	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,200	31.05.2023	59.700	716	71	0,01
							\$ 2.723	\$ 3.025	0,22

VERKAUFSOPTIONEN

CREDIT DEFAULT SWAPTIONS AUF KREDITINDIZES

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/ -verkauf	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
GST	Put - OTC iTraxx Europe 37 5-Year Index	Verkauf	3,000 %	15.03.2023	1.800	\$ (3)	\$ 0	0,00

INFLATION-CAPPED OPTIONS

Kontrahent	Beschreibung	Anfänglicher Index	Varibler Zinssatz	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
GLM	Cap - OTC CPALEMU	\$ 100,151	Maximal [(Index Final/Index Initial - 1) - 3,000 %] oder 0	22.06.2035	1.200	\$ (55)	\$ (61)	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Commodity Real Return Fund (Forts.)

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
BPS	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,175 %	15.03.2023	1.800	\$ (66)	\$ (553)	(0,04)
BRC	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,558	02.02.2023	6.600	(151)	0	0,00
CBK	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,736	23.02.2023	13.000	(322)	0	0,00
DUB	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,340	17.11.2023	50.700	(639)	(3.286)	(0,24)
GLM	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,350	26.04.2023	11.700	(231)	(20)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,547	07.03.2023	2.500	(55)	(6)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,547	07.03.2023	2.500	(55)	(158)	(0,01)
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,067	09.06.2023	3.200	(38)	(8)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	3,140	09.06.2023	3.200	(44)	(105)	(0,01)
JPM	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,785	25.01.2023	13.900	(384)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,175	15.03.2023	1.800	(65)	(553)	(0,04)
MYC	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,579	31.01.2023	6.600	(154)	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,350	31.05.2023	32.900	(717)	(97)	(0,01)
							\$ (2.921)	\$ (4.786)	(0,35)

(1) Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Kontrahent	Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽²⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettovermögens
DUB	CMBX.NA.AAA.8 Index	0,500 %	17.10.2057	\$ 1.500	\$ (104)	\$ 105	\$ 1	0,00
GST	CMBX.NA.AAA.8 Index	0,500	17.10.2057	1.800	(94)	96	2	0,00
SAL	CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17.08.2061	700	(1)	(5)	(6)	0,00
					\$ (199)	\$ 196	\$ (3)	0,00

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

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

ZINSSWAPS

Kontrahent	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettovermögens
BOA	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	1,998 %	20.06.2028	ILS 890	\$ 0	\$ (18)	\$ (18)	0,00
BRC	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	1,950	20.06.2028	810	0	(17)	(17)	0,00
CKL	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	2,100	20.06.2028	750	(2)	(12)	(14)	0,00
GLM	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	1,971	16.02.2028	1.430	0	(26)	(26)	(0,01)
	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	1,998	20.06.2028	610	0	(13)	(13)	0,00
HUS	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	1,998	20.06.2028	480	0	(10)	(10)	0,00
						\$ (2)	\$ (96)	\$ (98)	(0,01)

TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES

Kontrahent	Zahlung/Erhalt	Wertpapier	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Variabler Zinssatz	Nenn- betrag	Fälligkeits- datum	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettovermögens
BPS	Erhalt	BCOMTR Index	1.365.724	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	\$ 338.139	15.02.2023	\$ 0	\$ (2.955)	\$ (2.955)	(0,21)
CBK	Erhalt	BCOMTR Index	544.691	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	134.860	15.02.2023	0	(1.178)	(1.178)	(0,09)
	Erhalt	CIXBSTR3 Index	324.655	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	89.432	15.02.2023	0	(1.279)	(1.279)	(0,09)
CIB	Erhalt	BCOMTR Index	154.350	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	38.215	15.02.2023	0	(334)	(334)	(0,02)
FBF	Erhalt	BCOMTR Index	83.595	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	20.697	15.02.2023	0	(181)	(181)	(0,01)
GST	Erhalt	BCOMF1TC Index	226.031	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	91.078	15.02.2023	0	(794)	(794)	(0,06)
	Erhalt	BCOMTR Index	1.162.316	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	287.777	15.02.2023	0	(2.516)	(2.516)	(0,18)
	Erhalt	BCOMTR2 Index	56.072	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	14.223	15.02.2023	0	(166)	(166)	(0,01)
JPM	Erhalt	BCOMF1TC Index	421.556	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	88.842	15.02.2023	0	(775)	(775)	(0,06)
	Erhalt	BCOMTR Index	485.976	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	120.323	15.02.2023	0	(1.064)	(1.064)	(0,08)
	Erhalt	JMABDEWU Index	494.170	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	76.584	15.02.2023	0	1.006	1.006	0,07
	Erhalt	JMABNIU5 Index	75.812	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	13.445	15.02.2024	0	488	488	0,04

Kontrahent	Zahlung/Erhalt	Wertpapier	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Variabler Zinssatz	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
MAC	Erhalt	PIMCO DBU Index	269.229	0,160 %	\$ 42.461	15.03.2023	\$ 0	\$ 1.137	\$ 1.137	0,08
MEI	Erhalt	BCOMTR Index	116.009	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	28.723	15.02.2023	0	(251)	(251)	(0,02)
SOG	Erhalt	BCOMTR Index	229.778	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	56.891	15.02.2023	0	(497)	(497)	(0,04)
							\$ 0	\$ (9.359)	\$ (9.359)	(0,68)

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2023	€ 72	\$ 76	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	01.2023	\$ 1.027	¥ 135.400	0	0	0	0,00
BPS	01.2023	ILS 576	\$ 168	5	0	5	0,00
	01.2023	\$ 1.056	€ 991	2	0	2	0,00
	03.2023	PEN 3.733	\$ 960	0	(12)	(12)	0,00
BRC	01.2023	£ 28.236	34.361	391	0	391	0,03
	01.2023	SEK 124.706	11.907	0	(66)	(66)	0,00
	01.2023	SGD 436	324	0	(1)	(1)	0,00
	01.2023	\$ 1.132	€ 1.064	4	0	4	0,00
CBK	01.2023	AUD 253	\$ 172	1	0	1	0,00
	01.2023	DKK 6.235	878	0	(17)	(17)	0,00
	01.2023	¥ 143.300	1.040	0	(47)	(47)	0,00
	01.2023	SEK 9.960	956	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 2.370	DKK 16.715	30	0	30	0,00
	01.2023	3.208	€ 3.022	19	0	19	0,00
	01.2023	45	PEN 182	2	0	2	0,00
	03.2023	66	267	3	0	3	0,00
DUB	01.2023	DKK 203.661	\$ 28.705	0	(538)	(538)	(0,04)
JPM	01.2023	£ 73.338	88.557	325	0	325	0,02
	01.2023	\$ 1.339	DKK 9.560	34	0	34	0,00
MBC	01.2023	AUD 311	\$ 209	0	(2)	(2)	0,00
	01.2023	CAD 3.623	2.701	27	0	27	0,00
	01.2023	DKK 184.169	26.015	0	(428)	(428)	(0,03)
	01.2023	€ 287.785	301.633	0	(5.637)	(5.637)	(0,41)
	01.2023	¥ 1.527.641	11.095	0	(491)	(491)	(0,04)
	01.2023	\$ 4.603	€ 4.372	64	0	64	0,00
MYI	01.2023	AUD 9.865	\$ 6.625	0	(67)	(67)	0,00
	01.2023	€ 5	5	0	0	0	0,00
	01.2023	£ 46	56	0	0	0	0,00
	01.2023	¥ 7.290.955	53.181	0	(2.114)	(2.114)	(0,15)
	01.2023	SGD 7	5	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 550	€ 517	1	0	1	0,00
	01.2023	48	SGD 65	0	0	0	0,00
RBC	01.2023	AUD 114	\$ 76	0	(1)	(1)	0,00
SCX	01.2023	661	446	0	(3)	(3)	0,00
	01.2023	NZD 3.103	1.933	0	(30)	(30)	0,00
	01.2023	\$ 798	€ 749	2	0	2	0,00
	01.2023	337	£ 279	0	(1)	(1)	0,00
	01.2023	48	PEN 185	0	0	0	0,00
	03.2023	47	182	0	0	0	0,00
UAG	01.2023	ILS 7	\$ 2	0	0	0	0,00
	01.2023	SEK 7.956	760	0	(4)	(4)	0,00
				\$ 910	\$ (9.459)	\$ (8.549)	(0,62)

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2023	€ 6.838	\$ 7.211	\$ 0	\$ (89)	\$ (89)	(0,01)
BPS	01.2023	1.003	1.070	0	(1)	(1)	0,00
CBK	01.2023	2.773	2.949	0	(11)	(11)	0,00
	01.2023	\$ 170.634	€ 164.351	4.845	0	4.845	0,34
MBC	01.2023	€ 3.255	\$ 3.451	0	(26)	(26)	0,00
	01.2023	\$ 173.854	€ 165.877	3.254	0	3.254	0,24
RYL	01.2023	€ 51	\$ 54	0	0	0	0,00
SCX	01.2023	\$ 163.481	€ 157.065	4.218	0	4.218	0,31
				\$ 12.317	\$ (127)	\$ 12.190	0,88

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Commodity Real Return Fund (Forts.)

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilsklasse Institutional GBP (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2023	£ 34	\$ 42	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	01.2023	\$ 15.599	£ 12.956	0	(11)	(11)	0,00
BPS	01.2023	£ 34	\$ 41	0	0	0	0,00
BRC	01.2023	\$ 45	£ 37	0	0	0	0,00
JPM	01.2023	15.943	13.203	0	(58)	(58)	0,00
MBC	01.2023	£ 21	\$ 26	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 16.420	£ 13.698	69	(9)	60	0,00
MYI	01.2023	£ 664	\$ 809	10	0	10	0,00
	01.2023	\$ 784	£ 638	0	(17)	(17)	0,00
UAG	01.2023	£ 12	\$ 15	1	0	1	0,00
				\$ 80	\$ (95)	\$ (15)	0,00

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilsklasse Class E SGD (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2023	\$ 935	SGD 1.282	\$ 21	\$ 0	\$ 21	0,00
BPS	01.2023	947	1.299	22	0	22	0,00
GSC	01.2023	SGD 1.129	\$ 832	0	(10)	(10)	0,00
	01.2023	\$ 383	SGD 523	7	0	7	0,00
MBC	01.2023	SGD 87	\$ 64	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 953	SGD 1.303	19	0	19	0,00
MYI	01.2023	SGD 685	\$ 507	0	(3)	(3)	0,00
UAG	01.2023	394	287	0	(7)	(7)	0,00
	01.2023	\$ 10	SGD 13	0	0	0	0,00
				\$ 69	\$ (20)	\$ 49	0,00

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ (7.607) (0,56)

Summe Anlagen

\$ 1.805.420 131,79

Sonstige Aktiva und Passiva

\$ (435.543) (31,79)

Nettovermögen

\$ 1.369.877 100,00

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

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

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

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

(c) Mit dem Fonds verbunden.

(d) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(e) Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von 400.193 USD (31. Dezember 2021: 23.024 USD) wurden gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen zum 31. Dezember 2022 als Sicherheiten verpfändet.

(f) Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von 17.272 USD (31. Dezember 2021: 80.697 USD) wurden gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte zum 31. Dezember 2022 als Sicherheiten für verzögert gelieferte Wertpapiere oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte verpfändet oder geliefert.

Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von 157 USD (31. Dezember 2021: 0 USD) wurden gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen zum 31. Dezember 2022 als Sicherheiten erhalten.

Barmittel in Höhe von 19.275 USD (31. Dezember 2021: 7.875 USD) wurden zum 31. Dezember 2022 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 18.770 USD (31. Dezember 2021: 2.190 USD) wurden gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. zum 31. Dezember 2022 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 1.750.918	\$ 0	\$ 1.750.918
Investmentfonds	120	0	0	120
Pensionsgeschäfte	0	59.113	0	59.113
Finanzderivate ⁽³⁾	8.938	(13.669)	0	(4.731)
Summen	\$ 9.058	\$ 1.796.362	\$ 0	\$ 1.805.420

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

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 1.554.523	\$ 0	\$ 1.554.523
Investmentfonds	18	0	0	18
Pensionsgeschäfte	0	2.098	0	2.098
Finanzderivate ⁽³⁾	3.330	52.131	0	55.461
Summen	\$ 3.348	\$ 1.608.752	\$ 0	\$ 1.612.100

(1) Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

(2) Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

(3) Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions-geschäften	% des Nettovermögens
BOS	4,430 %	12.12.2022	05.01.2023	\$ (484)	\$ (485)	(0,04)
CIB	4,200	17.11.2022	11.01.2023	(82.025)	(82.455)	(6,02)
	4,200	23.11.2022	11.01.2023	(184.275)	(185.114)	(13,51)
	4,370	08.12.2022	05.01.2023	(32.093)	(32.186)	(2,35)
	4,400	05.01.2023	19.01.2023	(32.221)	(32.221)	(2,35)
GRE	4,360	07.12.2022	05.01.2023	(60.953)	(61.137)	(4,46)
	4,430	12.12.2022	05.01.2023	(6.534)	(6.550)	(0,48)
RCY	4,250	10.11.2022	24.01.2023	(25.000)	(25.154)	(1,84)
Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte					\$ (425.302)	(31,05)

Ausstehende Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zum 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Zahlbar für Rückkauf- Finanzierungs- geschäfte ⁽¹⁾	% des Nettovermögens
BOS	4,210 %	09.11.2022	09.01.2023	\$ (17.846)	\$ (17.959)	(1,31)
Summe Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte					\$ (17.959)	(1,31)

(1) In dem für Rückkaufgeschäfte zahlbaren Betrag sind 15 USD für einen aufgeschobenen Kursrückgang enthalten.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung des Marktwerts der außerbörslich gehandelten Finanzderivate und (erhaltenen)/verpfändeten Sicherheiten nach Kontrahenten zum 31. Dezember 2022 und 31. Dezember 2021:

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2022			Zum 31. Dez. 2021		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement ⁽¹⁾	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Nettoengagement ⁽¹⁾
BOA	\$ (97)	\$ 0	\$ (97)	\$ 245	\$ (270)	\$ (25)
BPS	(3.167)	4.390	1.223	9.902	(10.590)	(688)
BRC	311	(320)	(9)	(2)	0	(2)
CBK	2.368	(1.310)	1.058	6.162	(6.720)	(558)
CIB	(334)	470	136	1.202	(1.500)	(298)
CKL	(14)	0	(14)	21	0	21
DUB	(1.532)	1.480	(52)	(1)	0	(1)
FBF	(181)	80	(101)	651	(840)	(189)
GLM	(384)	260	(124)	36	(110)	(74)
GSC	(3)	0	(3)	(2)	0	(2)
GST	(3.474)	4.890	1.416	11.226	(12.030)	(804)
HUS	(10)	0	(10)	249	0	249
JPM	(272)	1.520	1.248	20.479	(21.410)	(931)
MAC	1.137	(840)	297	1.646	(1.770)	(124)
MBC	(3.160)	2.770	(390)	k. A.	k. A.	k. A.
MEI	(251)	320	69	2.152	(2.310)	(158)
MYC	(26)	260	234	(28)	(16)	(44)
MYI	(2.190)	1.630	(560)	290	(440)	(150)
NAB	k. A.	k. A.	k. A.	352	(280)	72
RBC	(1)	0	(1)	1.543	(1.210)	333
SAL	(6)	100	94	(33)	0	(33)
SCX	4.186	(4.010)	176	(2.717)	2.190	(527)
SOG	(497)	570	73	859	(1.150)	(291)
TOR	k. A.	k. A.	k. A.	1.244	(980)	264
UAG	(10)	30	20	40	0	40

(1) Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2022:

	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	108,79	89,98
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	18,76	17,17
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,26	0,49
Investmentfonds	0,01	0,00
Pensionsgeschäfte	4,32	0,15
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,64	0,14
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,43)	(0,14)
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,56)	3,84
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(31,05)	(1,59)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	(1,31)	(5,59)

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2022 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
Australien	0,51	0,60
Kanada	0,18	0,20
Cayman-Inseln	5,01	0,45
Dänemark	3,73	4,57
Frankreich	5,36	7,69
Deutschland	1,07	k. A.
Guernsey, Kanalinseln	k. A.	0,03
Irland	4,58	3,94
Italien	6,97	8,33
Japan	4,89	4,77
Niederlande	0,03	0,03
Neuseeland	0,14	0,15
Peru	0,04	0,10
Katar	0,02	0,04
Saudi-Arabien	0,02	0,02
Spanien	3,61	0,56
Schweden	0,99	1,06
Großbritannien	8,89	6,62
USA	81,68	68,48
Kurzfristige Instrumente	0,09	k. A.
Investmentfonds	0,01	0,00
Pensionsgeschäfte	4,32	0,15
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,64	0,14
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen –		
Schutzverkauf	0,00	0,00
Zinsswaps	(0,43)	(0,14)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Zinsswapoptionen	0,22	0,08
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaptions auf Kreditindizes	0,00	0,00
Inflation-Capped Options	0,00	0,00
Zinsswapoptionen	(0,35)	(0,10)
Optionen auf Wertpapiere	k. A.	(0,01)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf	0,00	0,00
Zinsswaps	(0,01)	0,01
Total Return Swaps auf Indizes	(0,68)	3,70
Devisenterminkontrakte	(0,62)	(0,17)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,88	0,33
Sonstige Aktiva und Passiva	(31,79)	(11,63)
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG	MARKT- PARI (000S)	WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE			
ARGENTINIEN			
STAATSEMISSIONEN			
Argentina Government International Bond 1,000 % fällig am 09.07.2029	\$ 13	\$ 3	0,00
3,500 % fällig am 09.07.2041	800	230	0,24
Provincia de Buenos Aires 72,913 % fällig am 12.04.2025 (a)	ARS 20	0	0,00
Summe Argentinien		233	0,24
AUSTRALIEN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Santos Finance Ltd. 3,649 % fällig am 29.04.2031	\$ 1.100	875	0,90
Virgin Australia Holdings Pty. Ltd 8,125 % fällig am 15.11.2024 ^	377	2	0,00
Summe Australien		877	0,90
BRASILIEN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Vale Overseas Ltd. 6,875 % fällig am 10.11.2039	375	396	0,41
KANADA			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Air Canada 3,875 % fällig am 15.08.2026	1.025	910	0,94
CAYMAN INSELN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Kaisa Group Holdings Ltd. 11,500 % fällig am 30.01.2023 ^	600	84	0,09
Sands China Ltd. 4,875 % fällig am 18.06.2030	300	264	0,27
Sunac China Holdings Ltd. 5,950 % fällig am 26.04.2024 ^	450	99	0,10
Wynn Macau Ltd. 5,500 % fällig am 01.10.2027	200	175	0,18
Summe Cayman Inseln		622	0,64
CHINA			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Yango Justice International Ltd. 7,500 % fällig am 15.04.2024 ^	200	8	0,01
9,250 % fällig am 15.04.2023 ^	200	7	0,01
Summe China		15	0,02
FRANKREICH			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
BNP Paribas S.A. 3,132 % fällig am 20.01.2033	600	475	0,49
7,750 % fällig am 16.08.2029 (f)(h)	200	198	0,20
Societe Generale S.A. 3,337 % fällig am 21.01.2033	450	356	0,37
Summe Frankreich		1.029	1,06
ITALIEN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Intesa Sanpaolo SpA 4,950 % fällig am 01.06.2042	200	129	0,13
Societa per Azioni Esercizi Aeroportuali SEA SpA 3,500 % fällig am 09.10.2025	€ 200	198	0,21
Summe Italien		327	0,34
JAPAN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc. 5,133 % fällig am 20.07.2033	\$ 500	479	0,49
Nomura Holdings, Inc. 2,999 % fällig am 22.01.2032	375	295	0,31
Summe Japan		774	0,80

BESCHREIBUNG	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
LUXEMBURG		
STAMMAKTIEN		
Intelsat Emergence S.A. (c)(i)	7.480 \$	180 0,18
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL		
Constellation Oil Services Holding S.A. (3,000 % bar oder 4,000 % PIK) 3,000 % fällig am 31.12.2026 (b)	\$ 511	302 0,31
Intelsat Jackson Holdings S.A. 6,500 % fällig am 15.03.2030	562	504 0,52
		806 0,83
KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG		
Intelsat Jackson Holdings S.A. 7,445 % fällig am 01.02.2029	147	142 0,15
RECHTE		
Intelsat Jackson Holdings S.A. – Exp. 5. Dezember 2025	1.566	11 0,01
Summe Luxemburg		1.139 1,17
AKTIEN		
MULTINATIONAL		
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL		
Delta Air Lines, Inc. 4,750 % fällig am 20.10.2028	\$ 400	376 0,39
NXP BV 3,250 % fällig am 11.05.2041	875	614 0,63
Summe multinational		990 1,02
NIEDERLANDE		
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL		
LeasePlan Corp. NV 7,375 % fällig am 29.05.2024 (f)(h)	€ 700	742 0,76
Prosus NV 3,832 % fällig am 08.02.2051	\$ 300	182 0,19
Summe Niederlande		924 0,95
PERU		
STAATSEMISSIONEN		
Peru Government International Bond 6,350 % fällig am 12.08.2028	PEN 2.900	724 0,74
KATAR		
STAATSEMISSIONEN		
Qatar Government International Bond 3,750 % fällig am 16.04.2030	\$ 400	388 0,40
SÜDAFRIKA		
STAATSEMISSIONEN		
South Africa Government International Bond 10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR 26.800	1.665 1,71
SPANIEN		
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL		
Cellnex Finance Co. S.A. 1,500 % fällig am 08.06.2028	€ 400	356 0,37
SCHWEIZ		
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL		
Credit Suisse Group AG 6,442 % fällig am 11.08.2028	\$ 400	365 0,37
6,537 % fällig am 12.08.2033	250	220 0,23
UBS Group AG 4,988 % fällig am 05.08.2033	500	464 0,48
Summe Schweiz		1.049 1,08

BESCHREIBUNG	MARKT- PARI (000S)	WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
GROSSBRITANNIEN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Barclays PLC 5,746 % fällig am 09.08.2033	\$ 500	\$ 474	0,49
Gazprom PJSC Via Gaz Finance PLC 2,950 % fällig am 27.01.2029	500	347	0,36
Grainger PLC 3,000 % fällig am 03.07.2030	£ 200	181	0,18
HSBC Holdings PLC 4,600 % fällig am 17.12.2030 (f)(h)	\$ 300	234	0,24
5,402 % fällig am 11.08.2033	250	232	0,24
INEOS Quattro Finance PLC 2,500 % fällig am 15.01.2026	€ 100	91	0,09
John Lewis PLC 4,250 % fällig am 18.12.2034	£ 300	220	0,23
Market Bidco Finco PLC 4,750 % fällig am 04.11.2027	€ 800	689	0,71
UNITE Group PLC 3,500 % fällig am 15.10.2028	£ 200	204	0,21
Virgin Media Secured Finance PLC 4,125 % fällig am 15.08.2030	300	277	0,28
Vmed O2 UK Financing PLC 3,250 % fällig am 31.01.2031	€ 375	320	0,33
Summe Großbritannien		3.269	3,36
USA			
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE			
ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust 5,214 % fällig am 25.12.2045 ^	\$ 290	224	0,23
Argent Securities Trust 4,539 % fällig am 25.09.2036	768	256	0,26
4,749 % fällig am 25.04.2036	270	90	0,09
4,949 % fällig am 25.04.2036	661	220	0,23
Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust 5,214 % fällig am 25.06.2036	34	34	0,03
Citigroup Mortgage Loan Trust 4,549 % fällig am 25.12.2036	1.652	932	0,96
First Franklin Mortgage Loan Trust 5,814 % fällig am 25.10.2034	315	309	0,32
GSAMP Trust 4,479 % fällig am 25.01.2037	380	231	0,24
4,509 % fällig am 25.12.2036	536	268	0,28
4,619 % fällig am 25.12.2046	661	332	0,34
MASTR Asset-Backed Securities Trust 4,869 % fällig am 25.08.2036	483	196	0,20
Merrill Lynch Mortgage Investors Trust 4,509 % fällig am 25.11.2037	71	25	0,02
Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust 4,519 % fällig am 25.01.2037	352	175	0,18
4,529 % fällig am 25.10.2036	274	132	0,14
4,689 % fällig am 25.09.2036	1.786	685	0,70
4,849 % fällig am 25.09.2036	60	27	0,03
Morgan Stanley Home Equity Loan Trust 4,489 % fällig am 25.04.2037	63	35	0,04
Morgan Stanley Mortgage Loan Trust 6,465 % fällig am 25.09.2046 ^	639	245	0,25
New Century Home Equity Loan Trust 7,389 % fällig am 25.01.2033 ^	66	56	0,06
NovaStar Mortgage Funding Trust 4,689 % fällig am 25.06.2036	529	407	0,42
4,689 % fällig am 25.09.2036	856	373	0,38
Option One Mortgage Loan Trust 4,639 % fällig am 25.03.2037	508	250	0,26
Residential Asset Mortgage Products Trust 4,849 % fällig am 25.12.2035	1.131	961	0,99
Residential Asset Securities Corp. Trust 4,466 % fällig am 25.08.2034	376	360	0,37
Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust 5,349 % fällig am 25.01.2036 ^	121	115	0,12
Soundview Home Loan Trust 4,569 % fällig am 25.07.2037	256	231	0,24
Specialty Underwriting & Residential Finance Trust 4,689 % fällig am 25.09.2037	356	248	0,25
		7.417	7,63

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Credit Suisse Mortgage Capital Mortgage-Backed Trust				Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust				JUNGFERNINSELN (BRITISCH)			
6,000 % fällig am 25.07.2036	\$ 146	\$ 78	0,08	4,869 % fällig am 25.05.2037 ^	\$ 83	\$ 72	0,07	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
6,500 % fällig am 25.10.2021 ^	157	12	0,01	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust				Studio City Finance Ltd.			
Deutsche ALT-A Securities Mortgage Loan Trust				4,466 % fällig am 25.05.2035 ^	1.335	1.138	1,17	5,000 % fällig am 15.01.2029	\$ 300	\$ 222	0,23
4,529 % fällig am 25.07.2047	13	12	0,01								
4,539 % fällig am 25.02.2047	3.226	1.911	1,97								
4,769 % fällig am 25.10.2036 ^	175	60	0,06								
Deutsche ALT-A Securities, Inc. Mortgage Loan Trust											
2,693 % fällig am 25.08.2035 ^	13	11	0,01								
First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust											
3,592 % fällig am 25.08.2035 ^	5	4	0,00								
Impac Secured Assets Trust											
4,689 % fällig am 25.11.2036	61	60	0,06								
IndyMac Mortgage Loan Trust											
3,088 % fällig am 25.05.2037 ^	57	48	0,05								
3,140 % fällig am 25.12.2034	244	234	0,24								
4,889 % fällig am 25.02.2037	23	15	0,02								
JPMorgan Mortgage Trust											
6,500 % fällig am 25.07.2036 ^	243	109	0,11								
Lehman XS Trust											
4,749 % fällig am 25.07.2037 ^	284	255	0,26								
4,944 % fällig am 25.08.2047 ^	193	166	0,17								
Morgan Stanley Mortgage Loan Trust											
2,980 % fällig am 25.11.2037	198	130	0,13								
Residential Accredit Loans, Inc. Trust											
3,839 % fällig am 25.07.2035	2	2	0,00								
4,506 % fällig am 25.12.2035 ^	17	13	0,01								
4,739 % fällig am 25.08.2035 ^	21	17	0,02								
5,139 % fällig am 25.11.2036 ^	551	408	0,42								
Residential Asset Securitization Trust											
5,750 % fällig am 25.03.2037 ^	227	75	0,08								
6,000 % fällig am 25.02.2036	323	146	0,15								
6,250 % fällig am 25.11.2036 ^	480	190	0,20								

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft ⁽¹⁾	% des Nettovermögens
BPS	4,100 %	30.12.2022	03.01.2023	\$ 6.300	U.S. Treasury Notes 1,625 % fällig am 15.05.2031	\$ (6.438)	\$ 6.300	\$ 6.303	6,48
FICC	1,900	30.12.2022	03.01.2023	610	U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 29.06.2023	(622)	610	610	0,63
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (7.060)	\$ 6.910	\$ 6.913	7,11

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
3-Month SOFR December Futures	Short	03.2024	50	\$ 237	0,24
Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 146,000 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond February 2023 Futures ⁽¹⁾	Short	01.2023	1	1	0,00
Euro-Bund 10-Year Bond March Futures	Short	03.2023	4	37	0,04
Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 138,500 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond February 2023 Futures ⁽¹⁾	Short	01.2023	1	(5)	(0,01)
U.S. Treasury 2-Year Note March Futures	Short	03.2023	10	(3)	0,00
U.S. Treasury 5-Year Note March Futures	Long	03.2023	20	(1)	0,00
U.S. Treasury 10-Year Note March Futures	Short	03.2023	114	112	0,12
U.S. Treasury 30-Year Bond March Futures	Short	03.2023	53	(2)	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond March Futures	Short	03.2023	14	(4)	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond March Futures	Short	03.2023	11	22	0,02
				\$ 394	0,41
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ 394	0,41

(1) Future-Style-Option.

Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO Credit Opportunities Bond Fund (Forts.)

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZKAUF⁽¹⁾

Referenzinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Anheuser-Busch InBev S.A.	(1,000) %	20.12.2023	€ 1.300	\$ 18	0,02
AutoZone, Inc.	(1,000)	20.06.2024	\$ 1.400	21	0,02
Bath & Body Works, Inc.	(1,000)	20.12.2023	350	(26)	(0,03)
ConocoPhillips	(1,000)	20.12.2024	100	(1)	0,00
Johnson Controls International PLC	(1,000)	20.12.2024	1.500	31	0,03
Lowe's Cos., Inc.	(1,000)	20.12.2023	700	11	0,01
Tyson Foods, Inc.	(1,000)	20.06.2024	1.400	25	0,03
				\$ 79	0,08

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽²⁾

Referenzinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽³⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
AT&T, Inc.	1,000 %	20.06.2027	\$ 100	\$ 1	0,00
Bombardier, Inc.	5,000	20.12.2024	200	14	0,01
MetLife, Inc.	1,000	20.12.2024	100	(1)	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20.06.2025	€ 100	17	0,02
Rolls-Royce PLC	1,000	20.12.2025	200	8	0,01
Toll Brothers Finance Corp.	1,000	20.06.2026	\$ 200	(2)	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.12.2027	100	1	0,00
				\$ 38	0,04

ZINSSWAPS

Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt ⁽⁴⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	2,000 %	15.03.2033	£ 900	\$ (21)	(0,02)
Erhalt ⁽⁴⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	2,000	15.03.2053	100	1	0,00
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000	15.09.2027	¥ 94.200	19	0,02
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,050	14.12.2052	\$ 300	11	0,01
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,700	04.01.2027	BRL 4.900	(23)	(0,02)
Erhalt	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,250	21.12.2027	CNY 29.000	(2)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,270	04.11.2023	\$ 12.400	(432)	(0,44)
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	7,300	28.04.2027	ZAR 15.500	25	0,03
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,000	13.05.2027	€ 600	(53)	(0,06)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,000	18.05.2027	300	(27)	(0,03)
Erhalt ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	1,750	15.03.2033	1.700	50	0,05
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,140	24.03.2023	MXN 7.200	(5)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,345	13.06.2023	15.200	(20)	(0,02)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,400	05.03.2026	10.000	(54)	(0,06)
					\$ (531)	(0,55)
					\$ (414)	(0,43)

Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate

- (1) Agiert der Teilfonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Teilfonds entweder (i) vom Sicherungsgeber einen Betrag in Höhe des Nennwerts des Swaps und liefert die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er erhält einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.
- (2) Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.
- (3) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.
- (4) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

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

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

OPTIONSKAUF

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,021 %	25.10.2023	1.500	\$ 85	\$ 377	0,39
BPS	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,000	15.03.2023	260	30	141	0,14
JPM	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,000	15.03.2023	180	20	98	0,10
							\$ 135	\$ 616	0,63

VERKAUFSOPTIONEN

CREDIT DEFAULT SWAPPTIONS AUF KREDITINDIZES

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/-verkauf	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
GST	Put - OTC iTraxx Europe 37 5-Year Index	Verkauf	3,000 %	15.03.2023	200	\$ 0	\$ 0	0,00

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,870 %	23.01.2023	100	\$ (1)	\$ 0	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,320	23.01.2023	100	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,020	25.10.2023	7.500	(86)	(591)	(0,61)
BPS	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,900	17.01.2023	100	0	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,400	17.01.2023	100	0	(2)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,175	15.03.2023	790	(29)	(243)	(0,25)
GLM	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,000	12.01.2023	100	(1)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,550	12.01.2023	100	(1)	(1)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,547	07.03.2023	200	(4)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,547	07.03.2023	200	(4)	(12)	(0,01)
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,067	09.06.2023	300	(4)	(1)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	3,140	09.06.2023	300	(4)	(10)	(0,01)
JPM	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,175	15.03.2023	550	(20)	(169)	(0,18)
MYC	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,070	23.01.2023	100	(1)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,520	23.01.2023	100	0	(1)	0,00
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,600	17.01.2023	100	(1)	0	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,050	17.01.2023	100	(1)	(4)	0,00
							\$ (158)	\$ (1.035)	(1,06)

OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.01.2053	\$ 101,891	05.01.2023	100	\$ 0	\$ 0	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.02.2053	99,813	06.02.2023	100	(1)	(1)	0,00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.02.2053	101,813	06.02.2023	100	(1)	0	0,00
JPM	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.03.2053	97,156	06.03.2023	200	(1)	(3)	(0,01)
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fällig am 01.03.2053	98,766	06.03.2023	100	(1)	(2)	0,00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fällig am 01.03.2053	100,766	06.03.2023	100	(1)	0	0,00
SAL	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.01.2053	101,859	05.01.2023	100	0	0	0,00
					\$ (5)	\$ (6)	(0,01)

⁽¹⁾ Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZKAUF⁽¹⁾

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag ⁽²⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
CBK	Mexico Government International Bond	(1,000) %	20.12.2023	\$ 2.200	\$ 25	\$ (37)	\$ (12)	(0,01)

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽²⁾

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag ⁽²⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BRC	Italy Government International Bond	1,000 %	20.12.2024	\$ 200	\$ 1	\$ 2	\$ 3	0,00
	Pertamina Persero PT	1,000	20.12.2024	100	0	1	1	0,00
					\$ 1	\$ 3	\$ 4	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO Credit Opportunities Bond Fund (Forts.)

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF⁽²⁾

Kontrahent	Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽³⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
CBK	CDX.HY-31 5-Year Index 25-35 %	5,000 %	20.12.2023	\$ 100	\$ 10	\$ (6)	\$ 4	0,01
GST	CDX.HY-31 5-Year Index 25-35 %	5,000	20.12.2023	200	23	(14)	9	0,01
JPM	CDX.HY-31 5-Year Index 25-35 %	5,000	20.12.2023	300	39	(26)	13	0,01
					\$ 72	\$ (46)	\$ 26	0,03

- (1) Agiert der Teilfonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Teilfonds entweder (i) vom Sicherungsgeber einen Betrag in Höhe des Nennwerts des Swaps und liefert die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er erhält einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.
- (2) Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.
- (3) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES

Kontrahent	Zahlung/Erhalt	Wertpapier	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Variable Zinssatz	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BPS	Erhalt	iBoxx USD Liquid High Yield Index	k. A.	1,058 %	\$ 4.800	20.03.2023	\$ 1	\$ (160)	\$ (159)	(0,16)

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu zahlende Betrag	Zu erhaltende Währung	Zu erhaltende Betrag	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	02.2023	\$	143	CHF	135	\$ 4	\$ 0	\$ 4	0,01
	02.2023		121	NOK	1.196	1	0	1	0,00
	02.2023	ZAR	2.934	\$	164	0	(8)	(8)	(0,01)
BPS	03.2023		3.610		204	0	(6)	(6)	(0,01)
	01.2023	HUF	91.660		236	0	(8)	(8)	(0,01)
	02.2023	\$	13	IDR	197.480	0	0	0	0,00
BRC	02.2023	ZAR	2.297	\$	128	0	(7)	(7)	(0,01)
	03.2023	PEN	4.012		1.032	0	(13)	(13)	(0,01)
	03.2023	\$	228	COP	1.113.540	0	(1)	(1)	0,00
CBK	03.2023		99	MXN	1.987	2	0	2	0,00
	01.2023	CNH	303	\$	43	0	0	0	0,00
	02.2023	\$	74	CHF	70	1	0	1	0,00
GLM	01.2023	CLP	173.768	\$	195	0	(8)	(8)	(0,01)
	01.2023	\$	98	BRL	517	0	(1)	(1)	0,00
	01.2023		182	CLP	173.709	22	0	22	0,02
JPM	01.2023		51	€	48	0	0	0	0,00
	01.2023		54	ZAR	948	2	0	2	0,00
	02.2023	NOK	550	\$	56	0	0	0	0,00
MBC	02.2023	\$	195	CLP	174.725	9	0	9	0,01
	02.2023		727	PEN	2.901	32	0	32	0,03
	03.2023	PEN	2.936	\$	730	0	(36)	(36)	(0,03)
DUB	03.2023	\$	34	MXN	708	2	0	2	0,00
	04.2023		304	PEN	1.215	12	0	12	0,01
	02.2023	ZAR	3.013	\$	180	4	0	4	0,01
RBC	01.2023	BRL	517		97	0	(1)	(1)	0,00
	01.2023	CNH	314		45	0	0	0	0,00
	01.2023	ZAR	2.997		168	0	(8)	(8)	(0,01)
MBC	03.2023	COP	1.113.540		231	4	0	4	0,01
	03.2023	\$	231	COP	1.113.540	0	(4)	(4)	0,00
	04.2023		95	BRL	517	1	0	1	0,00
JPM	05.2023	ZAR	5.296	\$	317	9	0	9	0,01
	02.2023	\$	22	IDR	341.076	0	0	0	0,00
	03.2023		21		336.476	0	0	0	0,00
MBC	01.2023	AUD	73	\$	50	0	0	0	0,00
	01.2023	€	2.618		2.744	0	(52)	(52)	(0,05)
	01.2023	£	741		903	12	0	12	0,01
MYI	01.2023	\$	8	AUD	13	0	0	0	0,00
	01.2023		468	€	443	5	0	5	0,01
	03.2023		13	IDR	204.219	0	0	0	0,00
RBC	05.2023	CNH	194	\$	29	1	0	1	0,00
	01.2023	€	5		6	0	0	0	0,00
	01.2023	\$	266	AUD	396	3	0	3	0,00
RBC	01.2023		79	ZAR	1.356	0	0	0	0,00
	03.2023		18	IDR	287.736	0	0	0	0,00
	01.2023		3	AUD	5	0	0	0	0,00
RBC	02.2023		183	NOK	1.824	3	0	3	0,00
	03.2023		20	MXN	404	0	0	0	0,00

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
SCX	01.2023	\$ 18	AUD 27	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	02.2023	23	IDR 358.886	0	0	0	0,00
	04.2023	ZAR 2.860	\$ 155	0	(11)	(11)	(0,01)
UAG	01.2023	2.301	128	0	(7)	(7)	(0,01)
	02.2023	\$ 34	IDR 532.647	1	0	1	0,00
	09.2023	ZAR 3.978	\$ 227	0	(2)	(2)	0,00
				\$ 130	\$ (173)	\$ (43)	(0,04)

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 31. Dezember 2022 standen fur die Anteilsklasse Institutional CHF (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
BOA	01.2023	\$ 5.950	CHF 5.629	\$ 138	\$ 0	\$ 138	0,14
CBK	01.2023	10.205	9.643	224	0	224	0,23
MYI	01.2023	172	160	1	0	1	0,00
				\$ 363	\$ 0	\$ 363	0,37

Zum 31. Dezember 2022 standen fur die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
AZD	01.2023	€ 1.307	\$ 1.381	\$ 0	\$ (14)	\$ (14)	(0,01)
BOA	01.2023	1.288	1.358	0	(17)	(17)	(0,02)
CBK	01.2023	3	3	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 10.432	€ 10.055	305	0	305	0,31
MBC	01.2023	€ 2.365	\$ 2.487	0	(39)	(39)	(0,04)
	01.2023	\$ 10.566	€ 10.077	193	0	193	0,20
SCX	01.2023	10.221	9.820	264	0	264	0,27
				\$ 762	\$ (70)	\$ 692	0,71

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ 446 0,46

Summe Anlagen

\$ 97.180 100,03

Sonstige Aktiva und Passiva

\$ (27) (0,03)

Nettovermogen

\$ 97.153 100,00

ERLAUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend*):

* Auf null lautende Saldi konnen fur faktisch vorhandene Betrage stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

- (a) Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.
(b) Wertpapier mit Sachwertausschuttung.
(c) Das Wertpapier hat in den letzten zwolf Monaten keine Ertrage geliefert.
(d) Nullkuponwertpapier.
(e) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfalligkeit dar.
(f) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nachsten vertraglichen Kundigungstermin dar.
(g) Mit dem Fonds verbunden.
(h) Bedingt wandelbares Wertpapier.
(i) Eingeschrankte Wertpapiere (31. Dezember 2021: 0):

Emittentenbeschreibung	Kaufdatum	Kosten	Marktwert	% des Nettovermogens
Citigroup, Inc. 3,785 % fallig am 17.03.2033	16.08.2022	\$ 847	\$ 772	0,79
Citigroup, Inc. 6,270 % fallig am 17.11.2033	09.11.2022	900	931	0,96
Constellation Oil Services Holding S.A. 'B'	10.06.2022	63	63	0,06
Intelsat Emergence S.A.	12.11.2019	750	180	0,18
		\$ 2.560	\$ 1.946	1,99

Barmittel in Hohe von 1.243 USD (31. Dezember 2021: 1.796 USD) wurden zum 31. Dezember 2022 als Sicherheit fur borsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfandet.

Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von 0 USD (31. Dezember: 261 USD) und Barmittel in Hohe von 290 USD (31. Dezember 2021: 10 USD) wurden gema den Rahmenvertragen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. zum 31. Dezember 2022 als Sicherheiten fur Finanzderivate verpfandet.

Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO Credit Opportunities Bond Fund (Forts.)

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 8	\$ 79.539	\$ 648	\$ 80.195
Investmentfonds	9.253	396	0	9.649
Pensionsgeschäfte	0	6.910	0	6.910
Finanzderivate ⁽³⁾	33	393	0	426
Summen	\$ 9.294	\$ 87.238	\$ 648	\$ 97.180

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

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 5	\$ 122.049	\$ 1.418	\$ 123.472
Investmentfonds	13.600	0	0	13.600
Pensionsgeschäfte	0	1.827	0	1.827
Finanzderivate ⁽³⁾	12	(18)	0	(6)
Summen	\$ 13.617	\$ 123.858	\$ 1.418	\$ 138.893

(1) Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

(2) Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

(3) Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung des Marktwerts der außerbörslich gehandelten Finanzderivate und (erhaltenen)/verpfändeten Sicherheiten nach Kontrahenten zum 31. Dezember 2022 und 31. Dezember 2021:

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2022			Zum 31. Dez. 2021		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾
AZD	\$ (14)	\$ 0	\$ (14)	\$ k. A.	\$ k. A.	\$ k. A.
BOA	(104)	0	(104)	(38)	0	(38)
BPS	(290)	290	0	(86)	0	(86)
BRC	5	0	5	5	0	5
CBK	555	(550)	5	(93)	0	(93)
DUB	4	(40)	(36)	(2)	0	(2)
FBF	k. A.	k. A.	k. A.	12	0	12
GLM	(23)	0	(23)	(11)	261	250
GSC	k. A.	k. A.	k. A.	(1)	0	(1)
GST	9	0	9	17	0	17
HUS	k. A.	k. A.	k. A.	(19)	0	(19)
JPM	(63)	0	(63)	21	0	21
MBC	120	0	120	k. A.	k. A.	k. A.
MYC	(5)	0	(5)	(3)	0	(3)
MYI	4	0	4	51	10	61
RBC	3	0	3	159	0	159
SAL	k. A.	k. A.	k. A.	(1)	0	(1)
SCX	253	0	253	134	0	134
SSB	k. A.	k. A.	k. A.	5	0	5
TOR	k. A.	k. A.	k. A.	184	0	184
UAG	(8)	0	(8)	104	0	104

(1) Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2022:

	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	40,41	27,56
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	40,99	57,54
Sonstige übertragbare Wertpapiere	1,15	3,29
Investmentfonds	9,93	9,73
Pensionsgeschäfte	7,11	1,31
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,41	(0,02)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,43)	(0,30)
Freiverkehrsfinanzderivate	0,46	0,31

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2022 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
Argentinien	0,24	0,21
Australien	0,90	0,82
Österreich	k. A.	0,08
Bermuda	k. A.	0,91
Brasilien	0,41	0,94
Kanada	0,94	0,62
Cayman-Inseln	0,64	3,02
China	0,02	0,07
Frankreich	1,06	0,65
Guernsey, Kanalinseln	k. A.	0,51
Hongkong	k. A.	0,14
Italien	0,34	0,73
Japan	0,80	k. A.
Jersey, Kanalinseln	k. A.	0,39
Liberia	k. A.	0,46
Luxemburg	1,17	1,47
Mexiko	k. A.	0,15
Multinational	1,02	0,61
Niederlande	0,95	1,66
Norwegen	k. A.	0,08
Panama	k. A.	0,87
Peru	0,74	0,86
Katar	0,40	0,32
Singapur	k. A.	0,08
Südafrika	1,71	k. A.
Spanien	0,37	0,29
Schweiz	1,08	k. A.
Großbritannien	3,36	3,47
USA	65,91	48,78
Jungferinseln (Britisch)	0,23	0,37
Kurzfristige Instrumente	0,26	19,83
Investmentfonds	9,93	9,73
Pensionsgeschäfte	7,11	1,31
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,41	(0,02)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen — Schutzkauf	0,08	0,01
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen — Schutzverkauf	0,04	0,04
Credit Default Swaps auf Kreditindizes — Schutzkauf	k. A.	(0,03)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes — Schutzverkauf	k. A.	0,02
Zinsswaps	(0,55)	(0,34)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Credit Default Swaptions auf Kreditindizes	k. A.	0,01
Zinsswapoptionen	0,63	0,13
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaptions auf Kreditindizes	0,00	(0,02)
Zinsswapoptionen	(1,06)	(0,20)
Optionen auf Wertpapiere	(0,01)	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen — Schutzkauf	(0,01)	(0,02)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen — Schutzverkauf	0,00	0,01
Credit Default Swaps auf Kreditindizes — Schutzverkauf	0,03	0,04
Total Return Swaps auf Indizes	(0,16)	k. A.
Devisenterminkontrakte	(0,04)	(0,14)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	1,08	0,50
Sonstige Aktiva und Passiva	(0,03)	0,58
Nettovermögen	100,00	100,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Diversified Income Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
SEGROVIA EUROPEAN CLO DAC 2,336 % fällig am 20.07.2032	€ 10.100	\$ 10.437	0,12	JAPAN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Sberbank of Russia Via SB Capital S.A. 5,125 % fällig am 29.10.2022 ^	\$ 3.900	\$ 456	0,01
Tikehau CLO DAC 2,596 % fällig am 04.08.2034	9.400	9.740	0,11	Nissan Motor Co. Ltd. 3,201 % fällig am 17.09.2028	€ 7.100	\$ 6.661	0,08	Summer BC Holdco SARL 5,750 % fällig am 31.10.2026	€ 17.700	16.175	0,18
Toro European CLO DAC 2,239 % fällig am 12.01.2032	2.500	2.570	0,03	4,345 % fällig am 17.09.2027	\$ 76.600	69.577	0,79				
2,298 % fällig am 15.07.2030	422	442	0,01	4,810 % fällig am 17.09.2030	5.100	4.339	0,05				
2,572 % fällig am 15.02.2034	7.650	7.875	0,09	Summe Japan		80.577	0,92				
		442.256	5,05	JERSEY, KANALINSELN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG			
				AA Bond Co. Ltd. 4,875 % fällig am 31.07.2043	£ 6.943	7.916	0,09	Albion Financing SARL 6,752 % fällig am 17.08.2026	6.946	7.273	0,08
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				5,500 % fällig am 31.07.2050	21.190	22.112	0,25	Connect Finco SARL 7,890 % fällig am 11.12.2026	\$ 3.180	3.149	0,04
ABH Financial Ltd. Via Alfa Holding Issuance PLC 2,700 % fällig am 11.06.2023	26.550	1.983	0,02	7,375 % fällig am 31.07.2050	7.300	7.594	0,09	Delos Finance SARL 6,480 % fällig am 06.10.2023	420	420	0,00
AerCap Ireland Capital DAC 3,150 % fällig am 15.02.2024	\$ 12.900	12.476	0,14	Adient Global Holdings Ltd. 3,500 % fällig am 15.08.2024	€ 4.600	4.724	0,05	Intelsat Jackson Holdings S.A. 7,445 % fällig am 01.02.2029	3.567	3.451	0,04
3,500 % fällig am 15.01.2025	200	191	0,00	Corsair International Ltd. 5,473 % fällig am 28.01.2027	18.800	19.914	0,23				
3,650 % fällig am 21.07.2027	400	362	0,00	5,823 % fällig am 28.01.2029	8.200	8.664	0,10	AKTIEN			
4,450 % fällig am 01.10.2025	400	385	0,01	G City Europe Ltd. 4,250 % fällig am 11.09.2025	19.820	17.767	0,20	RECHTE			
4,450 % fällig am 03.04.2026	5.350	5.113	0,06	Kennedy Wilson Europe Real Estate Ltd. 3,250 % fällig am 12.11.2025	900	755	0,01	Intelsat Jackson Holdings S.A. – Exp. 5. Dezember 2025	38.562	275	0,00
4,625 % fällig am 15.10.2027	34.750	32.331	0,37	Summe Jersey, Kanalinseln		89.446	1,02	Summe Luxemburg		342.741	3,92
Bank of Ireland Group PLC 6,253 % fällig am 16.09.2026	10.600	10.522	0,12								
SMBC Aviation Capital Finance DAC 2,300 % fällig am 15.06.2028	900	740	0,01	AKTIEN							
		64.103	0,73	LUXEMBURG STAMMAKTIONEN				MAZEDONIEN STAATSEMISSIONEN			
				Intelsat Emergence S.A. (b)(h)	184.122	4.419	0,05	North Macedonia Government International Bond 2,750 % fällig am 18.01.2025	€ 1.600	1.599	0,02
								3,675 % fällig am 03.06.2026	5.200	5.147	0,06
				WANDELANLEIHEN & WECHSEL				Summe Mazedonien		6.746	0,08
				Corestate Capital Holding S.A. 1,375 % fällig am 28.11.2049 ^	€ 14.700	2.922	0,04	MAURITIUS UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
								Greenko Solar Mauritius Ltd. 5,550 % fällig am 29.01.2025	\$ 7.700	7.267	0,08
				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL							
				Albion Financing SARL 5,250 % fällig am 15.10.2026	15.600	14.608	0,17	AKTIEN			
				6,125 % fällig am 15.10.2026	\$ 5.500	4.913	0,06	MEXIKO STAMMAKTIONEN			
				Altice Financing S.A. 3,000 % fällig am 15.01.2028	€ 7.900	6.684	0,08	Hipotecaria Su Casita S.A. (b)	28.925	0	0,00
				5,750 % fällig am 15.08.2029	\$ 64.700	51.012	0,58	Urbi Desarrollos Urbanos S.A.B. de C.V. (b)	477	0	0,00
				Altice France Holding S.A. 6,000 % fällig am 15.02.2028	23.300	13.804	0,16	Summe Stammaktien		0	0,00
				Aroundtown S.A. 5,375 % fällig am 21.03.2029	17.900	13.569	0,15				
				Constellation Oil Services Holding S.A. (3,000 % bar oder 4,000 % PIK) 3,000 % fällig am 31.12.2026 (a)	752	445	0,01				
				Corestate Capital Holding S.A. 3,500 % fällig am 15.04.2023 ^	€ 33.100	5.530	0,06	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
				CPI Property Group S.A. 1,500 % fällig am 27.01.2031	8.900	5.513	0,06	Petroleos Mexicanos 5,625 % fällig am 23.01.2046	\$ 11.142	6.506	0,07
				1,625 % fällig am 23.04.2027	9.000	6.862	0,08	6,350 % fällig am 12.02.2048	3.800	2.332	0,03
				1,750 % fällig am 14.01.2030	10.300	6.707	0,08	6,500 % fällig am 02.06.2041	5.600	3.658	0,04
				2,750 % fällig am 12.05.2026	20.750	17.441	0,20	6,625 % fällig am 15.06.2035	76.800	55.894	0,64
				2,750 % fällig am 22.01.2028	£ 3.200	2.578	0,03	6,625 % fällig am 15.06.2038	3.900	2.690	0,03
				Cromwell Ereit Lux Finco SARL 2,125 % fällig am 19.11.2025	€ 600	518	0,01	6,700 % fällig am 16.02.2032	79.587	62.651	0,72
				FEL Energy SARL 5,750 % fällig am 01.12.2040	\$ 45.828	39.284	0,45	6,750 % fällig am 21.09.2047	20.900	13.382	0,15
				Gazprom PJSC Via Gaz Capital S.A. 4,250 % fällig am 06.04.2024	£ 15.900	13.394	0,15	7,690 % fällig am 23.01.2050	13.400	9.302	0,11
				Intelsat Jackson Holdings S.A. 6,500 % fällig am 15.03.2030	\$ 13.710	12.291	0,14				
				Lincoln Financing SARL 3,625 % fällig am 01.04.2024	€ 66.575	70.359	0,80	Summe Mexiko		156.415	1,79
				6,007 % fällig am 01.04.2024	1.475	1.568	0,02			156.415	1,79
				Logicor Financing SARL 0,750 % fällig am 15.07.2024	1.100	1.079	0,01	MULTINATIONAL UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
				3,250 % fällig am 13.11.2028	13.900	12.516	0,14	Allied Universal Holdco LLC 3,625 % fällig am 01.06.2028	€ 18.800	15.992	0,19
				Petrorio Luxembourg Trading SARL 6,125 % fällig am 09.06.2026	\$ 3.700	3.526	0,04	Connect Finco SARL 6,750 % fällig am 01.10.2026	\$ 13.400	12.446	0,14
								Summe multinational		28.438	0,33
								NIEDERLANDE UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
								ASR Nederland NV 7,000 % fällig am 07.12.2043	€ 1.400	1.500	0,02
								Athora Netherlands NV 7,000 % fällig am 19.06.2025 (e)(g)	4.300	4.492	0,05

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Citycon Treasury BV				Galp Energia SGPS S.A.				Banco Santander S.A.			
1,625 % fällig am 12.03.2028	€ 3.400	\$ 2.656	0,03	2,000 % fällig am 15.01.2026	€ 12.300	\$ 12.090	0,14	3,490 % fällig am 28.05.2030	\$ 1.400	\$ 1.181	0,01
CTP NV				Summe Portugal		12.121	0,14	Cellnex Finance Co. S.A.			
0,500 % fällig am 21.06.2025	1.200	1.075	0,01					2,000 % fällig am 15.09.2032	€ 23.800	18.933	0,22
1,250 % fällig am 21.06.2029	200	142	0,00	KATAR				Lorca Telecom Bondco S.A.			
1,500 % fällig am 27.09.2031	1.500	962	0,01	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				4,000 % fällig am 18.09.2027	1.900	1.823	0,02
Imperial Brands Finance Netherlands BV				Nakilat, Inc.						83.691	0,96
1,750 % fällig am 18.03.2033	28.800	21.726	0,25	6,067 % fällig am 31.12.2033	\$ 10.259	10.600	0,12				
ING Groep NV				RUMANIEN				KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG			
5,750 % fällig am 16.11.2026 (e)(g)	\$ 9.000	7.994	0,09	STAATSEMISSIONEN				Grifols S.A.			
6,500 % fällig am 16.04.2025 (e)(g)	18.702	17.726	0,20	Romania Government International Bond				3,708 % fällig am 15.11.2027	1.296	1.340	0,01
6,750 % fällig am 16.04.2024 (e)(g)	14.280	13.770	0,16	2,000 % fällig am 14.04.2033	€ 1.500	1.030	0,01	Summe Spanien		85.031	0,97
NE Property BV				2,875 % fällig am 13.04.2042	8.000	4.802	0,06				
3,375 % fällig am 14.07.2027	€ 25.250	23.385	0,27	Summe Rumänien		5.832	0,07	SRI LANKA			
NN Group NV								STAATSEMISSIONEN			
4,500 % fällig am 15.01.2026 (e)	17.900	18.631	0,21	RUSSLAND				Sri Lanka Government International Bond			
Q-Park Holding BV				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				7,550 % fällig am 28.03.2030 ^	\$ 16.800	5.361	0,06
2,000 % fällig am 01.03.2027	400	358	0,00	ALROSA Finance S.A.				7,850 % fällig am 14.03.2029 ^	5.800	1.857	0,02
3,500 % fällig am 01.02.2025	33.350	32.293	0,37	3,100 % fällig am 25.06.2027 ^	\$ 22.400	3.374	0,04	Summe Sri Lanka		7.218	0,08
Syngenta Finance NV				4,650 % fällig am 09.04.2024 ^	3.200	444	0,01				
3,375 % fällig am 16.04.2026	20.000	20.180	0,23	MMK International Capital DAC				SCHWEDEN			
4,892 % fällig am 24.04.2025	\$ 32.895	31.888	0,37	4,375 % fällig am 13.06.2024 ^	8.600	3.010	0,03	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV						6.828	0,08	Castellum AB			
4,375 % fällig am 09.05.2030	€ 11.500	10.182	0,12	STAATSEMISSIONEN				0,750 % fällig am 04.09.2026	€ 200	166	0,00
4,500 % fällig am 01.03.2025	10.600	10.880	0,13	Russia Government International Bond				Sagax AB			
United Group BV				2,875 % fällig am 04.12.2025 ^	€ 7.700	2.383	0,03	2,000 % fällig am 17.01.2024	500	512	0,01
3,625 % fällig am 15.02.2028	1.600	1.242	0,01	4,250 % fällig am 23.06.2027 ^	\$ 13.800	4.830	0,05	2,250 % fällig am 13.03.2025	400	394	0,00
4,875 % fällig am 01.07.2024	230	229	0,00	4,750 % fällig am 27.05.2026 ^	200	70	0,00	Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB			
5,250 % fällig am 01.02.2030	8.600	6.647	0,08	5,250 % fällig am 23.06.2047 ^	31.200	11.544	0,13	1,750 % fällig am 14.01.2025	1.600	1.466	0,02
Volkswagen International Finance NV				Summe Russland		18.827	0,21	Volvo Car AB			
3,500 % fällig am 17.06.2025 (e)	10.100	10.002	0,11			25.655	0,29	4,250 % fällig am 31.05.2028	29.900	29.411	0,34
		237.960	2,72					Summe Schweden		31.949	0,37
				SERBIEN				SCHWEIZ			
KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG				STAATSEMISSIONEN				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Sigma Bidco BV				Serbia Government International Bond				Credit Suisse AG			
3,738 % fällig am 02.07.2025	9.500	8.833	0,10	1,650 % fällig am 03.03.2033	€ 8.900	5.794	0,07	6,500 % fällig am 08.08.2023 (g)	\$ 57.800	56.107	0,64
WP/AP Telecom Holdings BV				SINGAPUR				Credit Suisse Group AG			
6,202 % fällig am 30.03.2029	66.400	68.311	0,78	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				3,869 % fällig am 12.01.2029	300	241	0,00
Ziggo BV				Flex Ltd.				4,194 % fällig am 01.04.2031	1.400	1.090	0,01
3,764 % fällig am 31.01.2029	19.560	19.331	0,22	3,750 % fällig am 01.02.2026	\$ 14.000	13.236	0,15	6,375 % fällig am 21.08.2026 (e)(g)	4.200	3.021	0,04
		96.475	1,10	SLOWENIEN				6,442 % fällig am 11.08.2028	3.200	2.919	0,03
				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				6,537 % fällig am 12.08.2033	500	440	0,01
NON-AGENCY-MBS				Nova Kreditna Banka Maribor d.d.				7,250 % fällig am 12.09.2025 (e)(g)	400	288	0,00
EMF-NL Prime BV				1,875 % fällig am 27.01.2025	€ 8.300	8.036	0,09	7,500 % fällig am 17.07.2023 (e)(g)	5.800	4.649	0,05
2,178 % fällig am 17.04.2041	25	26	0,00	Nova Ljubljanska Banka d.d.				UBS AG			
Eurosail BV				3,400 % fällig am 05.02.2030	7.100	6.288	0,07	5,125 % fällig am 15.05.2024 (g)	22.800	22.552	0,26
2,878 % fällig am 17.10.2040	151	160	0,00	Summe Slowenien		14.324	0,16	UBS Group AG			
		186	0,00					4,125 % fällig am 15.04.2026	15.100	14.502	0,17
Summe Niederlande		334.621	3,82					4,703 % fällig am 05.08.2027	1.200	1.161	0,01
				SÜDAFRIKA				Summe Schweiz		106.970	1,22
NIGERIA				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				TÜRKEI			
STAATSEMISSIONEN				AngloGold Ashanti Holdings PLC				STAATSEMISSIONEN			
Nigeria Government International Bond				3,750 % fällig am 01.10.2030	\$ 2.000	1.736	0,02	Turkey Government International Bond			
7,143 % fällig am 23.02.2030	\$ 8.200	6.309	0,07	Growthpoint Properties International Pty. Ltd.				4,875 % fällig am 16.04.2043	33.067	21.612	0,25
7,625 % fällig am 28.11.2047	17.700	11.463	0,13	5,872 % fällig am 02.05.2023	2.000	1.993	0,02	5,750 % fällig am 11.05.2047	58.300	39.936	0,45
7,875 % fällig am 16.02.2032	23.600	17.866	0,21	Sasol Financing USA LLC				Summe Türkei		61.548	0,70
Summe Nigeria		35.638	0,41	5,875 % fällig am 27.03.2024	4.100	4.021	0,05				
				Summe Südafrika		7.750	0,09	UKRAINE			
OMAN				SPANIEN				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
STAATSEMISSIONEN				ACS Actividades de Construcción y Servicios S.A.				NPC Ukrenergó			
Oman Government International Bond				1,375 % fällig am 17.06.2025 (i)	€ 8.200	8.080	0,09	6,875 % fällig am 09.11.2028 ^	1.000	178	0,00
6,750 % fällig am 17.01.2048	29.300	27.543	0,31	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.				State Agency of Roads of Ukraine			
				5,875 % fällig am 24.09.2023 (e)(g)	2.000	2.057	0,03	6,250 % fällig am 24.06.2030 ^	200	36	0,00
PANAMA				6,000 % fällig am 29.03.2024 (e)(g)	2.800	2.915	0,03			214	0,00
STAATSEMISSIONEN				6,000 % fällig am 15.01.2026 (e)(g)	9.200	9.383	0,11				
Panama Government International Bond				6,138 % fällig am 14.09.2028	\$ 15.800	15.846	0,18	STAATSEMISSIONEN			
6,700 % fällig am 26.01.2036	20.600	21.544	0,25	Banco de Sabadell S.A.				State Agency of Roads of Ukraine			
				5,375 % fällig am 08.09.2026	€ 22.100	23.473	0,27	6,250 % fällig am 16.04.2030	1.200	213	0,00
PORTUGAL								Ukraine Government International Bond			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL								4,375 % fällig am 27.01.2032	€ 67.619	13.441	0,15
Banco Espirito Santo S.A.								6,750 % fällig am 20.06.2028 ^	6.300	1.248	0,02
4,750 % fällig am 15.01.2018 ^	€ 200	31	0,00								

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Diversified Income Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000\$)	MARKT-WERT (000\$)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000\$)	MARKT-WERT (000\$)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000\$)	MARKT-WERT (000\$)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
3,064 % fällig am 25.07.2037	\$ 49	\$ 31	0,00	4,589 % fällig am 25.05.2037	\$ 338	\$ 289	0,01	3,738 % fällig am 25.09.2036 ^	\$ 117	\$ 106	0,00
3,088 % fällig am 25.05.2037 ^	145	122	0,00	4,649 % fällig am 25.02.2037	10	23	0,00	3,836 % fällig am 25.12.2035	68	62	0,00
3,129 % fällig am 25.06.2036	117	92	0,00	4,669 % fällig am 25.01.2037	121	123	0,00	4,969 % fällig am 25.10.2045	28	26	0,00
3,229 % fällig am 25.08.2035	640	513	0,01	4,689 % fällig am 25.02.2037	229	199	0,00	5,029 % fällig am 25.01.2045	307	285	0,01
3,249 % fällig am 25.11.2035 ^	26	19	0,00	4,739 % fällig am 25.08.2036 ^	441	357	0,01	5,129 % fällig am 25.11.2034	288	260	0,00
3,453 % fällig am 25.11.2035 ^	477	393	0,01	4,769 % fällig am 25.08.2036 ^	124	119	0,00	5,229 % fällig am 25.06.2044	262	236	0,00
3,644 % fällig am 25.12.2036 ^	63	54	0,00	4,769 % fällig am 25.09.2036 ^	449	410	0,01	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust			
3,645 % fällig am 25.06.2035 ^	168	144	0,00	4,789 % fällig am 25.11.2036 ^	149	110	0,00	4,466 % fällig am 25.05.2035 ^	223	190	0,00
3,833 % fällig am 25.10.2034	233	221	0,00	4,819 % fällig am 25.05.2046	617	516	0,01	4,709 % fällig am 25.02.2037 ^	579	476	0,01
4,749 % fällig am 25.07.2047	179	124	0,00	5,500 % fällig am 25.03.2037 ^	74	57	0,00	5,500 % fällig am 25.07.2035 ^	446	396	0,01
4,789 % fällig am 25.06.2046	579	450	0,01	6,000 % fällig am 25.09.2035 ^	77	28	0,00	5,500 % fällig am 25.11.2035 ^	122	109	0,00
4,809 % fällig am 25.07.2036	5.622	4.943	0,06	6,000 % fällig am 25.06.2036 ^	377	305	0,01	6,000 % fällig am 25.06.2037 ^	485	471	0,01
4,869 % fällig am 25.07.2035	6	5	0,00	6,000 % fällig am 25.08.2036 ^	847	664	0,01	Wells Fargo Alternative Loan Trust			
4,989 % fällig am 25.07.2035	139	113	0,00	6,250 % fällig am 25.03.2037 ^	169	128	0,00	5,750 % fällig am 25.07.2037 ^	56	45	0,00
JPMorgan Alternative Loan Trust				6,500 % fällig am 25.07.2037 ^	240	192	0,00	Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust			
3,133 % fällig am 25.05.2036 ^	170	97	0,00	6,500 % fällig am 25.09.2037 ^	231	183	0,00	2,755 % fällig am 25.04.2036 ^	161	149	0,00
3,854 % fällig am 25.05.2037 ^	197	164	0,00	Residential Asset Securitization Trust				2,954 % fällig am 25.04.2036 ^	8	7	0,00
4,709 % fällig am 25.10.2036	918	806	0,01	5,500 % fällig am 25.09.2035 ^	84	43	0,00	4,414 % fällig am 25.11.2037 ^	74	63	0,00
5,843 % fällig am 26.05.2037	1.671	1.298	0,02	5,500 % fällig am 25.12.2035 ^	203	103	0,00	4,564 % fällig am 25.12.2036 ^	60	57	0,00
JPMorgan Mortgage Trust				6,500 % fällig am 25.04.2037 ^	1.209	327	0,01	6,000 % fällig am 25.06.2037 ^	2.069	1.737	0,02
3,169 % fällig am 25.06.2037 ^	211	159	0,00	Residential Funding Mortgage Securities, Inc. Trust							
3,407 % fällig am 25.08.2035	36	34	0,00	6,000 % fällig am 25.10.2036 ^	109	87	0,00				
3,570 % fällig am 25.07.2035	12	12	0,00	6,000 % fällig am 25.06.2037 ^	72	53	0,00				
3,614 % fällig am 25.10.2036 ^	287	217	0,00	Sequoia Mortgage Trust							
3,615 % fällig am 25.10.2035 ^	141	114	0,00	2,976 % fällig am 20.01.2047 ^	4	3	0,00				
3,879 % fällig am 25.11.2035 ^	106	92	0,00	Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust							
4,157 % fällig am 25.04.2035	2	2	0,00	3,530 % fällig am 25.11.2035 ^	23	21	0,00	US-REGIERUNGSBEHÖRDEN			
6,000 % fällig am 25.01.2036 ^	96	49	0,00	3,637 % fällig am 25.09.2035	21	16	0,00	Uniform Mortgage-Backed Security			
6,500 % fällig am 25.07.2036 ^	242	109	0,00	3,658 % fällig am 25.10.2036 ^	80	47	0,00	5,500 % fällig am 01.12.2052	16.307	16.366	0,19
Lehman XS Trust				3,838 % fällig am 25.09.2035	77	68	0,00	Uniform Mortgage-Backed Security, TBA			
4,749 % fällig am 25.12.2036	2.172	2.039	0,03	3,854 % fällig am 25.04.2035	10	9	0,00	5,000 % fällig am 01.01.2053	154.300	152.052	1,74
4,849 % fällig am 25.04.2046 ^	7	8	0,00	4,022 % fällig am 25.11.2036 ^	355	298	0,01	5,500 % fällig am 01.02.2053	147.900	148.236	1,69
4,869 % fällig am 25.09.2046 ^	11	12	0,00	4,115 % fällig am 25.02.2035	164	153	0,00				
4,909 % fällig am 25.02.2046 ^	196	170	0,00	4,709 % fällig am 25.10.2035	68	62	0,00				
4,944 % fällig am 25.08.2047 ^	434	373	0,01	4,829 % fällig am 25.06.2037	123	104	0,00				
5,744 % fällig am 25.10.2037	1.992	1.739	0,02	6,709 % fällig am 25.10.2037 ^	71	63	0,00				
Luminent Mortgage Trust				Structured Asset Mortgage Investments Trust							
4,789 % fällig am 25.10.2046	908	786	0,01	4,569 % fällig am 25.09.2047	38	34	0,00	US-SCHATZOBIGATIONEN			
MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust				4,579 % fällig am 25.09.2047	414	362	0,01	U.S. Treasury Bonds			
3,874 % fällig am 21.11.2034	51	46	0,00	4,749 % fällig am 25.07.2046	138	113	0,00	4,000 % fällig am 15.11.2042	98.500	96.468	1,10
4,644 % fällig am 25.05.2047 ^	5	5	0,00	4,769 % fällig am 25.06.2036	49	47	0,00	Summe USA		1.982.944	22,65
Merrill Lynch Alternative Note Asset Trust				4,809 % fällig am 25.04.2036	37	32	0,00				
4,609 % fällig am 25.03.2037	227	65	0,00	4,809 % fällig am 25.05.2036	30	23	0,00				
Merrill Lynch Mortgage Investors Trust				4,989 % fällig am 25.08.2036 ^	394	247	0,00				
2,736 % fällig am 25.03.2036 ^	336	185	0,00	4,999 % fällig am 19.10.2034	25	23	0,00				
2,847 % fällig am 25.02.2036	20	19	0,00	5,039 % fällig am 19.03.2034	4	3	0,00				
3,455 % fällig am 25.05.2036	161	143	0,00	Structured Asset Securities Corp. Mortgage Pass-Through Certificates							
4,138 % fällig am 25.11.2035	92	88	0,00	5,041 % fällig am 25.06.2033	5	5	0,00				
4,676 % fällig am 25.11.2029	3	3	0,00	SunTrust Alternative Loan Trust							
4,849 % fällig am 25.04.2029	14	13	0,00	5,039 % fällig am 25.12.2035 ^	153	130	0,00				
Merrill Lynch Mortgage-Backed Securities Trust				5,750 % fällig am 25.12.2035 ^	176	149	0,00				
2,861 % fällig am 25.04.2037 ^	21	19	0,00	Thornburg Mortgage Securities Trust							
Morgan Stanley Mortgage Loan Trust				2,994 % fällig am 25.09.2037	18	17	0,00				
3,684 % fällig am 25.05.2036 ^	394	232	0,00	Towd Point Mortgage Trust							
3,711 % fällig am 25.09.2035 ^	149	55	0,00	2,750 % fällig am 25.06.2057	649	619	0,01				
3,736 % fällig am 25.06.2036	29	28	0,00	Wachovia Mortgage Loan Trust LLC							
4,386 % fällig am 25.06.2036	3	3	0,00	4,160 % fällig am 20.10.2035 ^	38	36	0,00				
4,649 % fällig am 25.03.2036	54	35	0,00	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust							
4,709 % fällig am 25.01.2035	18	16	0,00	2,499 % fällig am 25.12.2046	50	44	0,00				
6,000 % fällig am 25.10.2037 ^	1.123	661	0,01	2,710 % fällig am 25.01.2037 ^	14	12	0,00				
Morgan Stanley Re-REMIC Trust				2,737 % fällig am 25.05.2046	66	55	0,00				
2,666 % fällig am 26.03.2037	79	74	0,00	2,766 % fällig am 25.04.2037 ^	9	8	0,00				
2,702 % fällig am 26.02.2037	107	96	0,00	2,835 % fällig am 27.02.2034	129	120	0,00				
New Residential Mortgage Loan Trust				2,858 % fällig am 25.07.2047	457	366	0,01				
3,500 % fällig am 25.12.2057	1.708	1.618	0,02	2,987 % fällig am 25.04.2035	12	11	0,00				
Nomura Asset Acceptance Corp. Alternative Loan Trust				3,048 % fällig am 25.08.2046	282	258	0,00				
4,038 % fällig am 25.08.2035	30	30	0,00	3,122 % fällig am 25.03.2036	117	105	0,00				
Opteum Mortgage Acceptance Corp. Asset-Backed Pass-Through Certificates				3,206 % fällig am 25.06.2033	31	29	0,00				
4,949 % fällig am 25.12.2035	305	279	0,00	3,211 % fällig am 25.02.2037 ^	30	27	0,00				
6,414 % fällig am 25.02.2035	409	416	0,01	3,248 % fällig am 25.11.2042	4	4	0,00				
Prime Mortgage Trust				3,347 % fällig am 25.05.2037 ^	15	12	0,00				
6,000 % fällig am 25.06.2036 ^	10	9	0,00	3,367 % fällig am 25.07.2037 ^	484	405	0,01				
RBSGC Structured Trust				3,372 % fällig am 25.12.2036 ^	23	21	0,00				
5,500 % fällig am 25.11.2035 ^	77	65	0,00	3,448 % fällig am 25.04.2044	2	1	0,00				
Residential Accredit Loans, Inc. Trust				3,452 % fällig am 25.02.2033	9	8	0,00				
3,430 % fällig am 25.02.2035 ^	54	44	0,00	3,510 % fällig am 25.12.2036 ^	9	7	0,00				
3,999 % fällig am 25.08.2035	1.047	955	0,01	3,548 % fällig am 25.10.2046	18	16	0,00				
4,539 % fällig am 25.02.2047	728	268	0,00	3,672 % fällig am 25.10.2036 ^	269	232	0,00				
				3,683 % fällig am 25.08.2036 ^	48	44	0,00				

BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
INVESTMENTFONDS ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN							
PIMCO Funds: Global Investors Series plc – Asia Strategic Interest Bond Fund (f)	3.488.745	30.701	0,35	PIMCO Funds: Global Investors Series plc – PIMCO European High Yield Bond Fund (f)	3.637.652	\$ 38.357	0,44
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO Asia High Yield Bond Fund (f)	7.821.400	71.409	0,82	PIMCO Funds: Global Investors Series plc - US Short-Term Fund (f)	32.636.754	325.715	3,73
				PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (f)	14.376.805	143.107	1,63
						609.289	6,97
BÖRSENGEHADELTE FONDS							
				PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (f)	2.698.640	267.341	3,05
				Summe Investmentfonds*	\$ 876.630	10,02	

* Das Engagement des Diversified Income Fund in den Investmentfonds lag aufgrund von Marktwertschwankungen am 27. Dezember 2022 leicht über 10 %. Am 4. Januar 2023 bewegte sich Fonds wieder im zulässigen Rahmen.

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kapital- betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions- geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions- geschäft ⁽¹⁾	% des Nettovermögens
BOS	4,290 %	29.12.2022	05.01.2023	\$500.000	U.S. Treasury Bonds 3,375 % - 3,750 % fällig am 15.11.2043 - 15.11.2048	\$ (513.516)	\$ 500.000	\$ 500.417	5,71
BRC	4,290	30.12.2022	03.01.2023	568.200	Freddie Mac 4,000 % fällig am 01.07.2052	(139.541)	568.200	568.471	6,49
CIB	4,250	03.01.2023	04.01.2023	580.100	Ginnie Mae 2,500 % – 4,500 % fällig am 20.01.2052 – 20.12.2052	(450.224)			
FICC	1,900	30.12.2022	03.01.2023	41.323	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2025 – 15.07.2031	(592.195)	580.100	580.168	6,63
MBC	4,320	30.12.2022	03.01.2023	56.700	U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 29.06.2023	(42.150)	41.323	41.327	0,47
					U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 05.01.2023	(58.078)	56.700	56.727	0,65
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (1.795.704)	\$1.746.323	\$ 1.747.110	19,95

⁽¹⁾ Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Australia Government 10-Year Bond March Futures	Long	03.2023	156	\$ (699)	(0,01)
Euro-Bund 10-Year Bond March Futures	Long	03.2023	1.200	(4.733)	(0,05)
Euro-Schatz March Futures	Short	03.2023	8.388	5.501	0,06
U.S. Treasury 2-Year Note March Futures	Long	03.2023	3.590	398	0,01
U.S. Treasury 5-Year Note March Futures	Long	03.2023	7.735	(7.173)	(0,08)
U.S. Treasury 10-Year Note March Futures	Long	03.2023	9.644	(9.239)	(0,11)
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond March Futures	Long	03.2023	6.474	(12.135)	(0,14)
				\$ (28.080)	(0,32)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ (28.080)	(0,32)

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AT&T, Inc.	1,000 %	20.06.2024	\$ 18.200	\$ 23	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2026	17.200	(295)	0,00
Auchan Holding S.A.	1,000	20.12.2027	€ 2.400	(85)	0,00
Boeing Co.	1,000	20.12.2023	\$ 1.300	(9)	0,00
Boeing Co.	1,000	20.12.2026	500	(3)	0,00
Boeing Co.	1,000	20.06.2027	1.200	48	0,00
Ford Motor Co.	5,000	20.12.2023	3.700	(616)	(0,01)

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Diversified Income Fund (Forts.)

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000 %	20.12.2024	\$ 600	\$ 4	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20.06.2025	1.300	18	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20.06.2026	800	15	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20.06.2027	6.900	(56)	0,00
General Electric Co.	1,000	20.06.2024	14.300	398	0,00
General Electric Co.	1,000	20.06.2026	35.000	(37)	0,00
General Electric Co.	1,000	20.12.2026	4.300	(28)	0,00
General Motors Co.	5,000	20.06.2026	4.200	(370)	0,00
Glencore Finance Europe Ltd.	5,000	20.12.2025	€ 35.900	(3.993)	(0,05)
Glencore Finance Europe Ltd.	5,000	20.12.2027	26.000	(3.368)	(0,04)
Marks & Spencer PLC	1,000	20.12.2024	18.600	487	0,01
Marks & Spencer PLC	1,000	20.06.2027	2.862	(46)	0,00
Marks & Spencer PLC	1,000	20.12.2028	14.000	(1.098)	(0,01)
Rolls-Royce PLC	1,000	20.12.2024	40.600	(865)	(0,01)
Volkswagen International Finance NV	1,000	20.12.2026	19.300	(576)	(0,01)
Volkswagen International Finance NV	1,000	20.06.2027	8.300	132	0,00
				\$ (10.320)	(0,12)

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.EM-34 5-Year Index	1,000 %	20.12.2025	\$ 167.463	\$ (734)	(0,01)
CDX.EM-35 5-Year Index	1,000	20.06.2026	3.726	18	0,00
CDX.EM-36 5-Year Index	1,000	20.12.2026	492.490	692	0,01
CDX.EM-37 5-Year Index	1,000	20.06.2027	4.606	149	0,00
CDX.EM-38 5-Year Index	1,000	20.12.2027	183.200	4.563	0,05
CDX.HY-39 5-Year Index	5,000	20.12.2027	260.600	4.534	0,05
CDX.IG-38 5-Year Index	1,000	20.06.2027	201.100	1.442	0,02
CDX.IG-39 5-Year Index	1,000	20.12.2027	656.100	4.709	0,06
				\$ 15.373	0,18

ZINSSWAPS

Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	0,500 %	16.09.2025	£ 21.100	\$ 2.627	0,03
Erhalt ⁽³⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	2,000	15.03.2033	5.500	(130)	0,00
Zahlung ⁽³⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	2,000	15.03.2053	13.200	(343)	0,00
Erhalt ⁽³⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	2,250	15.03.2028	47.400	1.676	0,02
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,400	15.06.2032	¥ 12.250.000	2.684	0,03
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	0,880	03.03.2024	CAD 273.400	(11.225)	(0,13)
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	2,500	19.06.2029	91.700	(8.005)	(0,09)
Erhalt ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	1,500	15.03.2053	€ 5.000	413	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,520	07.07.2027	127.500	(6.096)	(0,07)
					\$ (18.399)	(0,21)
					\$ (13.346)	(0,15)

Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate

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

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

⁽³⁾ Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

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

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

VERKAUFSOPTIONEN

CREDIT DEFAULT SWAPPTIONS AUF KREDITINDIZES

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/-verkauf	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
GST	Put - OTC iTraxx Europe 37 5-Year Index	Verkauf	3,000 %	15.03.2023	25.100	\$ (45)	\$ (5)	0,00

⁽¹⁾ Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festsinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽²⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BRC	Indonesia Government International Bond	1,000 %	20.06.2031	\$ 61.600	\$ (2.646)	\$ 554	\$ (2.092)	(0,03)
	Intrum AB	5,000	20.12.2024	€ 1.200	113	(141)	(28)	0,00
FBF	Intrum AB	5,000	20.12.2024	4.400	415	(519)	(104)	0,00
GST	ADLER Real Estate AG	5,000	20.12.2026	7.400	(46)	(1.849)	(1.895)	(0,02)
	Intrum AB	5,000	20.12.2024	41.200	4.387	(5.365)	(978)	(0,01)
JPM	Hochtief AG	5,000	20.12.2026	34.200	8.143	(4.179)	3.964	0,04
	Intrum AB	5,000	20.12.2024	1.000	92	(116)	(24)	0,00
MYC	Intrum AB	5,000	20.12.2024	6.400	650	(802)	(152)	0,00
MYI	Intrum AB	5,000	20.12.2024	8.200	893	(1.088)	(195)	0,00
					\$ 12.001	\$ (13.505)	\$ (1.504)	(0,02)

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

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

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	01.2023	AUD 10	\$ 7	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
BPS	01.2023	HUF 542.086	\$ 1.412	0	(32)	(32)	0,00
	01.2023	\$ 1.050	£ 871	0	(2)	(2)	0,00
	02.2023	IDR 2.847.249	\$ 181	0	(3)	(3)	0,00
	03.2023	INR 52.179	629	2	0	2	0,00
	03.2023	MXN 75.325	3.738	1	(75)	(74)	0,00
BRC	01.2023	€ 14.315	14.881	0	(403)	(403)	(0,01)
	01.2023	HUF 2.849.767	7.432	0	(163)	(163)	0,00
	01.2023	SGD 590	439	0	(1)	(1)	0,00
	01.2023	\$ 36	SGD 48	0	0	0	0,00
CBK	01.2023	CAD 1.215	\$ 898	1	0	1	0,00
	01.2023	€ 1.142.395	1.184.436	0	(35.305)	(35.305)	(0,39)
	01.2023	SEK 2.200	211	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 189	BRL 993	0	(1)	(1)	0,00
	01.2023	53.765	€ 50.396	43	0	43	0,00
	03.2023	7.410	MXN 145.374	0	(53)	(53)	0,00
GLM	05.2023	MXN 146	\$ 7	0	0	0	0,00
	01.2023	BRL 993	191	3	0	3	0,00
	01.2023	CNH 92	13	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 639	PLN 3.238	99	0	99	0,00
	02.2023	190	BRL 993	0	(3)	(3)	0,00
	03.2023	2.963	MXN 60.920	120	0	120	0,00
	04.2023	1.072	21.572	13	0	13	0,00
JPM	01.2023	2.984	CAD 4.048	3	0	3	0,00
	01.2023	315	CNY 2.193	3	0	3	0,00
	02.2023	IDR 4.917.823	\$ 312	0	(6)	(6)	0,00
	02.2023	TWD 171	6	0	0	0	0,00
	03.2023	MXN 10	1	0	0	0	0,00
	03.2023	\$ 566	CNY 3.915	3	0	3	0,00
	03.2023	425	IDR 6.648.128	5	0	5	0,00
MBC	01.2023	CAD 4.960	\$ 3.698	37	0	37	0,00
	01.2023	€ 52.153	54.677	0	(1.007)	(1.007)	(0,01)
	01.2023	£ 8.249	10.054	129	0	129	0,00
	01.2023	NOK 2.045	209	1	0	1	0,00
	01.2023	\$ 1.020	CAD 1.370	0	(9)	(9)	0,00
	01.2023	86.507	€ 81.449	457	0	457	0,01
	03.2023	258	IDR 4.035.070	3	0	3	0,00
	05.2023	CNH 189.447	\$ 28.229	583	0	583	0,01
MYI	01.2023	AUD 2.368	1.590	0	(16)	(16)	0,00
	01.2023	£ 113	135	0	0	0	0,00
	01.2023	SGD 2	1	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 6.416	€ 6.012	3	0	3	0,00
	01.2023	3.937	£ 3.266	0	(8)	(8)	0,00
	02.2023	TWD 316	\$ 10	0	0	0	0,00
	03.2023	\$ 363	IDR 5.685.354	5	0	5	0,00
RBC	03.2023	3.594	MXN 71.874	48	0	48	0,00
SCX	04.2023	MXN 216.585	\$ 10.449	0	(451)	(451)	(0,01)
	01.2023	€ 1.157.795	1.205.091	0	(31.094)	(31.094)	(0,36)
	01.2023	KRW 712.593	539	0	(27)	(27)	0,00
	01.2023	\$ 1.413	€ 1.327	4	0	4	0,00
	02.2023	IDR 5.174.663	\$ 329	0	(6)	(6)	0,00
	02.2023	TWD 3.149	102	0	(1)	(1)	0,00
TOR	01.2023	£ 296.876	356.930	0	(239)	(239)	0,00
UAG	01.2023	\$ 2.835	£ 2.290	0	(80)	(80)	0,00
	02.2023	IDR 7.679.994	\$ 484	0	(13)	(13)	0,00
	05.2023	\$ 27.344	CNH 189.496	309	0	309	0,00
	09.2023	1.156	ZAR 20.273	11	0	11	0,00
				\$ 1.886	\$ (68.998)	\$ (67.112)	(0,76)

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Diversified Income Fund (Forts.)

ABGESICHERTE DEVISENTERMIKONTRÄKTE

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilklassen Administrative AUD (Hedged) ausschüttend und M Retail AUD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	01.2023	\$ 8.405	AUD 12.477	\$ 58	\$ 0	\$ 58	0,00
BOA	01.2023	AUD 143	\$ 97	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 11	AUD 16	0	0	0	0,00
CBK	01.2023	AUD 177	\$ 120	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 876	AUD 1.291	4	(4)	0	0,00
MBC	01.2023	AUD 35	\$ 24	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 4.882	AUD 7.248	40	(5)	35	0,00
MYI	01.2023	10.431	15.533	105	0	105	0,00
RBC	01.2023	1.696	2.529	20	0	20	0,00
TOR	01.2023	9.438	13.983	47	0	47	0,00
				\$ 274	\$ (9)	\$ 265	0,00

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilklasse Institutional CAD (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2023	CAD 149	\$ 109	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	01.2023	\$ 62.990	CAD 85.170	0	(130)	(130)	0,00
CBK	01.2023	CAD 1.200	\$ 889	3	0	3	0,00
	01.2023	\$ 2	CAD 3	0	0	0	0,00
MBC	01.2023	CAD 400	\$ 293	0	(3)	(3)	0,00
	01.2023	\$ 124.945	CAD 169.000	0	(213)	(213)	0,00
MYI	01.2023	CAD 2.203	\$ 1.627	1	0	1	0,00
RBC	01.2023	605	445	0	(1)	(1)	0,00
	01.2023	\$ 3.397	CAD 4.601	0	(1)	(1)	0,00
SCX	01.2023	30.842	41.434	0	(261)	(261)	0,00
TOR	01.2023	108.662	146.073	0	(851)	(851)	(0,01)
				\$ 4	\$ (1.460)	\$ (1.456)	(0,01)

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilklassen Institutional CHF (Hedged) thesaurierend, Institutional CHF (Hedged) ausschüttend, Class E CHF (Hedged) thesaurierend, Class W CHF (Hedged) thesaurierend und Class W CHF (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2023	CHF 13	\$ 13	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	01.2023	\$ 16.150	CHF 15.269	365	0	365	0,00
BRC	01.2023	CHF 36	\$ 39	0	0	0	0,00
CBK	01.2023	\$ 28.040	CHF 26.488	608	0	608	0,01
MBC	01.2023	CHF 294	\$ 317	0	(1)	(1)	0,00
	01.2023	\$ 16	CHF 15	0	0	0	0,00
MYI	01.2023	16	15	0	0	0	0,00
SCX	01.2023	CHF 51	\$ 55	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 2.095	CHF 1.943	6	0	6	0,00
				\$ 979	\$ (1)	\$ 978	0,01

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Investor EUR (Hedged) thesaurierend, Investor EUR (Hedged) ausschüttend, Administrative EUR (Hedged) thesaurierend, Class E EUR (Hedged) thesaurierend, Class E EUR (Hedged) ausschüttend, Class T EUR (Hedged) thesaurierend, Class T EUR (Hedged) ausschüttend, Class W EUR (Hedged) thesaurierend und Class W EUR (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2023	€ 1.257	\$ 1.326	\$ 0	\$ (16)	\$ (16)	0,00
BPS	01.2023	1.185	1.263	0	(2)	(2)	0,00
	01.2023	\$ 2.107	€ 1.975	1	0	1	0,00
CBK	01.2023	€ 33.460	\$ 35.625	0	(101)	(101)	0,00
	01.2023	\$ 1.119.322	€ 1.079.099	32.840	0	32.840	0,38
MBC	01.2023	€ 30.003	\$ 31.923	1	(113)	(112)	0,00
	01.2023	\$ 1.383.231	€ 1.319.894	26.027	0	26.027	0,30
SCX	01.2023	1.237.236	1.188.679	31.923	0	31.923	0,36
TOR	01.2023	4.540	4.266	15	0	15	0,00
				\$ 90.807	\$ (232)	\$ 90.575	1,04

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend, Institutional GBP (Hedged) ausschüttend, Administrative GBP (Hedged) ausschüttend, Class W GBP (Hedged) thesaurierend und Class W GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2023	£ 4.775	\$ 5.770	\$ 25	\$ 0	\$ 25	0,00
BOA	01.2023	\$ 474	£ 389	0	(6)	(6)	0,00
BPS	01.2023	8	6	0	0	0	0,00
BRC	01.2023	£ 3.225	\$ 3.884	4	0	4	0,00
JPM	01.2023	\$ 385.014	£ 318.846	0	(1.414)	(1.414)	(0,02)
MBC	01.2023	£ 14	\$ 17	0	0	0	0,00
MYI	01.2023	\$ 415.253	£ 345.618	1.490	(933)	557	0,01
MYI	01.2023	£ 29	\$ 36	1	0	1	0,00
MYI	01.2023	\$ 8.202	£ 6.673	0	(174)	(174)	0,00
TOR	01.2023	383.502	318.976	256	0	256	0,00
UAG	01.2023	£ 529	\$ 656	19	0	19	0,00
UAG	01.2023	\$ 145	£ 118	0	(3)	(3)	0,00
				\$ 1.795	\$ (2.530)	\$ (735)	(0,01)

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilsklasse Administrative JPY (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2023	\$ 103	¥ 13.955	\$ 3	\$ 0	\$ 3	0,00
BPS	01.2023	856	118.169	41	0	41	0,00
CBK	01.2023	26	3.429	0	0	0	0,00
MYI	01.2023	1.247	171.085	50	0	50	0,00
SCX	01.2023	363	50.217	17	0	17	0,00
				\$ 111	\$ 0	\$ 111	0,00

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilsklasse Institutional MXN (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2023	\$ 4.026	MXN 78.861	\$ 20	\$ 0	\$ 20	0,00
BRC	01.2023	4.023	78.861	23	0	23	0,00
CBK	01.2023	MXN 91.626	\$ 4.710	10	(1)	9	0,00
	01.2023	\$ 3.147	MXN 61.994	34	0	34	0,00
	02.2023	4.624	90.396	0	(10)	(10)	0,00
GLM	01.2023	MXN 156.463	\$ 7.992	9	(45)	(36)	0,00
	01.2023	\$ 4.105	MXN 80.558	29	(1)	28	0,00
	02.2023	4.625	90.396	0	(10)	(10)	0,00
MBC	01.2023	MXN 2.654	\$ 134	0	(2)	(2)	0,00
MYI	01.2023	\$ 1.508	MXN 29.759	19	0	19	0,00
SCX	01.2023	MXN 90.396	\$ 4.647	9	0	9	0,00
	02.2023	\$ 4.624	MXN 90.396	0	(9)	(9)	0,00
UAG	01.2023	MXN 994	\$ 51	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 626	MXN 12.098	0	(5)	(5)	0,00
	02.2023	51	994	0	0	0	0,00
				\$ 153	\$ (83)	\$ 70	0,00

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional SEK (Hedged) thesaurierend und Administrative SEK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2023	\$ 156	SEK 1.607	\$ 0	\$ (2)	\$ (2)	0,00
BRC	01.2023	4.908	51.399	27	0	27	0,00
CBK	01.2023	646	6.735	1	0	1	0,00
MYI	01.2023	1.332	14.015	13	0	13	0,00
UAG	01.2023	9.117	95.653	66	0	66	0,00
				\$ 107	\$ (2)	\$ 105	0,00

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional SGD (Hedged) ausschüttend, Administrative SGD (Hedged) ausschüttend, Class E SGD (Hedged) ausschüttend und Class W SGD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2023	\$ 29.104	SGD 39.942	\$ 682	\$ 0	\$ 682	0,01
BPS	01.2023	32.749	44.881	719	0	719	0,01
GLM	01.2023	SGD 124	\$ 92	0	(1)	(1)	0,00
	01.2023	\$ 1.020	SGD 1.395	20	0	20	0,00
MBC	01.2023	SGD 1.442	\$ 1.065	0	(11)	(11)	(0,01)
	01.2023	\$ 30.080	SGD 41.126	589	0	589	0,01

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Diversified Income Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
UAG	01.2023	SGD 150	\$ 110	\$ 0	\$ (2)	\$ (2)	0,00
				\$ 2.010	\$ (14)	\$ 1.996	0,02
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						\$ 23.288	0,27
Summe Anlagen						\$ 9.225.432	105,41
Sonstige Aktiva und Passiva						\$ (473.636)	(5,41)
Nettovermögen						\$ 8.751.796	100,00

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

- * Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt
- ^ Das Wertpapier ist in Verzug.
- μ Bei diesem Betrag handelt es sich ganz oder teilweise um ungedeckte Darlehenszusagen. Der Zinssatz für den ungedeckten Teil wird zum Zeitpunkt der Finanzierung festgelegt.
- (a) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.
- (b) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.
- (c) Nullkuponwertpapier.
- (d) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.
- (e) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.
- (f) Mit dem Fonds verbunden.
- (g) Bedingt wandelbares Wertpapier.
- (h) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2021: 0,52 %):

Emittentenbeschreibung	Kauf- datum	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
Citigroup, Inc. 2,572 % fällig am 03.06.2031	26.05.2020	\$ 6.900	\$ 5.596	0,06
Constellation Oil Services Holding S.A. 'B'	10.06.2022	92	92	0,00
Corestate Capital Holding S.A. 8,000 % fällig am 15.04.2023	06.12.2022	1.785	1.815	0,02
Deutsche Bank AG 3,035 % fällig am 28.05.2032	25.05.2021 - 29.07.2021	1.123	836	0,01
Deutsche Bank AG 3,729 % fällig am 14.01.2032	12.08.2022 - 16.08.2022	2.298	2.132	0,02
General Motors Co. 6,800 % fällig am 01.10.2027	07.05.2020	1.697	1.767	0,02
Intelsat Emergence S.A.	01.05.2020 - 29.10.2021	16.083	4.419	0,05
		\$ 29.978	\$ 16.657	0,18

- (i) Wertpapiere mit einem Gesamtwert von 6.805 USD (31. Dezember 2021: 80.181 USD) und Barmittel in Höhe von 4.245 USD (31. Dezember 2021: 0 USD) wurden gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen zum 31. Dezember 2022 als Sicherheiten verpfändet.

Barmittel in Höhe von 277 USD (31. Dezember 2021: 350 USD) wurden gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen zum 31. Dezember 2022 als Sicherheiten erhalten.

Barmittel in Höhe von 268.487 USD (31. Dezember 2021: 367.860 USD) wurden zum 31. Dezember 2022 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Wertpapiere mit einem Gesamtwert von 0 USD (31. Dezember 2021: 1.415 USD) und Barmittel in Höhe von 9.202 USD (31. Dezember 2021: 18.540 USD) wurden gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. zum 31. Dezember 2022 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 6.595.189	\$ 25.428	\$ 6.620.617
Investmentfonds	609.289	267.341	0	876.630
Pensionsgeschäfte	0	1.746.323	0	1.746.323
Finanzderivate ⁽³⁾	69	(18.207)	0	(18.138)
Summen	\$ 609.358	\$ 8.590.646	\$ 25.428	\$ 9.225.432

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

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 5.994	\$ 14.253.100	\$ 14.925	\$ 14.274.019
Investmentfonds	1.614.943	0	0	1.614.943
Pensionsgeschäfte	0	157.316	0	157.316
Finanzderivate ⁽³⁾	2.739	113.040	0	115.779
Summen	\$ 1.623.676	\$ 14.523.456	\$ 14.925	\$ 16.162.057

⁽¹⁾ Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

(2) Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

(3) Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kreditbetrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensionsgeschäften	% des Nettovermögens
BRC	0,500 %	21.09.2022	TBD ⁽¹⁾	€ (3.442)	\$ (3.673)	(0,04)
JML	0,800	21.09.2022	TBD ⁽¹⁾	(646)	(690)	(0,01)
	(0,400)	23.09.2022	TBD ⁽¹⁾	(2.148)	(2.283)	(0,03)
Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte					\$ (6.646)	(0,08)

(1) Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung des Marktwerts der außerbörslich gehandelten Finanzderivate und (erhaltenen)/verpfändeten Sicherheiten nach Kontrahenten zum 31. Dezember 2022 und 31. Dezember 2021:

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2022			Zum 31. Dez. 2021		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement ⁽¹⁾	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement ⁽¹⁾
AZD	\$ 58	\$ 0	\$ 58	\$ k. A.	\$ k. A.	\$ k. A.
BOA	941	(920)	21	(453)	312	(141)
BPS	650	(800)	(150)	(31.423)	18.410	(13.013)
BRC	(2.633)	2.650	17	17.195	(9.560)	7.635
CBK	(1.931)	1.730	(201)	140	(212)	(72)
DUB	k. A.	k. A.	k. A.	389	0	389
FBF	(104)	260	156	594	(550)	44
GLM	233	(250)	(17)	2.129	(4.240)	(2.111)
GST	(2.878)	2.952	74	3.647	(3.450)	197
HUS	k. A.	k. A.	k. A.	1.227	(800)	427
JPM	2.534	(3.820)	(1.286)	8.772	(7.910)	862
MBC	27.060	(25.160)	1.900	k. A.	k. A.	k. A.
MYC	(152)	260	108	502	(440)	62
MYI	(196)	260	64	15.617	(12.394)	3.223
RBC	(385)	430	45	1.228	130	1.358
SCX	561	(330)	231	38.828	(27.540)	11.288
SSB	k. A.	k. A.	k. A.	(16)	0	(16)
TOR	(772)	660	(112)	23.126	(14.080)	9.046
UAG	302	0	302	(1.216)	1.103	(113)

(1) Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2022:

	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	48,23	61,10
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	25,74	23,45
Sonstige übertragbare Wertpapiere	1,67	2,22
Investmentfonds	10,02	9,82
Pensionsgeschäfte	19,95	0,96
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,32)	0,16
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,15)	0,06
Freiverkehrsfinanzderivate	0,27	0,49
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(0,08)	(0,50)

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2022 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
Albanien	0,18	0,13
Argentinien	0,52	0,53
Australien	0,07	0,05
Österreich	k. A.	0,25
Weissrussland	0,03	0,04
Bermuda	0,72	0,48
Brasilien	0,00	0,60
Kanada	0,29	0,24
Cayman-Inseln	2,14	3,12
Chile	0,08	0,12
China	0,03	0,51
Kolumbien	0,42	0,40
Zypern	0,17	k. A.
Dänemark	0,14	k. A.
Dominikanische Republik	0,38	0,66
Ecuador	0,25	0,24

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
Ägypten	0,56	0,61
Finnland	0,08	k. A.
Frankreich	3,16	3,68
Deutschland	3,24	4,25
Ghana	0,06	0,10
Guernsey, Kanalinseln	0,54	0,45
Hongkong	0,98	1,06
Indien	0,02	0,04
Indonesien	0,60	1,86
Irland	6,34	4,26
Insel Man	k. A.	0,24
Israel	0,11	0,06
Italien	3,95	3,93
Elfenbeinküste	0,12	0,27
Japan	0,92	0,71
Jersey, Kanalinseln	1,02	0,65
Jordanien	k. A.	0,07
Kasachstan	k. A.	0,01
Liberia	k. A.	0,09
Luxemburg	3,92	4,24
Mazedonien	0,08	0,05
Malaysia	k. A.	0,01
Mauritius	0,08	0,05
Mexiko	1,79	2,39
Marokko	k. A.	0,07
Multinational	0,33	0,50
Niederlande	3,82	3,83
Nigeria	0,41	0,31
Norwegen	k. A.	0,08
Oman	0,31	0,74
Panama	0,25	0,19
Paraguay	k. A.	0,09
Peru	k. A.	0,26
Portugal	0,14	0,14
Katar	0,12	0,83
Rumänien	0,07	0,22
Russland	0,29	0,53
Saudi-Arabien	k. A.	1,21
Serbien	0,07	0,07
Singapur	0,15	0,20
Slowenien	0,16	0,05
Südafrika	0,09	0,47
Spanien	0,97	1,01
Sri Lanka	0,08	0,07
Supranational	k. A.	0,05
Schweden	0,37	0,01
Schweiz	1,22	1,16
Tunesien	k. A.	0,02
Türkei	0,70	1,27
Ukraine	0,22	0,57
Vereinigte Arabische Emirate	0,13	0,59
Großbritannien	7,14	8,41
USA	22,65	19,08
Venezuela	0,03	0,01
Jungferninseln (Britisch)	0,06	0,04
Kurzfristige Instrumente	2,87	8,24
Investmentfonds	10,02	9,82
Pensionsgeschäfte	19,95	0,96
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,32)	0,16
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	(0,12)	0,03
Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf	0,18	(0,01)
Zinsswaps	(0,21)	0,04
Freiverkehrsfinaanzderivate		
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaptions auf Kreditindizes	0,00	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	(0,02)	0,08
Devisenterminkontrakte	(0,76)	(0,26)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	1,05	0,67
Sonstige Aktiva und Passiva	(5,41)	1,74
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE								FRANKREICH			
ARGENTINIEN								UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
STAAATSEMISSIONEN								Altice France S.A.			
Argentina Government International Bond								3,375 % fällig am 15.01.2028	€ 100	\$ 81	0,01
1,500 % fällig am 09.07.2035	\$ 1.252	\$ 319	0,06					4,000 % fällig am 15.07.2029	900	730	0,13
3,500 % fällig am 09.07.2041	7.722	2.214	0,39					4,250 % fällig am 15.10.2029	1.600	1.287	0,23
Provincia de Buenos Aires								5,500 % fällig am 15.10.2029	\$ 1.600	1.223	0,22
72,913 % fällig am 12.04.2025								BNP Paribas S.A.			
(a)	ARS 610	2	0,00					1,904 % fällig am 30.09.2028	2.800	2.336	0,41
Summe Argentinien		2.535	0,45					3,500 % fällig am 16.11.2027	400	368	0,07
								5,198 % fällig am 10.01.2030	500	476	0,08
WEISSRUSSLAND								CGG S.A.			
STAAATSEMISSIONEN								8,750 % fällig am 01.04.2027			
Belarus Government International Bond								3,100	2.483	0,44	
5,875 % fällig am 24.02.2026 ^	\$ 700	301	0,05					Loxam S.A.S.			
								2,875 % fällig am 15.04.2026	€ 200	191	0,03
								3,250 % fällig am 14.01.2025	500	510	0,09
								Renault S.A.			
								2,375 % fällig am 25.05.2026	3.600	3.467	0,61
								TDF Infrastructure SASU			
								1,750 % fällig am 01.12.2029	3.600	2.925	0,52
								Ubisoft Entertainment S.A.			
								0,878 % fällig am 24.11.2027	400	331	0,06
										16.408	2,90
								KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG			
								Casino Guichard-Perrachon S.A.			
								5,340 % fällig am 31.08.2025	2.600	2.361	0,42
								Summe Frankreich			
										18.769	3,32
								DEUTSCHLAND			
								UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
								ADLER Real Estate AG			
								2,125 % fällig am 06.02.2024	100	95	0,02
								3,000 % fällig am 27.04.2026	400	298	0,05
								Deutsche Bank AG			
								1,750 % fällig am 19.11.2030	3.600	3.026	0,54
								3,547 % fällig am 18.09.2031	\$ 3.600	2.894	0,51
								5,882 % fällig am 08.07.2031	3.400	2.942	0,52
								Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide			
								1,875 % fällig am 31.03.2028	€ 1.500	1.383	0,25
								IHO Verwaltungen GmbH (3,625 % bar oder 4,375 % PIK)			
								3,625 % fällig am 15.05.2025 (b)	300	293	0,05
								IHO Verwaltungen GmbH (3,750 % bar oder 4,500 % PIK)			
								3,750 % fällig am 15.09.2026 (b)	2.750	2.560	0,45
								INEOS Styrolution Group GmbH			
								2,250 % fällig am 16.01.2027	2.400	2.092	0,37
								ZF Finance GmbH			
								2,750 % fällig am 25.05.2027	1.200	1.082	0,19
								3,750 % fällig am 21.09.2028	3.100	2.790	0,50
								Summe Deutschland			
										19.455	3,45
								GHANA			
								STAAATSEMISSIONEN			
								Ghana Government International Bond			
								8,125 % fällig am 26.03.2032 ^	\$ 400	147	0,03
								8,750 % fällig am 11.03.2061 ^	€ 300	106	0,02
								8,950 % fällig am 26.03.2051 ^	200	72	0,01
								Summe Ghana			
										325	0,06
								GUERNSEY, KANALINSELN			
								UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
								Doric Nimrod Air Alpha Pass-Through Trust			
								5,250 % fällig am 30.05.2025	13	13	0,00
								Globalworth Real Estate Investments Ltd.			
								3,000 % fällig am 29.03.2025	€ 2.600	2.435	0,43
								Summe Guernsey, Kanalinseln			
										2.448	0,43
								HONGKONG			
								UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
								Fortune Star BVI Ltd.			
								3,950 % fällig am 02.10.2026	3.600	2.209	0,39
								Huarong Finance Co. Ltd.			
								2,125 % fällig am 30.09.2023	\$ 2.800	2.695	0,48
								5,824 % fällig am 24.02.2023	1.200	1.196	0,21
								Summe Hongkong			
										6.100	1,08

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Diversified Income Duration Hedged Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	
INDIEN				4,810 % fällig am 17.09.2030				\$ 200 \$ 170 0,03				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Summe Japan				6,256 1,11				
Adani Electricity Mumbai Ltd. 3,949 % fällig am 12.02.2030				\$ 400				\$ 306 0,05				
INDONESIEN				JERSEY, KANALINSELN				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				AA Bond Co. Ltd. 5,500 % fällig am 31.07.2050				£ 2.200 2.296 0,41				
Perusahaan Perseroan PT Perusahaan Listrik Negara 1,875 % fällig am 05.11.2031				€ 500				386 0,07				
STAATSEMISSIONEN				Adient Global Holdings Ltd. 3,500 % fällig am 15.08.2024				€ 300 308 0,05				
Indonesia Government International Bond 1,100 % fällig am 12.03.2033				2.000				1.568 0,28				
1,400 % fällig am 30.10.2031				700				585 0,10				
				2.153				0,38				
Summe Indonesien				2.539				0,45				
IRLAND				LUXEMBURG				AKTIEN				
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				STAMMAKTIVEN				Intelsat Emergence S.A. (c)(i)				
Aurium CLO DAC 2,108 % fällig am 16.01.2031				300				14.398 346 0,06				
Bain Capital Euro CLO DAC 2,196 % fällig am 20.01.2032				2.000				2.080 0,37				
GoldenTree Loan Management EUR CLO DAC 2,356 % fällig am 20.01.2032				200				206 0,04				
Harvest CLO DAC 2,228 % fällig am 15.01.2032				2.500				2.586 0,46				
Laurelin DAC 2,176 % fällig am 20.10.2031				1.100				1.138 0,20				
Palmerston Park CLO DAC 2,053 % fällig am 18.04.2030				319				334 0,06				
Sculptor European CLO DAC 2,153 % fällig am 14.01.2032				800				831 0,15				
Toro European CLO DAC 2,239 % fällig am 12.01.2032				300				308 0,05				
2,572 % fällig am 15.02.2034				750				772 0,14				
				8.568				1,52				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				ADLER Group S.A. 2,250 % fällig am 27.04.2027				500 189 0,03				
ABH Financial Ltd. Via Alfa Holding Issuance PLC 2,800 % fällig am 11.06.2023				2.800				209 0,04				
Bank of Ireland Group PLC 6,253 % fällig am 16.09.2026				\$ 700				695 0,12				
				904				0,16				
KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG				Albion Financing SARL 5,250 % fällig am 15.10.2026				1.300 1.217 0,22				
Setanta Aircraft Leasing DAC 6,730 % fällig am 05.11.2028				4.000				3.988 0,70				
Summe Irland				13.460				2,38				
ITALIEN				Altice Financing S.A. 5,750 % fällig am 15.08.2029				6.000 4.731 0,84				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Altice France Holding S.A. 6,000 % fällig am 15.02.2028				700 415 0,07				
Atlantia SpA 1,625 % fällig am 03.02.2025				€ 300				300 0,05				
1,875 % fällig am 13.07.2027				300				273 0,05				
1,875 % fällig am 12.02.2028				5.000				4.449 0,79				
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 2,625 % fällig am 28.04.2025				3.600				3.487 0,62				
8,000 % fällig am 22.01.2030				2.700				2.529 0,45				
Intesa Sanpaolo SpA 5,148 % fällig am 10.06.2030				€ 100				98 0,02				
5,500 % fällig am 01.03.2028				€ 1.500				1.326 0,23				
Nexti SpA 2,125 % fällig am 30.04.2029				2.600				2.259 0,40				
UniCredit SpA 7,296 % fällig am 02.04.2034				\$ 1.700				1.561 0,27				
7,830 % fällig am 04.12.2023				7.100				7.175 1,27				
Summe Italien				23.457				4,15				
JAPAN				Corestate Capital Holding S.A. 1,375 % fällig am 28.11.2049 ^				€ 2.000 397 0,07				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Corestate Capital Holding S.A. 3,500 % fällig am 15.04.2023 ^				€ 3.500 585 0,10				
Nissan Motor Co. Ltd. 4,345 % fällig am 17.09.2027				6.700				6.086 1,08				
				26.321				4,66				
KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG				CPI Property Group S.A. 1,500 % fällig am 27.01.2031				1.000 619 0,11				
				1,625 % fällig am 23.04.2027				800 610 0,11				
				1,750 % fällig am 14.01.2030				1.400 912 0,16				
				2,750 % fällig am 12.05.2026				100 84 0,02				
				Cromwell Ereit Lux Finco SARL 2,125 % fällig am 19.11.2025				400 345 0,06				
				FEL Energy SARL 5,750 % fällig am 01.12.2040				\$ 3.696 3.168 0,56				
				Gazprom PJSC Via Gaz Capital S.A. 4,250 % fällig am 06.04.2024				£ 1.900 1.601 0,28				
				Intelsat Jackson Holdings S.A. 6,500 % fällig am 15.03.2030				\$ 1.072 961 0,17				
				Lincoln Financing SARL 3,625 % fällig am 01.04.2024				€ 3.300 3.487 0,62				
				6,007 % fällig am 01.04.2024				1.500 1.595 0,28				
				Logicor Financing SARL 3,250 % fällig am 13.11.2028				1.000 900 0,16				
				SIG Combibloc Purchase Co. SARL 1,875 % fällig am 18.06.2023				2.900 3.075 0,54				
				26.321				4,66				
KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG				Albion Financing SARL 6,752 % fällig am 17.08.2026				2.000 2.094 0,37				
				Intelsat Jackson Holdings S.A. 7,445 % fällig am 01.02.2029				\$ 279 270 0,05				
				2.364				0,42				
RECHTE				MAZEDONIEN				STAATSEMISSIONEN				
Intelsat Jackson Holdings S.A. – Exp. 5. Dezember 2025				3.012				\$ 21 0,01				
Summe Luxemburg				29.449				5,22				
				MAURITIUS				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
				Greenko Solar Mauritius Ltd. 5,550 % fällig am 29.01.2025				\$ 800 755 0,13				
				MEXIKO				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
				Petroleos Mexicanos 5,625 % fällig am 23.01.2046				1.416 827 0,15				
				6,350 % fällig am 12.02.2048				700 429 0,07				
				6,625 % fällig am 15.06.2035				4.800 3.493 0,62				
				6,625 % fällig am 15.06.2038				400 276 0,05				
				6,750 % fällig am 21.09.2047				3.700 2.369 0,42				
				7,690 % fällig am 23.01.2050				2.584 1.794 0,32				
				Trust Fibra Uno 6,390 % fällig am 15.01.2050				300 243 0,04				
				Summe Mexiko				9.431				1,67
				MULTINATIONAL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
				Allied Universal Holdco LLC 3,625 % fällig am 01.06.2028				€ 1.700 1.446 0,26				
				Connect Finco SARL 6,750 % fällig am 01.10.2026				\$ 1.000 929 0,16				
				Summe multinational				2.375				0,42
				NIEDERLANDE				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
				ASR Nederland NV 7,000 % fällig am 07.12.2043				€ 100 107 0,02				
				Athora Netherlands NV 7,000 % fällig am 19.06.2025				(f)(h) 200 209 0,04				
				CTP NV 0,500 % fällig am 21.06.2025				100 90 0,02				
				1,500 % fällig am 27.09.2031				100 64 0,01				
				Imperial Brands Finance Netherlands BV 1,750 % fällig am 18.03.2033				2.000 1.509 0,27				
				ING Groep NV 5,750 % fällig am 16.11.2026				(f)(h) \$ 300 266 0,05				
				6,500 % fällig am 16.04.2025				(f)(h) 1.300 1.232 0,22				
				6,750 % fällig am 16.04.2024				(f)(h) 600 579 0,10				
				NE Property BV 3,375 % fällig am 14.07.2027				€ 1.800 1.667 0,29				
				NN Group NV 4,500 % fällig am 15.01.2026 (f)				1.100 1.145 0,20				
				Q-Park Holding BV 3,500 % fällig am 01.02.2025				2.600 2.518 0,45				
				Syngenta Finance NV 3,375 % fällig am 16.04.2026				2.600 2.623 0,46				
				4,892 % fällig am 24.04.2025				\$ 1.276 1.237 0,22				
				Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV 4,500 % fällig am 01.03.2025				€ 1.400 1.437 0,25				
				United Group BV 5,250 % fällig am 01.02.2030				600 464 0,08				
				Volkswagen International Finance NV 3,500 % fällig am 17.06.2025 (f)				900 891 0,16				
				ZF Europe Finance BV 2,000 % fällig am 23.02.2026				100 92 0,02				
				16.130				2,86				
				KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG				Sigma Bidco BV 3,738 % fällig am 02.07.2025				
				400				372 0,06				

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	
WP/AP Telecom Holdings BV				SCHWEDEN				Santander UK Group Holdings PLC				
6,202 % fällig am 30.03.2029				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				3,823 % fällig am 03.11.2028				
€	5.700	\$ 5.864	1,04	Volvo Car AB	€	2.000	\$ 1.967	0,35	\$	1.500	\$ 1.343	0,24
		6.236	1,10	4,250 % fällig am 31.05.2028					€	1.500	1.739	0,31
Summe Niederlande		22.366	3,96					(f)(h)				
NIGERIA				SCHWEIZ				Virgin Media Secured Finance PLC				
STAATSEMISSIONEN				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				4,250 % fällig am 15.01.2030				
Nigeria Government International Bond				Credit Suisse AG				Virgin Money UK PLC				
7,625 % fällig am 28.11.2047				6,500 % fällig am 08.08.2023 (h)				4,000 % fällig am 03.09.2027				
\$	1.300	842	0,15	\$	2.800	2.718	0,48	1.400		1.523	0,27	
		400	0,05			700	581	0,10		21.937	3,88	
		7.696	0,15									
		1.800	0,24									
Summe Nigeria		2.478	0,44	Summe Schweiz		3.299	0,58					
OMAN				TÜRKEI				NON-AGENCY-MBS				
STAATSEMISSIONEN				STAATSEMISSIONEN				Towd Point Mortgage Funding PLC				
Oman Government International Bond				Turkey Government International Bond				4,071 % fällig am 20.10.2051				
	1.600	1.504	0,27		2.200	1.438	0,26	€	1.972	2.358	0,42	
					4.900	3.356	0,59			24.295	4,30	
				5,750 % fällig am 11.05.2047				Summe Großbritannien				
				Summe Türkei		4.794	0,85					
KATAR				UKRAINE				USA				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				
Nakilat, Inc.				NPC Ukrenerg				Aames Mortgage Investment Trust				
6,067 % fällig am 31.12.2033				6,875 % fällig am 09.11.2028 ^				5,169 % fällig am 25.10.2035				
	1.196	1.236	0,22		800	142	0,03	\$	120	117	0,02	
RUMÄNIEN				VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE				5,216 % fällig am 25.06.2035				
STAATSEMISSIONEN				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Accredited Mortgage Loan Trust				
Romania Government International Bond				DAE Sukuk Dific Ltd.				5,109 % fällig am 25.09.2035				
2,000 % fällig am 14.04.2033				3,750 % fällig am 15.02.2026				ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust				
€	600	412	0,07		900	856	0,15	82		80	0,01	
		600	0,07					82				
								82				
Summe Rumänien		772	0,14	Summe Ukraine		1.124	0,20	Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates				
RUSSLAND				GROSSBRITANNIEN				4,478 % fällig am 25.11.2032 ^				
STAATSEMISSIONEN				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				5,094 % fällig am 25.11.2035				
Russia Government International Bond				Barclays PLC				Argent Securities Trust				
4,250 % fällig am 23.06.2027 ^				5,875 % fällig am 15.09.2024				4,709 % fällig am 25.05.2036				
\$	600	210	0,04	(f)(h)	€	4.400	874	0,15	576	146	0,03	
						200	40	0,01				
						300	68	0,01				
Summe Russland		802	0,14	Summe Vereinigte Arabische Emirate		982	0,17	Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust				
SLOWENIEN				UKRAINE				5,019 % fällig am 25.12.2035				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				5,394 % fällig am 25.06.2035				
Nova Kreditna Banka Maribor d.d.				Ukraine Government International Bond				6,189 % fällig am 25.07.2034				
1,875 % fällig am 27.01.2025				4,375 % fällig am 27.01.2032				Carrington Mortgage Loan Trust				
€	1.000	968	0,17	^(b)	€	4.400	874	0,15	742	667	0,12	
						200	40	0,01	300	286	0,05	
Summe Slowenien		1.500	0,27	Summe Ukraine		1.124	0,20	Countrywide Asset-Backed Certificates				
SÜDAFRIKA				VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE				5,489 % fällig am 25.05.2047 ^				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Countrywide Asset-Backed Certificates Trust				
AngloGold Ashanti Holdings PLC				DAE Sukuk Dific Ltd.				3,209 % fällig am 25.03.2036				
3,750 % fällig am 01.10.2030				3,750 % fällig am 15.02.2026				4,589 % fällig am 25.11.2047 ^				
\$	200	174	0,03		900	856	0,15	77	75	0,01		
								570	549	0,10		
								1.600	1.379	0,24		
								2.100	2.000	0,34		
								2.003	1.932	0,34		
								77	76	0,01		
								144	143	0,03		
Summe Südafrika		373	0,07	Summe Vereinigte Arabische Emirate		982	0,17	Countrywide Asset-Backed Certificates, Inc.				
SPANIEN				GROSSBRITANNIEN				4,949 % fällig am 25.04.2034				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.				
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.				Barclays PLC				4,598 % fällig am 25.01.2032				
6,000 % fällig am 15.01.2026				5,875 % fällig am 15.09.2024				Ellington Loan Acquisition Trust				
€	800	816	0,14	(f)(h)	€	1.000	1.010	0,18	5,439 % fällig am 25.05.2037	343	326	0,06
									First Franklin Mortgage Loan Trust	163	158	0,03
									5,664 % fällig am 25.07.2034			
									Fremont Home Loan Trust			
									4,929 % fällig am 25.04.2036	291	252	0,04
									5,319 % fällig am 25.06.2035 ^	700	624	0,11
									GSAA Home Equity Trust			
									4,509 % fällig am 25.11.2036	76	20	0,00
									GSAMP Trust			
									4,439 % fällig am 25.12.2046	25	12	0,00
									4,479 % fällig am 25.01.2037	43	26	0,00
									4,629 % fällig am 25.08.2036	587	471	0,08
									4,709 % fällig am 25.05.2046	0	0	0,00
									4,869 % fällig am 25.06.2036	201	108	0,02
									5,124 % fällig am 25.09.2035 ^	84	82	0,01
									Home Equity Asset Trust			
									5,484 % fällig am 25.05.2035	70	69	0,01
									Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust			
									4,769 % fällig am 25.06.2036	25	24	0,00
									IXIS Real Estate Capital Trust			
									5,019 % fällig am 25.02.2036	6	7	0,00
									JPMorgan Mortgage Acquisition Trust			
									3,773 % fällig am 25.07.2036	178	173	0,03
									4,579 % fällig am 25.03.2047	110	108	0,02
									4,649 % fällig am 25.06.2037	85	85	0,02

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	% DES		BESCHREIBUNG	PARI (000S)	% DES		BESCHREIBUNG	PARI (000S)	% DES	
		MARKT- WERT (000S)	NETTO- VERMÖ- GENS			MARKT- WERT (000S)	NETTO- VERMÖ- GENS			MARKT- WERT (000S)	NETTO- VERMÖ- GENS
4,889 % fällig am 25.04.2036	\$ 563	\$ 210	0,04	SunTrust Alternative Loan Trust				4,345 % fällig am 06.03.2023	\$ 10.100	\$ 10.101	1,79
6,000 % fällig am 25.05.2036 ^	140	76	0,01	5,039 % fällig am 25.12.2035 ^	\$ 2	\$ 2	0,00				
6,000 % fällig am 25.02.2037 ^	860	422	0,08	Thornburg Mortgage Securities Trust							
6,000 % fällig am 25.04.2037 ^	202	118	0,02	5,639 % fällig am 25.06.2037 ^	11	10	0,00				
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust				WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust							
3,008 % fällig am 25.04.2046 ^	17	5	0,00	3,248 % fällig am 25.11.2042	7	6	0,00				
3,537 % fällig am 25.03.2037 ^	9	7	0,00	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust							
4,929 % fällig am 25.04.2046	1.715	499	0,09	4,051 % fällig am 25.09.2036 ^	128	37	0,01				
6,000 % fällig am 25.12.2036 ^	342	157	0,03								
6,000 % fällig am 25.07.2037	66	28	0,01								
6,500 % fällig am 25.11.2036 ^	107	42	0,01								
Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.											
6,500 % fällig am 25.04.2033	0	0	0,00								
Credit Suisse Mortgage Capital Certificates											
2,746 % fällig am 26.04.2038	80	77	0,01								
3,635 % fällig am 27.09.2035	101	84	0,02								
First Horizon Mortgage Pass-Through Trust											
4,267 % fällig am 25.09.2035	12	11	0,00								
HarborView Mortgage Loan Trust											
4,779 % fällig am 19.05.2035	150	134	0,02								
4,819 % fällig am 19.06.2035	3	3	0,00								
4,893 % fällig am 20.10.2045	319	281	0,05								
4,959 % fällig am 19.11.2035	7	5	0,00								
HSI Asset Securitization Corp. Trust											
4,829 % fällig am 25.11.2035	1.488	1.381	0,25								
IndyMac Mortgage Loan Trust											
2,824 % fällig am 25.06.2037 ^	11	9	0,00								
3,644 % fällig am 25.12.2036 ^	2	2	0,00								
4,749 % fällig am 25.07.2047	56	39	0,01								
Lehman Mortgage Trust											
6,000 % fällig am 25.09.2037 ^	104	95	0,02								
Luminent Mortgage Trust											
4,789 % fällig am 25.10.2046	711	616	0,11								
Merrill Lynch Mortgage Investors Trust											
3,455 % fällig am 25.05.2036	4	3	0,00								
4,676 % fällig am 25.11.2029	1	1	0,00								
Morgan Stanley Mortgage Loan Trust											
3,665 % fällig am 25.03.2036 ^	35	24	0,00								
Nomura Asset Acceptance Corp. Alternative Loan Trust											
4,038 % fällig am 25.08.2035	1	1	0,00								
Residential Accredit Loans, Inc. Trust											
4,789 % fällig am 25.05.2047	62	54	0,01								
Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust											
4,829 % fällig am 25.06.2037	227	193	0,03								
Structured Asset Mortgage Investments Trust											
4,789 % fällig am 25.05.2036	459	351	0,06								
4,809 % fällig am 25.09.2047 ^	581	464	0,08								

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kapital- betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions- geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions- geschäft ⁽¹⁾	% des Nettovermögens
FICC	1,900 %	30.12.2022	03.01.2023	\$ 2.432	U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 29.06.2023	\$ (2.481)	\$ 2.432	\$ 2.432	0,43
	4,280	30.12.2022	03.01.2023	100.400	U.S. Treasury Notes 0,250 % - 3,000 % fällig am 30.06.2025 - 15.07.2025	(102.408)	100.400	100.448	17,78
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (104.889)	\$ 102.832	\$ 102.880	18,21

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Euro-Bobl March Futures	Short	03.2023	372	\$ 1.174	0,21
Euro-Bund 10-Year Bond March Futures	Long	03.2023	12	(61)	(0,01)
Euro-Schatz March Futures	Short	03.2023	335	476	0,08
United Kingdom Long Gilt March Futures	Long	03.2023	21	(165)	(0,03)
				\$ 1.424	0,25
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ 1.424	0,25

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Diversified Income Duration Hedged Fund (Forts.)

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
AT&T, Inc.	1,000 %	20.06.2026	\$ 2.200	\$ (37)	(0,01)
Auchan Holding S.A.	1,000	20.12.2027	€ 200	(7)	0,00
Boeing Co.	1,000	20.12.2026	\$ 500	(5)	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20.06.2027	1.000	(2)	0,00
General Electric Co.	1,000	20.06.2026	6.100	(15)	0,00
General Electric Co.	1,000	20.12.2026	600	(4)	0,00
Glencore Finance Europe Ltd.	5,000	20.12.2025	€ 3.300	(367)	(0,06)
Glencore Finance Europe Ltd.	5,000	20.12.2027	2.200	(285)	(0,05)
Marks & Spencer PLC	1,000	20.12.2024	4.100	108	0,02
Rolls-Royce PLC	1,000	20.12.2024	4.000	(84)	(0,02)
				\$ (698)	(0,12)

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.EM-34 5-Year Index	1,000 %	20.12.2025	\$ 3.864	\$ (16)	0,00
CDX.EM-36 5-Year Index	1,000	20.12.2026	22.816	242	0,04
CDX.EM-37 5-Year Index	1,000	20.06.2027	294	9	0,00
CDX.EM-38 5-Year Index	1,000	20.12.2027	5.800	146	0,03
CDX.HY-38 5-Year Index	5,000	20.06.2027	2.277	115	0,02
CDX.HY-39 5-Year Index	5,000	20.12.2027	17.100	446	0,08
CDX.IG-37 5-Year Index	1,000	20.12.2026	900	(2)	0,00
CDX.IG-38 5-Year Index	1,000	20.06.2027	19.800	136	0,02
CDX.IG-39 5-Year Index	1,000	20.12.2027	33.300	233	0,04
				\$ 1.309	0,23

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt	variabler Zinssatz	variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt ⁽³⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS		2,250 %	15.03.2028	£ 15.200	\$ 538	0,10
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS		0,050	15.12.2031	¥ 940.000	225	0,04
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS		1,000	15.06.2027	\$ 74.000	920	0,16
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS		1,750	15.06.2032	14.400	(153)	(0,03)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS		1,750	15.06.2052	14.000	124	0,02
Erhalt	3-Month USD-LIBOR		1,000	16.12.2030	22.300	4.293	0,75
Erhalt	3-Month USD-LIBOR		1,250	17.06.2025	33.800	4.104	0,73
Erhalt ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR		1,500	15.03.2053	€ 6.100	366	0,07
						\$ 10.417	1,84

Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate

\$ 11.028 1,95

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

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

⁽³⁾ Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

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

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

VERKAUFSOPTIONEN

CREDIT DEFAULT SWAPPTIONS AUF KREDITINDIZES

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/-verkauf	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
GST	Put - OTC iTraxx Europe 37 5-Year Index	Verkauf	3,000 %	15.03.2023	1.500	\$ (3)	\$ 0	0,00

⁽¹⁾ Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽²⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BRC	Indonesia Government International Bond	1,000 %	20.06.2031	\$ 5.500	\$ (236)	\$ 49	\$ (187)	(0,03)
GST	ADLER Real Estate AG	5,000	20.12.2026	€ 700	(5)	(174)	(179)	(0,03)
JPM	Hochtief AG	5,000	20.12.2026	2.700	643	(330)	313	0,05
					\$ 402	\$ (455)	\$ (53)	(0,01)

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

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

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2023	€ 871	\$ 919	\$ 0	\$ (11)	\$ (11)	0,00
	01.2023	\$ 834	£ 675	0	(22)	(22)	0,00
	02.2023	79	ZAR 1.445	6	0	6	0,00
BPS	01.2023	HUF 34.553	\$ 90	0	(2)	(2)	0,00
	01.2023	\$ 757	€ 710	1	0	1	0,00
	03.2023	5.206	MXN 104.931	105	0	105	0,02
BRC	01.2023	€ 2.614	\$ 2.717	0	(74)	(74)	(0,01)
CBK	01.2023	HUF 181.615	474	0	(10)	(10)	0,00
	01.2023	BRL 2.883	549	3	0	3	0,00
	01.2023	\$ 4.591	€ 4.308	8	0	8	0,00
GLM	03.2023	35	MXN 689	0	0	0	0,00
	01.2023	541	BRL 2.883	5	0	5	0,00
	03.2023	MXN 103.972	\$ 5.058	0	(204)	(204)	(0,04)
JPM	04.2023	BRL 2.883	531	0	(5)	(5)	0,00
	01.2023	£ 16.649	20.104	74	0	74	0,01
	01.2023	\$ 43	CNY 300	0	0	0	0,00
MBC	03.2023	77	535	0	0	0	0,00
	01.2023	€ 131.486	\$ 137.804	0	(2.585)	(2.585)	(0,46)
	01.2023	¥ 119.600	878	0	(29)	(29)	(0,01)
MYI	01.2023	\$ 5.689	€ 5.353	26	0	26	0,01
	01.2023	817	¥ 110.600	22	0	22	0,00
	05.2023	CNH 16.100	\$ 2.399	50	0	50	0,01
UAG	01.2023	AUD 132	88	0	(1)	(1)	0,00
	01.2023	€ 4	5	0	0	0	0,00
	01.2023	£ 288	354	7	0	7	0,00
UAG	01.2023	\$ 554	€ 519	0	0	0	0,00
	01.2023	870	£ 722	0	(2)	(2)	0,00
	02.2023	IDR 387.962	\$ 24	0	(1)	(1)	0,00
	05.2023	\$ 2.324	CNH 16.104	26	0	26	0,01
				\$ 333	\$ (2.946)	\$ (2.613)	(0,46)

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend II, Class E EUR (Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	01.2023	€ 7.979	\$ 8.506	\$ 0	\$ (14)	\$ (14)	0,00
BOA	01.2023	388	409	0	(5)	(5)	0,00
BPS	01.2023	30	32	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 84	€ 78	0	0	0	0,00
CBK	01.2023	€ 1.490	\$ 1.577	0	(14)	(14)	(0,01)
	01.2023	\$ 55.559	€ 53.571	1.639	0	1.639	0,29
MBC	01.2023	€ 1.099	\$ 1.169	0	(4)	(4)	0,00
	01.2023	\$ 71.820	€ 68.417	1.231	0	1.231	0,22
SCX	01.2023	59.966	57.613	1.547	0	1.547	0,27
				\$ 4.417	\$ (37)	\$ 4.380	0,77

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Diversified Income Duration Hedged Fund (Forts.)

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend und Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens		
BOA	01.2023	£ 89	\$ 108	\$ 1	\$ 0	\$ 1	0,00		
	01.2023	\$ 2	£ 2	0	0	0	0,00		
BPS	01.2023	£ 4	\$ 5	0	0	0	0,00		
BRC	01.2023	722	869	1	0	1	0,00		
JPM	01.2023	\$ 98.171	£ 81.299	0	(360)	(360)	(0,06)		
MBC	01.2023	£ 3	\$ 3	0	0	0	0,00		
	01.2023	\$ 98.435	£ 82.047	392	(118)	274	0,05		
MYI	01.2023	13	11	0	0	0	0,00		
TOR	01.2023	97.725	81.283	65	0	65	0,01		
UAG	01.2023	£ 32	\$ 39	1	0	1	0,00		
	01.2023	\$ 7	£ 6	0	0	0	0,00		
						\$ 460	\$ (478)	\$ (18)	0,00
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						\$ 1.696		0,30	
Summe Anlagen						\$ 574.370		101,72	
Sonstige Aktiva und Passiva						\$ (9.686)		(1,72)	
Nettovermögen						\$ 564.684		100,00	

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

- * Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt
- ^ Das Wertpapier ist in Verzug.
- (a) Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.
- (b) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.
- (c) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.
- (d) Nullkuponwertpapier.
- (e) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.
- (f) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.
- (g) Mit dem Fonds verbunden.
- (h) Bedingt wandelbares Wertpapier.
- (i) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2021: 0,10 %):

Emittentenbeschreibung	Kaufdatum	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
ADLER Group S.A.	22.12.2022	\$ 385	\$ 385	0,07
Constellation Oil Services Holding S.A. 'B'	06.10.2022	18	18	0,00
Corestate Capital Holding S.A. 8,000 % fällig am 15.04.2023	06.12.2022	210	214	0,04
Intelsat Emergence S.A.	24.02.2020 - 01.05.2020	1.289	346	0,06
		\$ 1.517	\$ 578	0,17

Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von 0 USD (31. Dezember 2021: 4.551 USD) und Barmittel in Höhe von 0 USD (31. Dezember 2021: 64 USD) wurden gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen zum 31. Dezember 2022 als Sicherheiten verpfändet.

Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von 0 USD (31. Dezember 2021: 2.760 USD) und Barmittel in Höhe von 1.278 USD (31. Dezember 2021: 0 USD) wurden gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. zum 31. Dezember 2022 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 19.045 USD (31. Dezember 2021: 46.051 USD) wurden zum 31. Dezember 2022 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 399.799	\$ 1.785	\$ 401.584
Investmentfonds	55.254	552	0	55.806
Pensionsgeschäfte	0	102.832	0	102.832
Finanzderivate ⁽³⁾	1.425	12.723	0	14.148
Summen	\$ 56.679	\$ 515.906	\$ 1.785	\$ 574.370

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

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 1.027	\$ 1.091.334	\$ 1.166	\$ 1.093.527
Investmentfonds	126.929	0	0	126.929
Pensionsgeschäfte	0	58.930	0	58.930
Finanzderivate ⁽³⁾	802	29.107	0	29.909
Summen	\$ 128.758	\$ 1.179.371	\$ 1.166	\$ 1.309.295

⁽¹⁾ Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

⁽²⁾ Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

⁽³⁾ Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung des Marktwerts der außerbörslich gehandelten Finanzderivate und (erhaltenen)/verpfändeten Sicherheiten nach Kontrahenten zum 31. Dezember 2022 und 31. Dezember 2021:

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2022			Zum 31. Dez. 2021		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾
AZD	\$ (14)	\$ 0	\$ (14)	\$ k. A.	\$ k. A.	\$ k. A.
BOA	(31)	0	(31)	(483)	332	(151)
BPS	104	0	104	6.091	(4.920)	1.171
BRC	(270)	208	(62)	(189)	272	83
CBK	1.636	(1.510)	126	(22)	0	(22)
DUB	k. A.	k. A.	k. A.	34	0	34
GLM	(204)	270	66	(1.312)	1.053	(259)
GST	(179)	0	(179)	(15)	0	(15)
HUS	k. A.	k. A.	k. A.	(1.286)	1.103	(183)
JPM	27	(80)	(53)	1.210	(1.030)	180
MBC	(1.015)	800	(215)	k. A.	k. A.	k. A.
MYC	k. A.	k. A.	k. A.	(1)	0	(1)
MYI	4	(28)	(24)	6	0	6
RBC	k. A.	k. A.	k. A.	1.320	(860)	460
SCX	1.547	(1.450)	97	2.595	(2.620)	(25)
SSB	k. A.	k. A.	k. A.	(6)	0	(6)
TOR	65	(120)	(55)	1.452	(1.140)	312
UAG	26	0	26	3.614	(2.420)	1.194

⁽¹⁾ Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2022:

	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	38,87	52,28
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	30,57	28,84
Sonstige übertragbare Wertpapiere	1,69	2,65
Investmentfonds	9,88	9,72
Pensionsgeschäfte	18,21	4,51
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,25	0,06
Zentral abgerechnete Finanzderivate	1,95	1,24
Freiverkehrsfinanzderivate	0,30	1,00
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	k. A.	(0,37)

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2022 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
Albanien	k. A.	0,07
Argentinien	0,45	0,63
Australien	k. A.	0,04
Österreich	k. A.	0,27
Weißrussland	0,05	0,05
Bermuda	0,54	0,52
Brasilien	0,00	0,45
Kanada	0,42	0,32
Kaimaninseln	2,11	3,02
Chile	0,09	0,14
China	0,08	0,37
Kolumbien	0,40	0,47
Zypern	0,17	k. A.
Dänemark	0,15	k. A.
Dominikanische Republik	0,38	0,62
Ecuador	0,24	0,27
Ägypten	0,59	0,72

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
Finnland	0,09	k. A.
Frankreich	3,32	3,85
Deutschland	3,45	2,93
Ghana	0,06	0,12
Guernsey, Kanalinseln	0,43	0,53
Hongkong	1,08	1,33
Indien	0,05	0,03
Indonesien	0,45	1,49
Irland	2,38	3,35
Insel Man	k. A.	0,29
Israel	k. A.	0,07
Italien	4,15	4,64
Elfenbeinküste	k. A.	0,28
Japan	1,11	0,86
Jersey, Kanalinseln	1,16	0,47
Jordanien	k. A.	0,06
Liberia	k. A.	0,11
Luxemburg	5,22	4,89
Mazedonien	0,05	0,06
Mauritius	0,13	0,11
Mexiko	1,67	2,03
Marokko	k. A.	0,03
Multinational	0,42	0,54
Niederlande	3,96	3,48
Nigeria	0,44	0,38
Oman	0,27	0,58
Panama	k. A.	0,16
Peru	k. A.	0,26
Katar	0,22	1,05
Rumänien	0,14	0,29
Russland	0,14	k. A.
Saudi-Arabien	k. A.	1,07
Serbien	k. A.	0,07
Slowenien	0,27	0,06
Südafrika	0,07	0,38
Spanien	0,62	0,36
Sri Lanka	0,09	0,09
Supranational	k. A.	0,06
Schweden	0,35	0,03
Schweiz	0,58	1,16
Tunesien	k. A.	0,03
Türkei	0,85	1,26
Ukraine	0,20	0,60
Vereinigte Arabische Emirate	0,15	0,30
Großbritannien	4,30	7,12
USA	22,26	19,04
Venezuela	0,07	0,02
Jungferinseln (Britisch)	0,08	0,04
Kurzfristige Instrumente	5,18	9,85
Investmentfonds	9,88	9,72
Pensionsgeschäfte	18,21	4,51
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,25	0,06
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen — Schutzverkauf	(0,12)	0,03
Credit Default Swaps auf Kreditindizes — Schutzverkauf	0,23	(0,01)
Zinsswaps	1,84	1,22
OTC Financial Derivative Instruments		
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes	0,00	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen — Schutzverkauf	(0,01)	0,03
Devisenterminkontrakte	(0,46)	(0,31)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,77	1,28
Sonstige Aktiva und Passiva	(1,72)	(0,30)
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE				DEUTSCHLAND UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				MULTINATIONALE UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
ARGENTINIEN STAATSEMISSIONEN				Deutsche Bank AG				American Airlines, Inc.			
Argentina Government International Bond				1,625 % fällig am 20.01.2027	€ 100	\$ 94	0,96	5,500 % fällig am 20.04.2026	\$ 50	\$ 48	0,49
3,500 % fällig am 09.07.2041	\$ 200	\$ 57	0,58	Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide	100	92	0,93				
				1,875 % fällig am 31.03.2028							
BRASILIEN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Schaeffler AG				NIEDERLANDE UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Banco BTG Pactual S.A.				3,375 % fällig am 12.10.2028	100	93	0,95	Citycon Treasury BV			
2,750 % fällig am 11.01.2026	200	182	1,85	ZF Finance GmbH	100	88	0,89	1,625 % fällig am 12.03.2028	€ 100	78	0,79
Natura Cosmeticos S.A.				2,000 % fällig am 06.05.2027				CTP NV			
4,125 % fällig am 03.05.2028	200	164	1,65	Summe Deutschland		367	3,73	1,250 % fällig am 21.06.2029	100	71	0,72
Summe Brasilien		346	3,50					NE Property BV			
				GUERNSEY, KANALINSELN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				3,375 % fällig am 14.07.2027			
				Globalworth Real Estate Investments Ltd.				Summe Niederlande			
				3,000 % fällig am 29.03.2025	100	94	0,95			242	2,45
KANADA UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				INDIEN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				OMAN STAATSEMISSIONEN			
Air Canada Pass-Through Trust				ReNew Power Pvt Ltd.				Man Government International Bond			
5,250 % fällig am 01.10.2030	75	71	0,72	5,875 % fällig am 05.03.2027	\$ 200	192	1,95	6,750 % fällig am 17.01.2048	\$ 200	188	1,91
				IRLAND UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				PANAMA STAATSEMISSIONEN			
				GE Capital UK Funding Unlimited Co.				Panama Government International Bond			
				5,875 % fällig am 18.01.2033	€ 100	122	1,24	6,700 % fällig am 26.01.2036	100	105	1,06
				ITALIEN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				PERU STAATSEMISSIONEN			
				Nexi SpA				Peru Government International Bond			
				2,125 % fällig am 30.04.2029	€ 100	87	0,88	3,300 % fällig am 11.03.2041	100	73	0,74
				ELFENBEINKÜSTE STAATSEMISSIONEN				RUMÄNIEN STAATSEMISSIONEN			
				Ivory Coast Government International Bond				Romania Government International Bond			
				6,625 % fällig am 22.03.2048	100	76	0,77	1,750 % fällig am 13.07.2030	€ 100	75	0,76
				JAPAN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				SINGAPUR UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
				Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.				Flex Ltd.			
				2,472 % fällig am 14.01.2029	\$ 200	169	1,71	4,875 % fällig am 15.06.2029	\$ 100	94	0,96
				JERSEY, KANALINSELN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				SPANIEN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
				G City Europe Ltd.				Abertis Infraestructuras S.A.			
				4,250 % fällig am 11.09.2025	€ 100	90	0,91	3,375 % fällig am 27.11.2026	€ 100	109	1,11
				LUXEMBURG UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Banco de Sabadell S.A.			
				Altice Financing S.A.				0,875 % fällig am 16.06.2028			
				4,250 % fällig am 15.08.2029	100	86	0,87	CaixaBank S.A.			
				Lincoln Financing SARL				3,750 % fällig am 07.09.2029			
				3,625 % fällig am 01.04.2024	100	106	1,08	Cellnex Finance Co. S.A.			
				Summe Luxemburg		192	1,95	2,000 % fällig am 15.09.2032	100	79	0,80
				MEXIKO STAATSEMISSIONEN				Schweden UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
				Mexico Government International Bond				EQT AB			
				5,750 % fällig am 12.10.2110	\$ 100	85	0,86	0,875 % fällig am 14.05.2031	100	74	0,75
				MAROKKO STAATSEMISSIONEN				GROSSBRITANNIEN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
				Morocco Government International Bond				Bellis Acquisition Co. PLC			
				4,000 % fällig am 15.12.2050	200	138	1,40	3,250 % fällig am 16.02.2026	€ 100	98	1,00
				AUS MEHREREN LÄNDERN STAMMENDE UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Berkeley Group PLC			
				NXP BV				2,500 % fällig am 11.08.2031			
				5,350 % fällig am 01.03.2026	100	100	1,01	HSBC Holdings PLC			
								3,973 % fällig am 22.05.2030	\$ 200	175	1,78
								Marks & Spencer PLC			
								4,500 % fällig am 10.07.2027	€ 100	104	1,06
								NatWest Group PLC			
								0,780 % fällig am 26.02.2030	€ 100	84	0,85
								Virgin Media Secured Finance PLC			
								4,125 % fällig am 15.08.2030	€ 100	92	0,93
								Vodafone Group PLC			
								5,125 % fällig am 04.06.2081	\$ 100	73	0,74
								Summe Großbritannien		707	7,18

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Diversified Income ESG Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	
USA												
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL												
Ally Financial, Inc. 8,000 % fällig am 01.11.2031	\$	100	1,06	HAT Holdings LLC 3,375 % fällig am 15.06.2026	100	87	0,88	Wells Fargo & Co. 4,540 % fällig am 15.08.2026	\$	100	1,00	
Aviation Capital Group LLC 5,500 % fällig am 15.12.2024	100	98	1,00	Hilton Domestic Operating Co., Inc. 3,625 % fällig am 15.02.2032	100	80	0,81			2.148	21,81	
Ball Corp. 2,875 % fällig am 15.08.2030	100	80	0,81	Ingevity Corp. 3,875 % fällig am 01.11.2028	100	86	0,87	US-REGIERUNGSBEHÖRDEN				
Boise Cascade Co. 4,875 % fällig am 01.07.2030	100	88	0,89	Level 3 Financing, Inc. 3,625 % fällig am 15.01.2029	100	73	0,74	Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fällig am 01.02.2053	200	197	2,00	
CCO Holdings LLC 4,250 % fällig am 01.02.2031	100	81	0,82	LPL Holdings, Inc. 4,000 % fällig am 15.03.2029	100	87	0,88	5,500 % fällig am 01.02.2053	200	201	2,04	
Clearway Energy Operating LLC 3,750 % fällig am 15.02.2031	100	83	0,84	Microsoft Corp. 2,675 % fällig am 01.06.2060	100	64	0,65			398	4,04	
CommScope Technologies LLC 6,000 % fällig am 15.06.2025	100	91	0,92	MSCI, Inc. 3,625 % fällig am 01.09.2030	50	42	0,43	US-SCHATZOBIGATIONEN				
Cross, Inc. 4,250 % fällig am 15.03.2029	100	85	0,86	SBA Communications Corp. 3,125 % fällig am 01.02.2029	100	83	0,84	U.S. Treasury Bonds 4,000 % fällig am 15.11.2042	175	171	1,74	
Dana, Inc. 4,250 % fällig am 01.09.2030	100	81	0,82	Southern California Edison Co. 2,500 % fällig am 01.06.2031	100	83	0,84	Summe USA		2.717	27,59	
DaVita, Inc. 4,625 % fällig am 01.06.2030	50	40	0,41	T-Mobile USA, Inc. 2,250 % fällig am 15.02.2026	100	91	0,92	KURZFRISTIGE INSTRUMENTE				
Deil International LLC 6,020 % fällig am 15.06.2026	100	102	1,04	United Airlines Pass-Through Trust 5,875 % fällig am 15.04.2029	79	78	0,79	HUNGARY TREASURY BILLS				
Edgewell Personal Care Co. 5,500 % fällig am 01.06.2028	100	94	0,96	VMware, Inc. 4,500 % fällig am 15.05.2025	100	98	1,00	18,250 % fällig am 03.01.2023 (a)(b)	HUF	4.000	11	0,11
								U.S. TREASURY BILLS				
								4,290 % fällig am 09.03.2023 (a)(b)	\$	1.400	1,389	14,10
								4,397 % fällig am 23.03.2023 (a)(b)	200	198	2,01	
								Summe kurzfristige Instrumente		1.598	16,22	
								Summe Übertragbare Wertpapiere	\$	9.978	101,26	

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

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablaufmonat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Canada Government 10-Year Bond March Futures	Long	03.2023	1	\$ (1)	(0,01)
Euro-Bobl March Futures	Short	03.2023	6	23	0,23
Euro-Schatz March Futures	Short	03.2023	1	1	0,01
U.S. Treasury 2-Year Note March Futures	Long	03.2023	1	0	0,00
U.S. Treasury 5-Year Note March Futures	Long	03.2023	6	(4)	(0,04)
U.S. Treasury 10-Year Note March Futures	Long	03.2023	5	(4)	(0,04)
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond March Futures	Long	03.2023	1	1	0,01
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond March Futures	Long	03.2023	3	(1)	(0,01)
United Kingdom Long Gilt March Futures	Short	03.2023	2	16	0,16
				\$ 31	0,31
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ 31	0,31

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

ZINSSWAPS

Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	2,000 %	15.03.2033	£ 95	\$ 2	0,02
Zahlung	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	2,000	15.03.2053	30	(1)	(0,01)
Erhalt	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	2,250	15.03.2028	150	5	0,05
Erhalt	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	2,500	15.03.2025	150	2	0,02
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,400	15.06.2032	¥ 10.000	2	0,02
					\$ 10	0,10
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					\$ 10	0,10

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

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

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2023	€ 19	\$ 20	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	01.2023	£ 522	628	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 114	€ 108	1	0	1	0,01
BRC	01.2023	CAD 4	\$ 3	0	0	0	0,00
	01.2023	£ 3	4	0	0	0	0,00
	01.2023	HUF 3.348	9	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 7	€ 7	0	0	0	0,00
	01.2023	£ 10	8	0	0	0	0,00
CBK	01.2023	€ 66	\$ 69	0	(1)	(1)	(0,01)
	01.2023	\$ 11	€ 10	0	0	0	0,00
SCX	01.2023	€ 2.258	\$ 2.350	0	(60)	(60)	(0,61)
	01.2023	\$ 4	€ 4	0	0	0	0,00
				\$ 1	\$ (61)	\$ (60)	(0,61)

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend und E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2023	\$ 2	€ 2	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
CBK	01.2023	90	87	2	0	2	0,03
GLM	01.2023	72	69	2	0	2	0,02
SCX	01.2023	82	78	2	0	2	0,02
				\$ 6	\$ 0	\$ 6	0,07

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilsklasse Institutional GBP (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2023	\$ 75	£ 63	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
BRC	01.2023	2	2	0	0	0	0,00
CBK	01.2023	76	62	0	(1)	(1)	(0,01)
SCX	01.2023	75	63	1	0	1	0,01
				\$ 1	\$ (1)	\$ 0	0,00

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ (54) (0,54)

Summe Anlagen

\$ 9.965 101,13

Sonstige Aktiva und Passiva

\$ (111) (1,13)

Nettovermögen

\$ 9.854 100,00

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

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

(a) Nullkuponwertpapier.

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

Barmittel in Höhe von 113 USD wurden zum 31. Dezember 2022 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 9.978	\$ 0	\$ 9.978
Finanzderivate ⁽³⁾	41	(54)	0	(13)
Summen	\$ 41	\$ 9.924	\$ 0	\$ 9.965

(1) Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

(2) Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

(3) Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2022		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾
BOA	\$ 1	\$ 0	\$ 1
GLM	2	0	2
SCX	(57)	0	(57)

⁽¹⁾ Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2022:

	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%) ⁽¹⁾
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	61,68	k. A.
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	39,58	k. A.
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,31	k. A.
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,10	k. A.
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,54)	k. A.

⁽¹⁾ Der Diversified Income ESG Fund wurde am 27. Juli 2022 aufgelegt.

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
Cigna Corp. 3,750 % fällig am 15.07.2023	\$ 794	\$ 789	0,02	Penske Truck Leasing Co. LP 3,950 % fällig am 10.03.2025	\$ 2.000	\$ 1.928	0,06	3,500 % fällig am 01.08.2050	\$ 300	\$ 187	0,01
Cloud Software Group Holdings, Inc. 6,500 % fällig am 31.03.2029	3.800	3.207	0,09	Petroleos Mexicanos 6,700 % fällig am 16.02.2032	4.981	3.921	0,11	3,500 % fällig am 15.03.2045 ^	500	356	0,01
Constellation Oil Services Holding S.A. 13,500 % fällig am 30.06.2025	341	339	0,01	Prosus NV 3,680 % fällig am 21.01.2030	600	500	0,01	4,550 % fällig am 01.07.2030	4.100	3.726	0,11
Constellation Oil Services Holding S.A. (3,000 % bar oder 4,000 % PIK) 3,000 % fällig am 31.12.2026 (c)	928	549	0,02	Sabine Pass Liquefaction LLC 4,200 % fällig am 15.03.2028	4.000	3.767	0,11	4,950 % fällig am 08.06.2025	1.500	1.478	0,04
Coty, Inc. 3,875 % fällig am 15.04.2026	€ 4.200	4.187	0,12	Sands China Ltd. 3,350 % fällig am 08.03.2029	900	737	0,02	5,450 % fällig am 15.06.2027	200	198	0,01
4,750 % fällig am 15.01.2029	\$ 2.000	1.813	0,05	3,750 % fällig am 08.08.2031	1.100	867	0,03	Rio Oil Finance Trust 9,250 % fällig am 15.04.2024	952	967	0,03
DAE Funding LLC 1,625 % fällig am 15.02.2024	2.500	2.374	0,07	5,900 % fällig am 08.08.2028	7.800	7.314	0,21	9,750 % fällig am 06.01.2027	785	817	0,02
DISH DBS Corp. 5,250 % fällig am 01.12.2026	1.000	844	0,02	Scripps Escrow, Inc. 5,375 % fällig am 15.01.2031	1.600	1.285	0,04	Southern California Gas Co. 2,950 % fällig am 15.04.2027	1.900	1.755	0,05
5,750 % fällig am 01.12.2028	2.000	1.600	0,05	Sixt SE 1,750 % fällig am 09.12.2024	€ 500	515	0,01	Southern Co. Gas Capital Corp. 2,450 % fällig am 01.10.2023	500	489	0,01
Exela Intermediate LLC 11,500 % fällig am 15.07.2026	1.126	197	0,01	Southern Co. 3,700 % fällig am 30.04.2030	\$ 400	362	0,01	Sprint LLC 7,125 % fällig am 15.06.2024	800	817	0,02
Expedia Group, Inc. 2,950 % fällig am 15.03.2031	540	436	0,01	Studio City Finance Ltd. 5,000 % fällig am 15.01.2029	600	444	0,01				
6,250 % fällig am 01.05.2025	2.069	2.088	0,06	Syngenta Finance NV 3,375 % fällig am 16.04.2026	€ 1.000	1.009	0,03	Summe Unternehmensanleihen und Wechsel		770.161	22,11
Ford Motor Co. 3,250 % fällig am 12.02.2032	1.300	977	0,03	T-Mobile USA, Inc. 2,250 % fällig am 15.11.2031	\$ 2.300	1.815	0,05	WANDELANLEIHEN UND WECHSEL			
Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide 2,125 % fällig am 09.07.2027	€ 1.900	1.820	0,05	2,300 % fällig am 15.02.2051	2.700	1.814	0,05	Royal Caribbean Cruises Ltd. 4,250 % fällig am 01.11.2023	5.000	4.986	0,14
Global Payments, Inc. 5,300 % fällig am 15.08.2029	\$ 1.800	1.744	0,05	3,875 % fällig am 15.04.2030	4.200	3.814	0,11	Southwest Airlines Co. 1,250 % fällig am 01.05.2025	7.500	9.036	0,26
GN Store Nord A/S 0,875 % fällig am 25.11.2024	€ 3.400	3.268	0,09	TD SYNTEX Corp. 2,375 % fällig am 09.08.2028	5.800	4.690	0,13			14.022	0,40
Grifols Escrow Issuer S.A. 3,875 % fällig am 15.10.2028	3.100	2.799	0,08	TDF Infrastructure SASU 1,750 % fällig am 01.12.2029	€ 6.400	5.199	0,15	KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL			
GSK Consumer Healthcare Capital U.S. LLC 3,375 % fällig am 24.03.2029	\$ 1.850	1.667	0,05	Tesco Corporate Treasury Services PLC 0,875 % fällig am 29.05.2026	2.200	2.129	0,06	California State General Obligation Bonds, (BABs), (AGM/CR Insured), Series 2010 6,875 % fällig am 01.11.2026	2.345	2.521	0,07
GSK Consumer Healthcare Capital UK PLC 3,125 % fällig am 24.03.2025	3.000	2.856	0,08	Toyota Tsusho Corp. 3,625 % fällig am 13.09.2023	\$ 3.400	3.362	0,10	Commonwealth of Puerto Rico General Obligation Bonds, Series 2022 0,000 % fällig am 01.11.2043	40	17	0,00
HCA, Inc. 5,375 % fällig am 01.09.2026	900	891	0,03	United Airlines Pass-Through Trust 5,875 % fällig am 15.04.2029	3.399	3.356	0,10	Golden State, California Tobacco Securitization Corp. Revenue Notes, Series 2021 1,337 % fällig am 01.06.2023	3.400	3.351	0,10
Hilton Domestic Operating Co., Inc. 3,750 % fällig am 01.05.2029	300	260	0,01	United Airlines, Inc. 4,625 % fällig am 15.04.2029	200	175	0,01	1,711 % fällig am 01.06.2024	1.900	1.809	0,05
4,000 % fällig am 01.05.2031	3.200	2.684	0,08	Venture Global Calcasieu Pass LLC 3,875 % fällig am 01.11.2033	6.400	5.240	0,15	Illinois State General Obligation Bonds, (BABs), Series 2010 7,350 % fällig am 01.07.2035	696	733	0,02
Hilton Grand Vacations Borrower Escrow LLC 5,000 % fällig am 01.06.2029	4.000	3.445	0,10	Virgin Media Secured Finance PLC 4,250 % fällig am 15.01.2030	€ 4.000	3.754	0,11	Tobacco Settlement Finance Authority, West Virginia Revenue Bonds, Series 2007 0,000 % fällig am 01.06.2047 (e)	23.300	1.735	0,05
Holding d'Infrastructures des Metiers de l'Environnement 0,125 % fällig am 16.09.2025	€ 1.600	1.509	0,04	Vmed O2 UK Financing PLC 4,500 % fällig am 15.07.2031	2.800	2.587	0,07	Tobacco Settlement Finance Authority, West Virginia Revenue Bonds, Series 2020 3,151 % fällig am 01.06.2032	1.500	1.204	0,04
0,625 % fällig am 16.09.2028	2.200	1.843	0,05	Wabtec Transportation Netherlands BV 1,250 % fällig am 03.12.2027	€ 4.600	4.174	0,12	3,301 % fällig am 01.06.2033	800	635	0,02
IHO Verwaltungs GmbH (3,750 % bar oder 4,500 % PIK) 3,750 % fällig am 15.09.2026 (c)	3.200	2.979	0,09	Warnmedia Holdings, Inc. 3,528 % fällig am 15.03.2024	\$ 3.100	3.006	0,09			12.005	0,35
Imperial Brands Finance Netherlands BV 1,750 % fällig am 18.03.2033	1.700	1.282	0,04	WMG Acquisition Corp. 2,250 % fällig am 15.08.2031	€ 2.300	1.930	0,06	US-REGIERUNGSBEHÖRDEN			
Imperial Brands Finance PLC 2,125 % fällig am 12.02.2027	2.500	2.407	0,07	Wynn Macau Ltd. 5,500 % fällig am 01.10.2027	\$ 400	368	0,01	Fannie Mae 0,000 % fällig am 25.09.2060 (a)	14.498	1.187	0,03
Intelsat Jackson Holdings S.A. 6,500 % fällig am 15.03.2030	\$ 1.406	1.260	0,04		200	175	0,01	0,471 % fällig am 25.07.2042 (a)	21.247	287	0,01
JetBlue Pass-Through Trust 2,750 % fällig am 15.11.2033	173	143	0,00	VERSORGUNGSUNTERNEHMEN				0,614 % fällig am 25.06.2042 (a)	16.533	212	0,01
Kraft Heinz Foods Co. 5,000 % fällig am 15.07.2035	73	70	0,00	AES Corp. 2,450 % fällig am 15.01.2031	2.200	1.755	0,05	1,511 % fällig am 25.12.2056 (a)	3.863	500	0,01
Las Vegas Sands Corp. 3,900 % fällig am 08.08.2029	200	169	0,01	CK Hutchison Group Telecom Finance S.A. 1,500 % fällig am 17.10.2031	€ 2.500	2.052	0,06	1,661 % fällig am 25.07.2059 (a)	9.382	1.178	0,03
Lendlease Europe Finance PLC 3,500 % fällig am 02.12.2033	€ 2.200	1.701	0,05	2,625 % fällig am 17.10.2034	€ 2.500	2.039	0,06	1,711 % fällig am 25.07.2050 (a)	4.460	445	0,01
Melco Resorts Finance Ltd. 5,375 % fällig am 04.12.2029	\$ 200	161	0,00	Entergy Corp. 2,400 % fällig am 15.06.2031	\$ 300	239	0,01	1,761 % fällig am 25.07.2043 (a)	1.148	127	0,00
Mileage Plus Holdings LLC 6,500 % fällig am 20.06.2027	5.940	5.919	0,17	Georgia Power Co. 4,700 % fällig am 15.05.2032	1.200	1.161	0,03	1,795 % fällig am 01.12.2034	2	2	0,00
MPH Acquisition Holdings LLC 5,500 % fällig am 01.09.2028	3.300	2.581	0,07	NextEra Energy Capital Holdings, Inc. 4,625 % fällig am 15.07.2027	350	345	0,01	1,811 % fällig am 25.05.2048 (a)	1.907	210	0,01
Nidec Corp. 0,046 % fällig am 30.03.2026	€ 1.100	1.049	0,03	ONEOK, Inc. 4,350 % fällig am 15.03.2029	100	93	0,00	2,000 % fällig am 25.11.2050 (a)	4.234	429	0,01
Nissan Motor Co. Ltd. 3,522 % fällig am 17.09.2025	\$ 7.500	6.974	0,20	Pacific Gas & Electric Co. 3,000 % fällig am 15.06.2028	2.400	2.079	0,06	2,051 % fällig am 25.11.2046 (a)	6.244	248	0,01
4,345 % fällig am 17.09.2027	1.700	1.544	0,04	3,150 % fällig am 01.01.2026	500	465	0,01	2,111 % fällig am 25.03.2042 (a)	7.397	761	0,02
4,810 % fällig am 17.09.2030	500	425	0,01	3,250 % fällig am 01.06.2031	2.400	1.957	0,06	2,211 % fällig am 25.11.2035 (a)	96	3	0,00
				3,300 % fällig am 01.12.2027 ^	3.000	2.653	0,07	2,236 % fällig am 25.06.2043 (a)	5.489	365	0,01
				3,500 % fällig am 15.06.2025 ^	200	189	0,01	2,241 % fällig am 25.10.2039 (a)	1.805	40	0,00
								2,462 % fällig am 01.02.2035	4	4	0,00
								2,889 % fällig am 01.11.2042	11	11	0,00
								4,000 % fällig am 25.06.2050 (a)	6.090	1.233	0,04
								4,509 % fällig am 25.03.2034	30	30	0,00
								4,519 % fällig am 25.11.2031	11	11	0,00
								4,529 % fällig am 25.02.2032	25	25	0,00
								4,559 % fällig am 25.11.2032	8	8	0,00
								4,739 % fällig am 25.03.2037	19	19	0,00
								4,789 % fällig am 18.10.2030 - 25.09.2032	6	5	0,00
								8,475 % fällig am 25.03.2036	286	312	0,01
								Freddie Mac 0,217 % fällig am 15.08.2042	1.062	721	0,02
								1,500 % fällig am 25.12.2035 (a)	8.832	401	0,01

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Dynamic Bond Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS			
4,509 % fällig am 25.11.2036	\$ 271	\$ 78	0,00	Peru Government International Bond				KURZFRISTIGE SCHULDITITEL						
4,559 % fällig am 25.07.2037	809	682	0,02	5,940 % fällig am 12.02.2029	PEN	16.700	4,020	0,12	Federal Home Loan Bank					
4,559 % fällig am 25.08.2037	2.282	1.961	0,06	6,350 % fällig am 12.08.2028		8.300	2,071	0,06	4,310 % fällig am 04.01.2023	\$ 32.300	32.300	0,93		
4,599 % fällig am 25.06.2037	2.794	2.001	0,06	8,200 % fällig am 12.08.2026		11.900	3,268	0,09	4,320 % fällig am 24.01.2023	35.200	35.200	1,01		
4,669 % fällig am 25.06.2037	4.025	2.883	0,08	Provincia de Buenos Aires					4,325 % fällig am 06.02.2023	35.000	35.001	1,00		
4,949 % fällig am 25.10.2036	408	394	0,01	72,913 % fällig am 12.04.2025 (a)	ARS	315.510	874	0,03	4,340 % fällig am 10.02.2023	32.600	32.601	0,94		
5,094 % fällig am 25.12.2036	34	34	0,00	Republic of Greece Government International Bond					4,345 % fällig am 23.02.2023	23.700	23.701	0,68		
5,289 % fällig am 25.10.2037	5.142	4.015	0,12	1,875 % fällig am 24.01.2052	€	1.700	1,038	0,03			158.803	4,56		
Specialty Underwriting & Residential Finance Trust				3,500 % fällig am 30.01.2023		154	165	0,01	HUNGARY TREASURY BILLS					
3,546 % fällig am 25.09.2037	483	170	0,01	3,750 % fällig am 30.01.2028	€	360	\$ 384	0,01	18,250 % fällig am 03.01.2023 (e)(f)	HUF	8.175.000	21.787	0,63	
3,595 % fällig am 25.02.2037 ^	1.542	616	0,02	3,900 % fällig am 30.01.2033 (k)		2.035	2,077	0,06	JAPAN TREASURY BILLS					
4,353 % fällig am 25.12.2036	1.083	1.026	0,03	4,000 % fällig am 30.01.2037		1.120	1,122	0,03	(0,190) % fällig am 20.03.2023 (e)(f)	¥	10.600.000	\$ 80.366	2,31	
St. Paul's CLO DAC				Romania Government International Bond		5.100	3,803	0,11	(0,162) % fällig am 23.01.2023 (e)(f)		8.650.000	65.564	1,88	
2,128 % fällig am 15.01.2032	€ 1.298	1.357	0,04	1,750 % fällig am 13.07.2030					(0,151) % fällig am 23.01.2023 (e)(f)		10.000.000	75.797	2,17	
Structured Asset Investment Loan Trust				4,250 % fällig am 23.06.2027 ^	\$	400	140	0,00				221.727	6,36	
5,364 % fällig am 25.01.2035	\$ 4.602	4.148	0,12	4,750 % fällig am 21.05.2026 ^		400	140	0,00	U.S. TREASURY BILLS					
5,514 % fällig am 25.01.2035	418	359	0,01	5,250 % fällig am 23.06.2047 ^		800	296	0,01	3,568 % fällig am 24.01.2023 (e)(f)	\$	13.200	13.170	0,39	
5,964 % fällig am 25.01.2035	456	349	0,01	5,625 % fällig am 04.04.2042 ^		200	127	0,00	4,317 % fällig am 09.03.2023 (e)(f)		8.100	8.038	0,23	
6,114 % fällig am 25.01.2035 ^	311	113	0,00	South Africa Government International Bond								21.208	0,62	
Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust				4,850 % fällig am 30.09.2029	10.100	9.040	9,040	0,26					435.201	12,50
4,544 % fällig am 25.09.2036	7.470	4.723	0,14	10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR	894.100	55.553	1,60	Summe kurzfristige Instrumente					
4,569 % fällig am 25.01.2037	858	502	0,01	Turkey Government International Bond										
4,889 % fällig am 25.11.2037	2.220	2.051	0,06	5,750 % fällig am 22.03.2024	\$	1.800	1.788	0,05						
5,394 % fällig am 25.11.2035	6.700	6.565	0,19	6,350 % fällig am 10.08.2024		9.400	9.312	0,27	Summe Übertragbare Wertpapiere		\$ 2.712.201	77,87		
5,620 % fällig am 25.04.2035	76	74	0,00											
Structured Asset Securities Corp. Trust				AKTIEN										
5,079 % fällig am 25.09.2035	4.368	4.133	0,12	ENERGIE										
Symphony CLO Ltd.				Constellation Oil Services Holding S.A. 'B' (d)(j)	1.038.200	113	0,00							
4,959 % fällig am 15.04.2028	495	491	0,01	FINANZWERTE										
TICP CLO Ltd.				Intelsat Emergence S.A. (d)(j)	19.324	464	0,01							
5,083 % fällig am 20.04.2028	2.570	2.563	0,07	National Bank of Greece S.A. (d)	307.710	1.230	0,04							
Tikehau CLO DAC						1.694	0,05							
2,596 % fällig am 04.08.2034	€ 500	518	0,02	RECHTE										
Toro European CLO DAC				Constellation Oil Services Holding S.A. - Exp. 05.12.2025	4.046	29	0,00							
2,239 % fällig am 12.01.2032	6.200	6.375	0,18	OPTIONSSCHEINE										
2,298 % fällig am 15.07.2030	668	700	0,02	Constellation Oil Services Holding S.A. - Exp. 10.06.2071 (j)	1	0	0,00							
Triaxx Prime CDO Ltd.				VORZUGSWERTPAPIERE										
4,402 % fällig am 02.10.2039	\$ 1.842	47	0,00	Nationwide Building Society 10,250 %	38.168	5.750	0,17							
Voya Euro CLO DAC														
2,128 % fällig am 15.10.2030	€ 2.249	2.350	0,07	AKTIEN										
WaMu Asset-Backed Certificates WaMu Trust				INVESTMENTFONDS										
4,539 % fällig am 25.01.2037	\$ 10.154	4.671	0,13	ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN										
4,614 % fällig am 25.05.2037	3.442	3.135	0,09	PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Asia Strategic Interest Bond Fund (h)	1.496.908	13.173	0,38							
Washington Mutual Asset-Backed Certificates Trust				PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO Asia High Yield Bond Fund (h)	770.713	7.037	0,20							
4,689 % fällig am 25.05.2036	870	670	0,02	PIMCO Funds: Global Investors Series plc - US Short-Term Fund (h)	9.356.514	93.378	2,68							
4,869 % fällig am 25.05.2036	711	550	0,02	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (h)	10.402.960	103.551	2,97							
Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust						217.139	6,23							
4,689 % fällig am 25.04.2037	2.967	2.017	0,06	BÖRSENGEHANDELTE FONDS										
6,114 % fällig am 25.11.2035	6.389	6.259	0,18	PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (h)	1.328.250	131.583	3,77							
Willow Park CLO DAC														
2,218 % fällig am 15.01.2031	€ 1.000	1.043	0,03	Summe Investmentfonds		\$ 348.722	10,00							
		627.110	18,00											
STAATSEMISSIONEN				AKTIEN										
Argentina Government International Bond				INVESTMENTFONDS										
0,500 % fällig am 09.07.2030	\$ 3.875	1.007	0,03	ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN										
1,000 % fällig am 09.07.2029	483	129	0,00	PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Asia Strategic Interest Bond Fund (h)	1.496.908	13.173	0,38							
1,500 % fällig am 09.07.2035	10.189	2.570	0,07	PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO Asia High Yield Bond Fund (h)	770.713	7.037	0,20							
15,500 % fällig am 17.10.2026	ARS 17.300	14	0,00	PIMCO Funds: Global Investors Series plc - US Short-Term Fund (h)	9.356.514	93.378	2,68							
Argentina Treasury Bond BONCER				PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (h)	10.402.960	103.551	2,97							
1,400 % fällig am 25.03.2023	1.179.122	3.581	0,10			217.139	6,23							
Israel Government International Bond				BÖRSENGEHANDELTE FONDS										
2,750 % fällig am 03.07.2030	\$ 4.000	3.643	0,11	PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (h)	1.328.250	131.583	3,77							
3,800 % fällig am 13.05.2060	4.600	3.618	0,10	Summe Investmentfonds		\$ 348.722	10,00							
Letras de la Nacion Argentina con Ajuste por CER														
0,000 % fällig am 19.05.2023 (e)	ARS 558.519	1.697	0,05											

PENSIONS-GESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft ⁽¹⁾	% des Netto-vermögens
BRC	4,270 %	03.01.2023	04.01.2023	\$ 535.400	Freddie Mac 4,000 % fällig am 01.07.2052	\$ (139.541)	\$ 535.400	\$ 535.464	15,37
					Ginnie Mae 2,500 % – 4,500 % fällig am 20.01.2052 – 20.12.2052	(413.154)			
	4,280	30.12.2022	03.01.2023	520.300	U.S. Treasury Bonds 3,125 % – 4,750 % fällig am 15.02.2041 – 15.05.2048	(529.681)	520.300	520.547	14,94
FICC	1,900	30.12.2022	03.01.2023	2.892	U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 08.06.2023	(2.950)	2.892	2.892	0,08
SAL	4,320	30.12.2022	03.01.2023	87.100	U.S. Treasury Notes 0,125 % fällig am 15.10.2023	(88.769)	87.100	87.142	2,50
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (1.174.095)	\$ 1.145.692	\$ 1.146.045	32,89

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Netto-vermögens
3-Month SOFR December Futures	Short	03.2024	2.110	\$ 9.921	0,29
Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 146,000 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond February 2023 Futures ⁽¹⁾	Short	01.2023	58	46	0,00
Euro-Bobl March Futures	Long	03.2023	453	(1.749)	(0,05)
Euro-BTP Italy Government Bond March Futures	Long	03.2023	658	(5.675)	(0,16)
Euro-Bund 10-Year Bond March Futures	Short	03.2023	546	4.907	0,13
Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 138.500 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond February 2023 Futures ⁽¹⁾	Short	01.2023	58	(297)	(0,01)
U.S. Treasury 2-Year Note March Futures	Long	03.2023	2.230	(2.345)	(0,07)
U.S. Treasury 5-Year Note March Futures	Long	03.2023	4.743	(973)	(0,03)
U.S. Treasury 10-Year Note March Futures	Long	03.2023	1.402	(1.479)	(0,04)
U.S. Treasury 30-Year Bond March Futures	Short	03.2023	573	(23)	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond March Futures	Long	03.2023	20	(3)	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond March Futures	Short	03.2023	877	621	0,02
				\$ 2.951	0,08

(1) Future-Style-Option.

VERKAUFSOPTIONEN**OPTIONEN AUF BÖRSEGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE**

Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Markt-wert	% des Netto-vermögens
Call – CME Kaufoptionen mit Ausübungskurs von USD 98,000 auf 3-Month SOFR December Futures	\$ 98,000	15.12.2023	4	\$ (3)	\$ (1)	0,00
Put – CME Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von USD 96,500 auf 3-Month SOFR December Futures	96,500	15.12.2023	4	(4)	(11)	0,00
				\$ (7)	\$ (12)	0,00
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate					\$ 2.939	0,08

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag ⁽³⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Netto-vermögens
AES Corp.	5,000 %	20.12.2025	\$ 500	\$ (39)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2024	5.300	24	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2026	3.000	(53)	0,00
Berkshire Hathaway, Inc.	1,000	20.03.2023	1.600	(23)	0,00
Boeing Co.	1,000	20.06.2023	6.100	(12)	0,00
Boeing Co.	1,000	20.06.2026	100	0	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20.12.2024	€ 7.000	26	0,00
General Electric Co.	1,000	20.06.2026	\$ 4.300	(20)	0,00
General Electric Co.	1,000	20.12.2026	400	(3)	0,00
Stellantis NV	5,000	20.06.2026	€ 3.000	(332)	(0,01)
Stellantis NV	5,000	20.12.2026	4.600	(423)	(0,01)
Tesco PLC	1,000	20.06.2028	4.300	(106)	(0,01)
Valeo S.A.	1,000	20.06.2026	1.000	(25)	0,00
Valeo S.A.	1,000	20.06.2028	400	(24)	0,00
				\$ (1.010)	(0,03)

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Dynamic Bond Fund (Forts.)

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF⁽²⁾

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽³⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.EM-33 5-Year Index	(1,000) %	20.06.2025	\$ 87	\$ (5)	0,00

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽³⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.HY-37 5-Year Index	5,000 %	20.12.2026	\$ 396	\$ (18)	0,00
CDX.HY-39 5-Year Index	5,000	20.12.2027	2.500	96	0,00
CDX.IG-35 5-Year Index	1,000	20.12.2025	200	(2)	0,00
CDX.IG-36 5-Year Index	1,000	20.06.2026	700	(8)	0,00
CDX.IG-39 5-Year Index	1,000	20.12.2027	3.500	26	0,00
iTraxx Crossover 38 5-Year Index	5,000	20.12.2027	€ 16.500	780	0,03
				\$ 874	0,03

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	0,500 %	07.02.2023	£ 63.600	\$ (905)	0,02
Zahlung ⁽⁴⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	2,000	15.03.2033	70.300	(677)	(0,02)
Erhalt ⁽⁴⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	2,250	15.03.2028	81.900	2.927	0,08
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	21.12.2052	\$ 24.100	1.610	0,05
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,853	18.05.2032	22.200	(2.910)	(0,08)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,857	15.07.2032	36.600	(4.781)	(0,15)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,350	14.12.2032	25.900	573	0,02
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,206	04.01.2027	BRL 13.900	(182)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,045	04.01.2027	136.700	(1.111)	(0,03)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,050	04.01.2027	126.600	(1.026)	(0,03)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,086	04.01.2027	82.400	(667)	(0,02)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,098	04.01.2027	126.200	(1.014)	(0,03)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,115	04.01.2027	271.000	(330)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,460	04.01.2027	145.000	(772)	(0,02)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,734	02.01.2025	127.000	(416)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,800	02.01.2025	128.000	(392)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,814	04.01.2027	76.300	(311)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,835	02.01.2025	129.000	(381)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,868	04.01.2027	68.000	(259)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,500	04.01.2027	185.800	(99)	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	2,000	14.11.2023	CAD 54.100	(1.129)	(0,03)
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	2,060	28.10.2023	516.600	(8.275)	(0,25)
Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	1,750	15.12.2026	KRW 160.467.700	(8.804)	(0,26)
Erhalt	3-Month KRW-KORIBOR	1,750	15.12.2031	81.913.000	8.176	0,23
Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	2,000	15.12.2026	67.230.600	(3.503)	(0,11)
Erhalt	3-Month KRW-KORIBOR	2,000	15.12.2031	35.676.700	3.288	0,09
Zahlung	3-Month NZD-BBR	3,000	01.11.2023	NZD 144.800	(1.979)	(0,06)
Zahlung	3-Month NZD-BBR	3,000	15.12.2023	203.200	(3.009)	(0,09)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,270	04.11.2023	\$ 345.100	(12.018)	(0,35)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,000	10.12.2029	40	5	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,250	20.06.2028	104.830	2.302	0,07
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,550	10.08.2024	€ 3.000	(129)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,650	12.04.2027	6.700	(687)	(0,02)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,650	11.05.2027	5.800	(592)	(0,02)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,700	11.04.2027	3.400	(341)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,000	13.05.2027	7.200	(637)	(0,02)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,000	18.05.2027	3.500	(309)	(0,01)
Zahlung ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	1,750	15.03.2033	41.720	(280)	(0,01)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	6,160	16.09.2027	PLN 93.100	100	0,00
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	6,210	26.04.2027	116.600	(772)	(0,02)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	6,240	23.09.2027	78.600	19	0,00
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	6,250	23.09.2027	55.300	8	0,00
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	6,270	20.09.2027	89.800	(2)	0,00
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	6,280	26.09.2027	26.700	(4)	0,00
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	6,310	19.09.2027	94.800	(38)	0,00
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	6,985	11.10.2027	113.000	(799)	(0,02)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	7,156	13.10.2027	58.300	(509)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIE	5,660	24.03.2023	MXN 435.510	(271)	(0,01)
					\$ (41.312)	(1,19)
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					\$ (41.453)	(1,19)

- (1) Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.
- (2) Agiert der Teilfonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Teilfonds entweder (i) vom Sicherungsgeber einen Betrag in Höhe des Nennwerts des Swaps und liefert die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er erhält einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.
- (3) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.
- (4) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

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

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

OPTIONSKAUF

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Receive	0,023 %	29.06.2023	17.500	\$ 931	\$ 3.831	0,11
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Receive	0,021	25.10.2023	7.600	434	1.916	0,06
FAR	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Receive	0,021	15.09.2023	12.200	640	2.944	0,08
MYC	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Receive	0,021	15.09.2023	12.800	696	3.154	0,09
							\$ 2.701	\$ 11.845	0,34

VERKAUFSOPTIONS

CREDIT DEFAULT SWAPPTIONS AUF KREDITINDIZES

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/-verkauf	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
GST	Put - OTC iTraxx Europe 37 5-Year Index	Verkauf	3,000 %	15.03.2023	17.200	\$ (30)	\$ (3)	0,00

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,021 %	29.06.2023	85.800	\$ (932)	\$ (6.729)	(0,19)
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,020	25.10.2023	38.000	(435)	(2.995)	(0,09)
BPS	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,550	31.03.2023	140.000	(234)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,100	31.03.2023	140.000	(308)	(2.149)	(0,06)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,700	28.04.2023	9.000	(16)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,250	28.04.2023	9.000	(16)	(128)	(0,01)
FAR	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,020	15.09.2023	61.000	(640)	(4.926)	(0,14)
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,018	20.10.2023	3.700	(24)	(4)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,018	20.10.2023	3.700	(24)	(47)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,140	23.10.2023	3.700	(26)	(5)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,140	23.10.2023	3.700	(26)	(44)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,190	23.10.2023	3.700	(26)	(6)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,190	23.10.2023	3.700	(26)	(42)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,225	23.10.2023	3.700	(26)	(6)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,225	23.10.2023	3.700	(26)	(41)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,973	25.10.2023	3.700	(25)	(4)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,973	25.10.2023	3.700	(25)	(48)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,841	27.10.2023	3.700	(25)	(4)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,841	27.10.2023	3.700	(25)	(52)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,250	07.12.2023	10.800	(34)	(9)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	07.12.2023	10.800	(34)	(75)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,500	07.02.2023	331.900	(1.145)	(9.893)	(0,29)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,700	26.04.2023	8.800	(15)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,250	26.04.2023	8.800	(15)	(125)	(0,01)
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,067	09.06.2023	12.800	(150)	(33)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	3,140	09.06.2023	12.800	(177)	(419)	(0,01)
MYC	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,020	15.09.2023	64.000	(696)	(5.230)	(0,15)
							\$ (5.151)	\$ (33.014)	(0,95)

OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.01.2053	\$ 101,891	05.01.2023	9.600	\$ (29)	\$ 0	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.02.2053	99,813	06.02.2023	3.000	(20)	(19)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.02.2053	100,000	06.02.2023	2.000	(14)	(14)	0,00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.02.2053	101,813	06.02.2023	3.000	(18)	(6)	0,00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.02.2053	102,000	06.02.2023	2.000	(12)	(4)	0,00
JPM	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.03.2053	97,000	06.03.2023	4.100	(35)	(63)	(0,01)
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.03.2053	99,000	06.03.2023	4.100	(30)	(10)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fällig am 01.03.2053	98,766	06.03.2023	3.400	(29)	(46)	0,00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fällig am 01.03.2053	100,766	06.03.2023	3.400	(24)	(11)	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Dynamic Bond Fund (Forts.)

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
SAL	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.01.2053	\$ 101,859	05.01.2023	5.200	\$ (16)	\$ 0	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.02.2053	99,750	06.02.2023	4.700	(33)	(29)	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.02.2053	101,750	06.02.2023	4.700	(27)	(11)	0,00
					\$ (287)	\$ (213)	(0,01)

(1) Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag ⁽²⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Turkey Government International Bond	1,000 %	20.12.2023	\$ 2.100	\$ (154)	\$ 104	\$ (50)	0,00
BRC	Turkey Government International Bond	1,000	20.12.2023	200	(13)	8	(5)	0,00
CBK	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2023	100	(6)	6	0	0,00
	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2024	100	(2)	2	0	0,00
GST	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2024	400	(6)	5	(1)	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.06.2024	15.500	(686)	657	(29)	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.06.2024	300	(37)	24	(13)	0,00
HUS	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2023	200	(6)	7	1	0,00
	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2024	1.700	(50)	49	(1)	0,00
JPM	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2023	200	(12)	13	1	0,00
MYC	California State General Obligation Bonds, Series 2003	1,000	20.09.2024	2.900	23	18	41	0,00
					\$ (949)	\$ 893	\$ (56)	0,00

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Kontrahent	Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag ⁽²⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
GST	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500 %	17.11.2059	\$ 800	\$ (24)	\$ 22	\$ (2)	0,00
MYC	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	11.000	(379)	355	(24)	0,00
UAG	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	10.900	(378)	354	(24)	0,00
					\$ (781)	\$ 731	\$ (50)	0,00

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

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

ZINSSWAPS

Kontrahent	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Erhalt	3-Month THB-THORON Compounded-OIS	1,000 %	15.12.2026	THB 3.038.630	\$ 3.969	\$ 33	\$ 4.002	0,11
	Zahlung	3-Month THB-THORON Compounded-OIS	1,500	15.12.2031	1.576.870	(3.599)	19	(3.580)	(0,10)
GLM	Erhalt	6-Month THB-THBFX	1,000	15.12.2026	3.356.200	245	4.218	4.463	0,13
	Zahlung	6-Month THB-THBFX	1,500	15.12.2031	1.728.000	(545)	(3.599)	(4.144)	(0,12)
						\$ 70	\$ 671	\$ 741	0,02

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2023	£ 315	\$ 389	\$ 10	\$ 0	\$ 10	0,00
	01.2023	HUF 325.540	831	0	(36)	(36)	0,00
	01.2023	PLN 4.737	1.080	1	0	1	0,00
	01.2023	\$ 817	PLN 3.619	7	0	7	0,00
	01.2023	ZAR 954	\$ 54	0	(2)	(2)	0,00
	02.2023	PEN 21.133	5.382	0	(140)	(140)	0,00
	02.2023	ZAR 70.456	3.931	0	(194)	(194)	(0,01)
BPS	01.2023	£ 247	298	1	0	1	0,00
	01.2023	HUF 1.437.424	3.761	0	(70)	(70)	0,00
	01.2023	PEN 7.605	1.968	0	(26)	(26)	0,00
	01.2023	\$ 181	ILS 620	0	(5)	(5)	0,00
	01.2023	ZAR 71	ZAR 1.230	1	0	1	0,00
	02.2023	ZAR 225.990	\$ 12.590	0	(646)	(646)	(0,02)
	03.2023	CLP 6.614.249	6.850	0	(830)	(830)	(0,02)
	03.2023	MXN 29.003	1.439	0	(29)	(29)	0,00
	03.2023	PEN 13.874	3.568	0	(46)	(46)	0,00
	03.2023	\$ 1.130	INR 93.753	0	(3)	(3)	0,00
	03.2023	ZAR 3.924	PEN 15.187	34	0	34	0,00

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens			
BRC	01.2023	CNH	\$	397	0	(4)	0,00			
	01.2023	HUF	\$	6.919	0	(152)	0,00			
	01.2023	PLN		1.534	0	(223)	(0,01)			
	01.2023	\$	£	942	0	(18)	0,00			
CBK	01.2023	1.616	PEN	6.226	13	0	0,00			
	01.2023	1.705	PLN	7.565	22	(3)	0,00			
	01.2023	6.666.741	\$	7.494	0	(325)	(0,01)			
	01.2023	€		4.483	0	(35)	0,00			
	01.2023	36.187	PLN	7.903	0	(342)	(0,01)			
	01.2023	\$	CLP	6.664.493	822	0	822	0,02		
	01.2023	1.815	€	1.745	49	0	49	0,00		
	01.2023	4.974	PLN	23.847	459	0	459	0,01		
	01.2023	1.364	ZAR	23.901	38	0	38	0,00		
	02.2023	NZD	\$	3.947	0	(170)	(170)	(0,01)		
	02.2023	PEN		10.571	0	(524)	(524)	(0,02)		
	02.2023	\$	BRL	106.815	329	0	329	0,01		
02.2023	7.494	CLP	6.703.462	331	0	331	0,01			
03.2023	PEN	\$	4.556	0	(85)	(85)	0,00			
04.2023	18.521		4.596	0	(219)	(219)	(0,01)			
04.2023	\$	PEN	6.724	67	0	67	0,00			
CLY	01.2023	HUF	\$	5.832	0	(252)	(0,01)			
	03.2023	\$	PEN	7.265	4	0	4	0,00		
DUB	02.2023	ZAR	\$	1.092	24	0	24	0,00		
	01.2023	CNH		413	0	(3)	(3)	0,00		
GLM	01.2023	HKD		162	0	0	0,00			
	01.2023	HUF		1.969	0	(80)	(80)	0,00		
	01.2023	PLN		236.064	0	(6.732)	(6,732)	(0,19)		
	01.2023	\$	PLN	28.782	455	0	455	0,01		
	01.2023	ZAR	\$	71.975	0	(198)	(198)	(0,01)		
	02.2023	\$	COP	10.180.350	0	(155)	(155)	0,00		
	03.2023	MXN	\$	43.610	0	(86)	(86)	0,00		
	05.2023	ZAR		32.040	1.917	0	54	0,00		
	01.2023	£		143.906	173.770	638	0	638	0,02	
	01.2023	HUF		136.259	348	0	(16)	(16)	0,00	
01.2023	\$	CNY	1.178	8.201	10	0	10	0,00		
02.2023	TWD	\$	339	11	0	0	0,00			
02.2023	ZAR		649	36	0	(2)	(2)	0,00		
03.2023	\$	CNY	2.116	14.639	12	0	12	0,00		
MBC	01.2023	CAD	\$	846	6	0	6	0,00		
	01.2023	DKK		3.305	0	(12)	(12)	0,00		
	01.2023	€		131.348	0	(2.552)	(2,552)	(0,07)		
	01.2023	£		123	150	0	2	0,00		
	01.2023	HKD		5.232	672	0	2	0,00		
	01.2023	\$	AUD	214	320	3	0	3	0,00	
	01.2023	6.012	¥	827.832	266	0	266	0,01		
	01.2023	2.412	PLN	11.784	273	0	273	0,01		
05.2023	813	CNH		5.456	0	(17)	(17)	0,00		
MYI	01.2023	€	\$	27	0	0	0,00			
	01.2023	£		714	860	1	1	0,00		
	01.2023	PLN		13.301	2.727	0	(303)	(0,01)		
	01.2023	\$	AUD	6.813	10.145	69	0	69	0,00	
	01.2023	7	€		6	0	0	0,00		
	01.2023	677	£		562	0	(1)	(1)	0,00	
	01.2023	28.819	¥	3.950.983	1.145	0	1.145	0,03		
	01.2023	2.156	PLN	10.712	285	0	285	0,01		
	02.2023	TWD	\$	627	21	0	0	0,00		
	01.2023	PLN		5.174	1.128	0	(51)	(51)	0,00	
01.2023	\$	AUD	78	117	1	0	1	0,00		
01.2023	1.048	£		868	0	(4)	(4)	0,00		
01.2023	55	ZAR		954	1	0	1	0,00		
03.2023	4	MXN		88	0	0	0,00			
04.2023	MXN	\$	20.661	997	0	(43)	(43)	0,00		
01.2023	€		9.901	10.495	0	(76)	(76)	0,00		
RYL	01.2023	416.834		433.861	0	(11.194)	(11,194)	(0,32)		
	01.2023	358.220		271	0	(14)	(14)	0,00		
SCX	01.2023	\$		458	AUD	680	3	0,00		
	01.2023	1.978		1.978	PEN	7.591	12	0,00		
	02.2023	NZD	\$	1.685		1.024	0	(42)	0,00	
	02.2023	TWD		3.794		123	0	(1)	(1)	0,00
	03.2023	\$		2.059	PEN	7.922	6	0	6	0,00
	03.2023	¥		10.600.000	\$	79.025	0	(2.124)	(2,124)	(0,06)
TOR	01.2023	18.650.000		128.371	0	(13.313)	(13,313)	(0,38)		
UAG	01.2023	HUF		545.760	1.423	0	(32)	(32)	0,00	
	01.2023	PLN		5.095	1.136	0	(25)	(25)	0,00	
	01.2023	\$	£	1.142	922	0	(32)	(32)	0,00	
	01.2023	2.698		2.698	ZAR	46.940	57	0	57	0,00
	01.2023	ZAR	\$	226.459	12.643	0	(650)	(650)	(0,02)	
03.2023	1.224		68	0	0	(3)	(3)	0,00		
				\$	5.513	\$	(42.140)	\$	(36.627)	(1,05)

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Dynamic Bond Fund (Forts.)

ABGESICHERTE DEVISETERMINKONTRÄKTE

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilsklasse Z AUD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
AZD	01.2023	AUD 54	\$ 36	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	01.2023	\$ 5.132	AUD 7.619	36	0	36	0,00
BOA	01.2023	20	29	0	0	0	0,00
	01.2023	AUD 101	\$ 68	0	(1)	(1)	0,00
CBK	01.2023	\$ 133	AUD 196	0	0	0	0,00
	01.2023	AUD 26	\$ 18	0	0	0	0,00
MBC	01.2023	\$ 1.780	AUD 2.655	21	0	21	0,00
	01.2023	5.511	8.206	55	0	55	0,01
RBC	01.2023	895	1.335	10	0	10	0,00
	01.2023	4.982	7.382	25	0	25	0,00
				\$ 147	\$ (1)	\$ 146	0,01

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilsklasse Institutional CAD (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
BOA	01.2023	\$ 2.930	CAD 3.961	\$ 0	\$ (6)	\$ (6)	0,00
	01.2023	2.093	2.829	0	(6)	(6)	0,00
MBC	01.2023	3.023	4.092	0	(2)	(2)	0,00
	01.2023	CAD 48	\$ 36	0	0	0	0,00
SCX	01.2023	\$ 839	CAD 1.128	0	(7)	(7)	0,00
					\$ 0	\$ (21)	\$ (21)

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional CHF (Hedged) thesaurierend und E CHF (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
BOA	01.2023	\$ 31.139	CHF 29.456	\$ 719	\$ 0	\$ 719	0,02
	01.2023	CHF 106	\$ 113	0	(1)	(1)	0,00
CBK	01.2023	\$ 52.517	CHF 49.623	1.153	0	1.153	0,03
	01.2023	CHF 71	\$ 75	0	(2)	(2)	0,00
MYI	01.2023	\$ 637	CHF 593	4	0	4	0,00
	01.2023	CHF 43	\$ 46	0	0	0	0,00
SCX	01.2023	\$ 54	CHF 50	0	0	0	0,00
					\$ 1.876	\$ (3)	\$ 1.873

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Investor EUR (Hedged) thesaurierend, Administrative EUR (Hedged) thesaurierend, E EUR (Hedged) thesaurierend und G Retail EUR (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
BOA	01.2023	€ 1.063	\$ 1.121	\$ 0	\$ (14)	\$ (14)	0,00
	01.2023	200	213	0	0	0	0,00
BPS	01.2023	\$ 124	€ 116	0	0	0	0,00
	01.2023	€ 5.368	\$ 5.604	0	(128)	(128)	0,00
CBK	01.2023	\$ 101.215	€ 97.603	2.997	0	2.997	0,09
	01.2023	€ 1.762	\$ 1.876	0	(5)	(5)	0,00
MBC	01.2023	\$ 101.154	€ 96.515	1.895	0	1.895	0,05
	01.2023	100.529	96.583	2.594	0	2.594	0,07
				\$ 7.486	\$ (147)	\$ 7.339	0,21

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend, Institutional GBP (Hedged) ausschüttend und E GBP (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
BOA	01.2023	£ 8.547	\$ 10.499	\$ 216	\$ 0	\$ 216	0,01
	01.2023	\$ 19.649	£ 16.319	0	(16)	(16)	0,00
BPS	01.2023	1.209	1.002	0	(4)	(4)	0,00
	01.2023	£ 219	\$ 264	0	0	0	0,00
BRC	01.2023	\$ 398	£ 331	0	0	0	0,00
	01.2023	168	138	0	(2)	(2)	0,00
CLY	01.2023	766.940	635.133	0	(2.816)	(2.816)	(0,08)
	01.2023	£ 234	\$ 287	5	0	5	0,00
JPM	01.2023	\$ 788.369	£ 657.612	3.298	(500)	2.798	0,08
	01.2023	3.935	3.222	0	(58)	(58)	0,00
MYI	01.2023	764.079	635.520	511	0	511	0,01
	01.2023	£ 920	\$ 1.131	24	0	24	0,00
TOR	01.2023	\$ 259	£ 209	0	(7)	(7)	0,00
					\$ 4.054	\$ (3.403)	\$ 651

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilsklasse Institutional NOK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BRC	01.2023	\$ 122	NOK 1.218	\$ 1	\$ 0	\$ 1	0,00
CBK	01.2023	136	1.346	1	0	1	0,00
MBC	01.2023	4	43	0	0	0	0,00
SCX	01.2023	139	1.382	1	0	1	0,00
TOR	01.2023	10	103	0	0	0	0,00
				\$ 3	\$ 0	\$ 3	0,00

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilsklasse Administrative SEK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2023	SEK 1.618	\$ 159	\$ 3	\$ 0	\$ 3	0,00
	01.2023	\$ 1	SEK 6	0	0	0	0,00
BRC	01.2023	1.843	19.303	10	0	10	0,00
CBK	01.2023	SEK 45	\$ 4	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 56	SEK 589	0	0	0	0,00
MBC	01.2023	SEK 110	\$ 11	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 3	SEK 34	0	0	0	0,00
MYI	01.2023	699	7.356	7	0	7	0,00
SCX	01.2023	SEK 182	\$ 18	0	0	0	0,00
UAG	01.2023	98	9	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 3.474	SEK 36.434	26	(1)	25	0,00
				\$ 46	\$ (1)	\$ 45	0,00
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						\$ (47.341)	(1,36)

LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖGENS
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN			
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA			
2,000 % fällig am 01.01.2053	\$ 70.458	\$ (57.348)	(1,65)
2,000 % fällig am 01.02.2053	30.442	(24.804)	(0,71)
Summe Leerverkaufte Wertpapiere		\$ (82.152)	(2,36)
Summe Anlagen		\$ 4.038.608	115,93
Sonstige Aktiva und Passiva		\$ (555.007)	(15,93)
Nettovermögen		\$ 3.483.601	100,00

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

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

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

- (a) Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.
- (b) Wertpapier per Emissionstermin.
- (c) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.
- (d) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.
- (e) Nullkuponwertpapier.
- (f) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.
- (g) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.
- (h) Mit dem Fonds verbunden.
- (i) Bedingt wandelbares Wertpapier.
- (j) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2021: 0,08 %):

Emittentenbeschreibung	Kauf- datum	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
ADLER Group S.A. 12,500 % fällig am 31.07.2025	22.12.2022	\$ 3.308	\$ 3.308	0,10
Constellation Oil Services Holding S.A. – Exp. 10.06.2071	10.06.2022	0	0	0,00
Constellation Oil Services Holding S.A. 'B'	10.06.2022	113	113	0,00
Deutsche Bank AG 0,898 % fällig am 28.05.2024	25.05.2021	1.900	1.778	0,05
Deutsche Bank AG 3,035 % fällig am 28.05.2032	25.05.2021	800	608	0,02
Intelsat Emergence S.A.	05.09.2018	2.000	464	0,01
Morgan Stanley 0,000 % fällig am 02.04.2032	29.07.2022	2.405	2.056	0,06
		\$ 10.526	\$ 8.327	0,24

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Dynamic Bond Fund (Forts.)

(k) Wertpapier mit einem Gesamtmarktwert von 2.041 USD (31. Dezember 2021: 4.463 USD) wurden gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen zum 31. Dezember 2022 als Sicherheiten verpfändet.

Barmittel in Höhe von 0 USD (31. Dezember 2021: 250 USD) wurden gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen zum 31. Dezember 2022 als Sicherheiten erhalten.

Barmittel in Höhe von 45.907 USD (31. Dezember 2021: 48.680 USD) wurden zum 31. Dezember 2022 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von 0 USD (31. Dezember 2021: 10.143 USD) und Barmittel in Höhe von 48.797 USD (31. Dezember 2021: 2.620 USD) wurden gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. zum 31. Dezember 2022 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 2.707.373	\$ 4.828	\$ 2.712.201
Investmentfonds	217.139	131.583	0	348.722
Pensionsgeschäfte	0	1.145.692	0	1.145.692
Finanzderivate ⁽³⁾	(2.766)	(83.089)	0	(85.855)
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(82.152)	0	(82.152)
Summen	\$ 214.373	\$ 3.819.407	\$ 4.828	\$ 4.038.608

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

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 2.891.918	\$ 8.148	\$ 2.900.066
Investmentfonds	318.072	0	0	318.072
Pensionsgeschäfte	0	9.965	0	9.965
Finanzderivate ⁽³⁾	616	(23.878)	0	(23.262)
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(262.976)	0	(262.976)
Summen	\$ 318.688	\$ 2.615.029	\$ 8.148	\$ 2.941.865

⁽¹⁾ Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

⁽²⁾ Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

⁽³⁾ Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions- geschäften	% des Nettovermögens
DBL	(0,500) %	01.12.2022	TBD ⁽¹⁾	€ (2.028)	\$ (2.164)	(0,06)
Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte					\$ (2.164)	(0,06)

⁽¹⁾ Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung des Marktwerts der außerbörslich gehandelten Finanzderivate und (erhaltenen)/verpfändeten Sicherheiten nach Kontrahenten zum 31. Dezember 2022 und 31. Dezember 2021:

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2022			Zum 31. Dez. 2021		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Nettoengagement ⁽¹⁾
AZD	\$ 36	\$ 0	\$ 36	\$ k. A.	\$ k. A.	\$ k. A.
BOA	(3.100)	3.170	70	408	(120)	288
BPS	(3.900)	3.880	(20)	731	(690)	41
BRC	(359)	320	(39)	8.264	(5.239)	3.025
CBK	4.410	(4.530)	(120)	(1.354)	1.451	97
CLY	(250)	0	(250)	k. A.	k. A.	k. A.
DBL	k. A.	k. A.	k. A.	20	0	20
DUB	24	(100)	(76)	(149)	0	(149)
FAR	(1.982)	1.690	(292)	(199)	290	91
FBF	k. A.	k. A.	k. A.	29	0	29
GLM	(17.283)	17.179	(104)	(4.744)	4.555	(189)
GSC	k. A.	k. A.	k. A.	(29)	0	(29)
GST	(48)	208	160	(99)	0	(99)
HUS	k. A.	k. A.	k. A.	(1.843)	1.483	(360)
JPM	(2.303)	310	(1.993)	8.674	(7.190)	1.484
MBC	2.683	(3.440)	(757)	k. A.	k. A.	k. A.
MYC	(2.059)	1.970	(89)	(48)	(699)	(747)
MYI	1.202	(910)	292	1.079	(480)	599

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2022			Zum 31. Dez. 2021		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Nettoengagement ⁽¹⁾
RBC	\$ (86)	\$ 60	\$ (26)	\$ 1.725	\$ (1.380)	\$ 345
RYL	(76)	0	(76)	(1)	0	(1)
SAL	(40)	0	(40)	(117)	290	173
SCX	(8.642)	8.280	(362)	(2.647)	2.654	7
SSB	(2.124)	1.540	(584)	k. A.	k. A.	k. A.
TOR	(12.777)	9.630	(3.147)	(3.468)	2.040	(1.428)
UAG	(667)	560	(107)	8.649	(6.430)	2.219

⁽¹⁾ Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2022:

	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	30,35	48,92
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	46,36	36,87
Sonstige übertragbare Wertpapiere	1,16	2,70
Investmentfonds	10,00	9,70
Pensionsgeschäfte	32,89	0,30
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,08	(0,01)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(1,19)	(1,16)
Freiverkehrsfinaanzderivate	(1,36)	0,45
Leerverkaufte Wertpapiere	(2,36)	(8,02)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(0,06)	(0,14)

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2022 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
Kreditbeteiligungen und -abtretung	1,91	2,47
Unternehmensanleihen und Wechsel	22,11	34,52
Wandelanleihen und Wechsel	0,40	0,50
Kommunalanleihen und Wechsel	0,35	0,44
US-Regierungsbehörden	8,36	2,49
US-Schatzobligationen	2,61	12,45
Non-Agency-MBS	8,21	6,38
Forderungsbesicherte Wertpapiere	18,00	16,61
Staatsemissionen	3,20	5,36
Stammaktien	0,05	0,03
Rechte	0,00	k. A.
Optionsscheine	0,00	k. A.
Vorzugswertpapiere	0,17	0,30
Kurzfristige Instrumente	12,50	6,94
Investmentfonds	10,00	9,70
Pensionsgeschäfte	32,89	0,30
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,08	(0,01)
Verkaufsoptionen		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	0,00	k. A.
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	(0,03)	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	0,00	(0,05)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,03	0,01
Zinsswaps	(1,19)	(1,12)
Freiverkehrsfinaanzderivate		
Optionskauf		
Zinsswapoptionen	0,34	0,07
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes	0,00	0,00
Zinsswapoptionen	(0,95)	(0,15)
Optionen auf Wertpapiere	(0,01)	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,00	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,00	0,01
Zinsswaps	0,02	0,01
Devisenterminkontrakte	(1,05)	(0,32)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,29	0,83
Leerverkaufte Wertpapiere	(2,36)	(8,02)
Sonstige Aktiva und Passiva	(15,93)	10,25
Nettovermögen	100,00	100,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Dynamic Multi-Asset Fund

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE											
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL											
BANKEN UND FINANZEN											
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. 5,875 % fällig am 24.09.2023 (e)(g)	€ 1.200	€ 1.157	0,02	Sumitomo Mitsui Banking Corp. 2,750 % fällig am 24.07.2023	€ 2.500	€ 2.502	0,05	Fingal Securities RMBS DAC 2,578 % fällig am 28.07.2055	€ 73	€ 73	0,00
Bank of America Corp. 0,750 % fällig am 26.07.2023	15.000	14.853	0,29			144.522	2,83	Formentera Issuer PLC 3,844 % fällig am 26.07.2047	€ 3.441	3.823	0,07
2,243 % fällig am 25.04.2024	4.500	4.501	0,09	INDUSTRIEWERTE				FWD Securitization Trust 2,240 % fällig am 25.01.2050	\$ 133	111	0,00
Barclays PLC 1,500 % fällig am 03.09.2023	7.000	6.933	0,14	Bacardi Ltd. 2,750 % fällig am 03.07.2023	1.000	998	0,02	GreenPoint Mortgage Funding Trust 4,629 % fällig am 25.10.2045	987	890	0,02
7,250 % fällig am 15.03.2023 (e)(g)	€ 1.200	1.340	0,03	BMW Finance NV 0,625 % fällig am 06.10.2023	900	886	0,01	GSMPS Mortgage Loan Trust 4,739 % fällig am 25.03.2035	2.064	1.825	0,03
7,750 % fällig am 15.09.2023 (e)(g)	\$ 2.400	2.201	0,04	Highland Holdings SARL 0,000 % fällig am 12.11.2023 (c)	5.200	5.050	0,10	HarborView Mortgage Loan Trust 4,048 % fällig am 19.10.2035	82	44	0,00
CaixaBank S.A. 6,750 % fällig am 13.06.2024 (e)(g)	€ 400	391	0,01	Medtronic Global Holdings S.C.A. 0,375 % fällig am 07.03.2023	300	299	0,01	4,749 % fällig am 19.12.2036	533	412	0,01
Cajamar Caja Rural SCC 0,875 % fällig am 18.06.2023	1.700	1.686	0,03	Smurfit Kappa Acquisitions ULC 2,875 % fällig am 15.01.2026	500	485	0,01	Harbour Energy PLC 3,844 % fällig am 28.01.2054	€ 1.579	1.752	0,03
Castellum AB 2,125 % fällig am 20.11.2023	2.600	2.498	0,05			7.718	0,15	Impac CMB Trust 5,029 % fällig am 25.03.2035	\$ 51	43	0,00
Commerzbank AG 0,125 % fällig am 09.01.2024	5.500	5.334	0,11	VERSORGUNGSUNTERNEHMEN				IndyMac Mortgage Loan Trust 3,274 % fällig am 25.06.2036	1.815	1.394	0,03
Credit Suisse AG 2,984 % fällig am 01.09.2023	5.000	4.916	0,10	Contemporary Ruiding Development Ltd. 1,875 % fällig am 17.09.2025	\$ 4.800	4.058	0,08	3,333 % fällig am 25.08.2037	2.847	1.809	0,03
6,500 % fällig am 08.08.2023 (g)	\$ 200	182	0,00	EDP - Energias de Portugal S.A. 2,375 % fällig am 27.11.2023	€ 300	299	0,01	4,749 % fällig am 25.02.2037 ^	79	65	0,00
Credit Suisse Group AG 6,250 % fällig am 18.12.2024 (e)(g)	400	295	0,01	Eurogrid GmbH 1,625 % fällig am 03.11.2023	3.000	2.971	0,05	4,969 % fällig am 25.01.2036	522	331	0,01
7,500 % fällig am 17.07.2023 (e)(g)	1.000	751	0,02	NextEra Energy Capital Holdings, Inc. 4,465 % fällig am 03.11.2023	\$ 8.250	7.699	0,15	JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 4,248 % fällig am 05.07.2033	1.000	877	0,02
7,500 % fällig am 11.12.2023 (e)(g)	2.000	1.641	0,03	1,000 % fällig am 20.06.2029	€ 700	571	0,01	5,372 % fällig am 05.07.2033	968	854	0,02
Deutsche Bank AG 1,125 % fällig am 30.08.2023	€ 1.600	1.583	0,03	Summe Unternehmensanleihen und Wechsel		15.598	0,30	Kentmere PLC 3,844 % fällig am 28.01.2042	€ 1.480	1.592	0,03
Digital Euro Finco LLC 2,500 % fällig am 16.01.2026	900	835	0,02			167.838	3,28	Lehman XS Trust 4,889 % fällig am 25.08.2037	\$ 1.796	1.506	0,03
DNB Boligkredit A/S 0,375 % fällig am 14.11.2023	3.800	3.713	0,07	WANDELANLEIHEN UND WECHSEL				Miravet SARL 2,758 % fällig am 26.05.2065	€ 3.050	2.948	0,06
Erste Group Bank AG 6,500 % fällig am 15.04.2024 (e)(g)	600	587	0,01	Luminar Technologies, Inc. 1,250 % fällig am 15.12.2026	\$ 17.000	9.020	0,18	Mortgage Equity Conversion Asset Trust 5,140 % fällig am 25.05.2042	\$ 127	104	0,00
Eurofima Europäische Gesellschaft fuer die Finanzierung von Eisenbahnmaterial 0,250 % fällig am 25.04.2023	5.000	4.969	0,10	Sunnova Energy International, Inc. 2,625 % fällig am 15.02.2028	5.400	4.111	0,08	New Residential Mortgage Loan Trust 4,500 % fällig am 25.05.2058	425	374	0,01
Europäische Finanzstabilisierungsfazilität 0,000 % fällig am 19.04.2024 (c)	15.000	14.455	0,28			13.131	0,26	Polaris PLC 4,222 % fällig am 23.12.2058	€ 1.375	1.512	0,03
Goldman Sachs Group, Inc. 2,732 % fällig am 07.02.2025	17.700	17.662	0,35	NON-AGENCY-MBS				4,732 % fällig am 23.05.2059	10.612	11.820	0,23
HSBC Holdings PLC 6,000 % fällig am 29.09.2023 (e)(g)	200	198	0,00	Adjustable Rate Mortgage Trust 3,623 % fällig am 25.04.2035	30	27	0,00	Precise Mortgage Funding PLC 4,587 % fällig am 12.12.2055	3.255	3.640	0,07
6,250 % fällig am 23.03.2023 (e)(g)	\$ 200	183	0,00	American Home Mortgage Assets Trust 6,750 % fällig am 25.11.2046	61	49	0,00	Residential Accredited Loans, Inc. Trust 2,644 % fällig am 25.10.2037	\$ 328	268	0,01
Intesa Sanpaolo SpA 2,125 % fällig am 30.08.2023	€ 11.400	11.364	0,22	BCAP LLC Trust 4,611 % fällig am 26.03.2037	332	303	0,01	6,500 % fällig am 25.07.2036	94	69	0,00
6,250 % fällig am 16.05.2024 (e)(g)	200	193	0,00	5,689 % fällig am 25.09.2047	173	140	0,00	Stanlington PLC 4,337 % fällig am 12.06.2045	€ 12.321	13.604	0,27
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0,000 % fällig am 15.09.2023 (c)	2.500	2.456	0,05	Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust 3,280 % fällig am 25.07.2036 ^	469	371	0,01	Towd Point Mortgage Funding PLC 3,826 % fällig am 20.07.2045	7.159	7.983	0,16
0,500 % fällig am 15.09.2027	10.000	8.897	0,17	Bear Stearns ALT-A Trust 3,580 % fällig am 25.09.2047 ^	5.302	2.611	0,05	4,071 % fällig am 20.10.2051	2.056	2.303	0,04
LeasePlan Corp. NV 0,125 % fällig am 13.09.2023	2.800	2.732	0,05	6,114 % fällig am 25.07.2034	840	770	0,01	4,190 % fällig am 20.02.2045	466	518	0,01
1,000 % fällig am 02.05.2023	5.100	5.066	0,10	Citigroup Mortgage Loan Trust 3,871 % fällig am 25.09.2037 ^	52	42	0,00	4,471 % fällig am 20.02.2054	564	633	0,01
Lloyds Banking Group PLC 1,000 % fällig am 09.11.2023	1.000	985	0,02	Countrywide Alternative Loan Trust 3,594 % fällig am 25.06.2037 ^	485	389	0,01	Tower Bridge Funding PLC 3,851 % fällig am 21.07.2064	718	802	0,02
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc. 2,504 % fällig am 30.05.2023	1.300	1.302	0,03	4,709 % fällig am 25.02.2047	58	47	0,00	4,051 % fällig am 20.11.2063	8.169	9.032	0,18
Mizuho Financial Group, Inc. 1,020 % fällig am 11.10.2023	2.500	2.460	0,05	4,989 % fällig am 25.08.2035	661	549	0,01	Tudor Rose Mortgages 4,031 % fällig am 20.06.2048	2.245	2.495	0,05
Nasdaq, Inc. 3,850 % fällig am 30.06.2026	\$ 100	91	0,00	4,983 % fällig am 20.12.2035	99	81	0,00	Twin Bridges PLC 4,386 % fällig am 12.09.2050	1.163	1.308	0,02
NatWest Group PLC 2,000 % fällig am 04.03.2025	€ 7.000	6.831	0,13	6,000 % fällig am 25.01.2037	264	144	0,00	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust 3,096 % fällig am 25.08.2046	\$ 8.416	6.020	0,12
2,500 % fällig am 22.03.2023	3.000	3.001	0,06	6,000 % fällig am 25.07.2037	106	53	0,00	3,290 % fällig am 25.02.2037 ^	36	30	0,00
NatWest Markets PLC 1,125 % fällig am 14.06.2023	1.100	1.093	0,02	Countrywide Asset-Backed Certificates Trust 4,869 % fällig am 25.04.2036 ^	351	275	0,01	5,189 % fällig am 25.06.2044	312	263	0,01
Societe Generale S.A. 7,875 % fällig am 18.12.2023 (e)(g)	\$ 1.200	1.116	0,02	Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust 3,726 % fällig am 25.11.2037	75	63	0,00			91.167	1,78
Standard Chartered PLC 7,750 % fällig am 02.04.2023 (e)(g)	600	559	0,01	4,969 % fällig am 25.04.2035	1.719	1.391	0,03	FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE			
Stichting AK Rabobank Certificaten 6,500 % (e)	€ 1.051	1.010	0,02	4,989 % fällig am 25.05.2035	152	110	0,00	Accredited Mortgage Loan Trust 5,259 % fällig am 25.09.2035	2.800	2.457	0,05
				6,000 % fällig am 25.07.2036	68	36	0,00	Accunia European CLO DAC 2,308 % fällig am 15.10.2030	€ 798	785	0,02
				6,500 % fällig am 25.12.2037	97	42	0,00	2,328 % fällig am 15.07.2030	1.248	1.224	0,02
				Countrywide Home Loan Reperforming REMIC Trust 4,310 % fällig am 25.01.2034 ^	637	480	0,01	ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust 4,689 % fällig am 25.04.2036	\$ 256	231	0,00
				Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust 4,529 % fällig am 19.10.2036	90	67	0,00	4,689 % fällig am 25.07.2036	237	83	0,00
								Adagio CLO DAC 2,098 % fällig am 15.10.2031	€ 2.500	2.437	0,05
								Aqueduct European CLO DAC 2,096 % fällig am 20.07.2030	3.500	3.431	0,07

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Dynamic Multi-Asset Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	AKTIEN	% DES		BESCHREIBUNG	AKTIEN	% DES		BESCHREIBUNG	AKTIEN	% DES		
		MARKT-WERT (000S)	NETTO-VERMÖGENS			MARKT-WERT (000S)	NETTO-VERMÖGENS			MARKT-WERT (000S)	NETTO-VERMÖGENS	
Regeneron Pharmaceuticals, Inc. (b)	60.700	€ 41.035	0,80	Infinion Technologies AG	519.200	€ 14.741	0,29	RECHTE				
Seagen, Inc. (b)	85.200	10.259	0,20	Intel Corp.	254.800	6.310	0,12	Hanwha Solutions Corp. – Exp. 09.01.2023	5.188	€ 19	0,00	
Shionogi & Co. Ltd.	335.250	15.589	0,31	Lam Research Corp.	71.670	28.225	0,55	REAL ESTATE INVESTMENT TRUSTS				
United Therapeutics Corp. (b)	94.600	24.649	0,48	LONGI Green Energy Technology Co. Ltd. 'A'	3.727.597	21.150	0,41	Weyerhaeuser Co.	462.700	13.440	0,26	
Vertex Pharmaceuticals, Inc. (b)	192.000	51.952	1,02	Marvell Technology, Inc.								
		404.296	7,91	MediaTek, Inc.	501.008	9.492	0,19	PARI (000S)				
INDUSTRIEWERTE				Micron Technology, Inc.	431.200	20.193	0,39	KURZFRISTIGE INSTRUMENTE				
ABB Ltd.	579.300	16.533	0,32	Nanya Technology Corp.	7.234.907	11.258	0,22	COMMERCIAL PAPER				
Aker Carbon Capture ASA (b)	9.186.261	10.046	0,20	NetApp, Inc.	529.300	29.787	0,58	Acciona Energia Financiacion Filiales S.A. 2,078 % fällig am 16.01.2023	€ 18.500	18.482	0,36	
Ballard Power Systems, Inc. (b)	527.600	2.364	0,05	Novatek Microelectronics Corp.	1.433.204	13.728	0,27	Agence France-Presse Ltd. 1,622 % fällig am 13.01.2023	2.000	1.998	0,04	
Contemporary Amperex Technology Co. Ltd. 'A'	119.700	6.320	0,12	NXP Semiconductors NV	118.400	17.532	0,34	Amtcor UK Finance PLC 1,937 % fällig am 01.02.2023	15.000	14.970	0,29	
Daifuku Co. Ltd.	207.900	9.032	0,18	Otsuka Corp.	238.400	7.003	0,14	Fidelity National Information Services, Inc. 1,774 % fällig am 09.01.2023	12.500	12.493	0,25	
FuelCell Energy, Inc. (b)	3.395.200	8.844	0,17	Power Integrations, Inc.	168.200	11.303	0,22	1,896 % fällig am 30.01.2023	16.000	15.971	0,31	
Generac Holdings, Inc. (b)	143.900	13.572	0,26	Realtek Semiconductor Corp.	1.102.407	9.394	0,18	Fiserv, Inc. 1,673 % fällig am 05.01.2023	6.200	6.198	0,12	
GXO Logistics, Inc. (b)	373.500	14.940	0,29	Samsung Electronics Co. Ltd.	926.700	38.113	0,75	National Grid PLC 1,825 % fällig am 09.01.2023	15.000	14.992	0,30	
Hitachi Zosen Corp.	3.432.700	19.991	0,39	Samsung SDI Co. Ltd.	28.771	12.658	0,25	1,825 % fällig am 12.01.2023	15.000	14.989	0,29	
ITM Power PLC (b)	4.480.333	4.641	0,09	Shimadzu Corp. (b)	290.800	7.673	0,15	Nomura Bank International PLC 2,078 % fällig am 28.02.2023	17.800	17.735	0,35	
Mitsubishi Electric Corp.	2.025.370	18.704	0,36	SMA Solar Technology AG	198.723	13.287	0,26	SGS Nederland Holding BV 2,099 % fällig am 30.01.2023	26.800	26.753	0,52	
NEL ASA (b)	11.600.925	15.310	0,30	SolarEdge Technologies, Inc. (b)	172.400	45.758	0,89	2,109 % fällig am 19.01.2023	17.500	17.487	0,34	
Plug Power, Inc. (b)	1.350.700	15.655	0,31	Synopsys, Inc. (b)	40.400	12.086	0,24	2,210 % fällig am 19.01.2023	12.800	12.786	0,25	
PowerCell Sweden AB (b)	384.763	4.137	0,08	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd.	3.499.809	47.626	0,93	Universal Music Group NV 2,099 % fällig am 13.02.2023	16.000	15.962	0,31	
Schneider Electric SE	189.600	24.874	0,49	Teradyne, Inc.	256.700	21.010	0,41				190.816	3,73
Secom Co. Ltd.	141.960	7.549	0,15	Texas Instruments, Inc.	33.200	5.140	0,10	BELGIUM TREASURY BILLS				
Sensata Technologies Holding PLC	456.276	17.264	0,34	Tokyo Electron Ltd.	82.670	22.639	0,44	1,641 % fällig am 09.03.2023 (c)(d)	8.150	8.124	0,16	
Siemens Energy AG (b)	852.300	14.950	0,29	Trend Micro, Inc.	90.500	3.945	0,08	1,642 % fällig am 09.03.2023 (c)(d)	8.150	8.124	0,16	
SMC Corp.	19.900	7.744	0,15	Trimble, Inc. (b)	163.000	7.722	0,15					
Taisei Corp.	231.200	6.948	0,14	Unimicron Technology Corp.	2.665.100	9.694	0,19	TREASURY BILLS DES EUROPÄISCHEN STABILITÄTSMECHANISMUS				
Titan Wind Energy Suzhou Co. Ltd. 'A'	3.180.147	6.461	0,13	United Microelectronics Corp.	19.904.819	24.505	0,48	0,253 % fällig am 19.01.2023 (c)(d)	30.900	30.879	0,60	
Valmet Oyj	896.500	22.608	0,44	Velodyne Lidar, Inc. (b)	1.683.500	1.165	0,02	0,274 % fällig am 19.01.2023 (c)(d)	15.300	15.290	0,30	
Vestas Wind Systems A/S	1.579.000	43.028	0,84	Xinyi Solar Holdings Ltd.	5.738.500	5.917	0,12	0,304 % fällig am 19.01.2023 (c)(d)	7.900	7.895	0,15	
Xinjiang Goldwind Science & Technology Co. Ltd. 'H'	16.245.200	13.494	0,26	Zebra Technologies Corp. 'A' (b)	82.200	19.749	0,39	0,578 % fällig am 13.04.2023 (c)(d)	17.500	17.395	0,34	
		325.009	6,35			838.256	16,40	0,929 % fällig am 05.01.2023 (c)(d)	4.700	4.700	0,09	
INFORMATIONSTECHNOLOGIE				BAUSTOFFE				1,441 % fällig am 23.03.2023 (c)(d)	3.000	2.987	0,06	
Advantest Corp.	323.200	19.292	0,38	Calix Ltd. (b)	1.188.128	3.355	0,07	1,541 % fällig am 09.02.2023 (c)(d)(h)	15.500	15.472	0,30	
Ambarella, Inc. (b)	308.000	23.731	0,46	Canfor Corp. (b)	1.004.500	14.803	0,29	1,754 % fällig am 09.03.2023 (c)(d)	11.800	11.763	0,23	
ams-OSRAM AG (b)	1.449.800	9.947	0,19	CF Industries Holdings, Inc.	78.500	6.267	0,12	1,755 % fällig am 09.03.2023 (c)(d)	14.750	14.703	0,29	
ANSYS, Inc. (b)	26.400	5.976	0,12	Hanwha Solutions Corp. (b)	605.600	19.403	0,38	1,760 % fällig am 09.03.2023 (c)(d)	14.750	14.703	0,29	
Applied Materials, Inc.	291.300	26.579	0,52	Holmen AB 'B'	512.100	19.099	0,37	1,876 % fällig am 20.04.2023 (c)(d)(h)	16.380	16.275	0,32	
Arista Networks, Inc. (b)	85.100	9.676	0,19	LG Chem Ltd.	74.200	33.200	0,65	2,212 % fällig am 18.05.2023 (c)(d)	14.195	14.071	0,28	
BE Semiconductor Industries NV	88.100	5.016	0,10	Mosaic Co.	102.600	4.217	0,08	2,231 % fällig am 18.05.2023 (c)(d)	25.160	24.941	0,49	
Canadian Solar, Inc. (b)	245.900	7.119	0,14	Nitto Denko Corp.	332.800	17.864	0,35				191.074	3,74
Chipbond Technology Corp.	5.933.908	10.366	0,20	Nutrien Ltd.	60.800	4.160	0,08	EUROPEAN UNION TREASURY BILLS				
Cirrus Logic, Inc. (b)	240.100	16.756	0,33	Shin-Etsu Chemical Co. Ltd.	222.460	25.317	0,49	0,233 % fällig am 06.01.2023 (c)(d)	54	54	0,00	
Cognex Corp.	112.723	4.976	0,10	Stora Enso Oyj 'R'	1.311.100	17.269	0,34	0,967 % fällig am 03.03.2023 (c)(d)	14.900	14.856	0,29	
Daqo New Energy Corp. (b)	311.100	11.255	0,22	thyssenkrupp AG (b)	1.531.800	8.690	0,17	1,034 % fällig am 03.03.2023 (c)(d)	4.230	4.218	0,08	
Delta Electronics, Inc.	1.865.112	16.200	0,32	UPM-Kymmene Oyj	958.400	33.504	0,66	1,369 % fällig am 03.03.2023 (c)(d)	5.700	5.683	0,11	
Disco Corp.	38.200	10.147	0,20	West Fraser Timber Co. Ltd.	276.700	18.708	0,37	1,402 % fällig am 03.03.2023 (c)(d)	30.100	30.012	0,59	
Elan Microelectronics Corp.	2.834.109	7.403	0,14			225.856	4,42	1,407 % fällig am 03.03.2023 (c)(d)	30.100	30.012	0,59	
Enphase Energy, Inc. (b)	113.700	28.228	0,55	VERSORGUNGSUNTERNEHMEN				1,587 % fällig am 07.04.2023 (c)(d)	11.100	11.041	0,21	
First Solar, Inc. (b)	342.400	48.056	0,95	Xinyi Energy Holdings Ltd.	26.358.479	8.166	0,16	1,632 % fällig am 03.03.2023 (c)(d)	13.750	13.710	0,27	
Flex Ltd. (b)	835.700	16.804	0,33			2.003.821	39,19	1,640 % fällig am 03.03.2023 (c)(d)	10.100	10.070	0,20	
Globalwafers Co. Ltd.	950.309	12.338	0,24					1,649 % fällig am 03.03.2023 (c)(d)	13.750	13.710	0,27	
GoerTek, Inc. 'A'	4.187.905	9.485	0,19					1,764 % fällig am 03.03.2023 (c)(d)	12.600	12.563	0,24	
Hamamatsu Photonics KK	275.800	12.268	0,24					1,866 % fällig am 07.04.2023 (c)(d)	8.200	8.157	0,16	
Ibiden Co. Ltd.	426.700	14.341	0,28					1,876 % fällig am 07.04.2023 (c)(d)	31.000	30.836	0,60	
											184.922	3,61
								FRANCE TREASURY BILLS				
								0,740 % fällig am 08.02.2023 (c)(d)	22.200	22.170	0,43	
								0,904 % fällig am 08.02.2023 (c)(d)	5.700	5.692	0,11	

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	% DES		BESCHREIBUNG	PARI (000S)	% DES		BESCHREIBUNG	AKTIEN	% DES	
		MARKT- WERT	NETTO- VERMÖ- GENS			MARKT- WERT	NETTO- VERMÖ- GENS			MARKT- WERT	NETTO- VERMÖ- GENS
0,918 % fällig am 08.02.2023 (c)(d)	€ 4.600	€ 4.594	0,09	ITALY TREASURY BILLS				INVESTMENTFONDS			
0,994 % fällig am 22.02.2023 (c)(d)	14.600	14.570	0,28	1,078 % fällig am 31.03.2023 (c)(d)	€ 27.000	€ 26.866	0,53	ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN			
1,402 % fällig am 08.03.2023 (c)(d)	5.500	5.484	0,11	1,815 % fällig am 31.03.2023 (c)(d)	29.400	29.254	0,57	PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Income Fund (f)	6.473.317	€ 101.171	1,98
1,435 % fällig am 15.02.2023 (c)(d)	12.240	12.219	0,24	2,179 % fällig am 28.04.2023 (c)(d)	13.000	12.913	0,25	PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO Capital Securities Fund (f)	2.900.175	29.511	0,58
1,462 % fällig am 15.02.2023 (c)(d)	100	100	0,00	2,197 % fällig am 28.04.2023 (c)(d)	20.300	20.163	0,39	PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund (f)	2.716.001	28.452	0,55
1,467 % fällig am 15.02.2023 (c)(d)	400	399	0,01	2,200 % fällig am 28.04.2023 (c)(d)	49.300	48.968	0,96				
1,484 % fällig am 15.02.2023 (c)(d)	200	200	0,00								
1,501 % fällig am 15.02.2023 (c)(d)	200	200	0,00								
1,511 % fällig am 01.03.2023 (c)(d)	2.300	2.294	0,05	JAPAN TREASURY BILLS				BÖRSENGEHANDELTE FONDS			
1,527 % fällig am 01.03.2023 (c)(d)	2.400	2.394	0,05	(0,249) % fällig am 11.01.2023 (c)(d)	¥ 93.000	660	0,01	PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (f)	3.415.400	330.007	6,45
1,600 % fällig am 22.03.2023 (c)(d)	4.700	4.683	0,09	(0,242) % fällig am 23.01.2023 (c)(d)	724.000	5.142	0,10	PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short-Term High Yield Corporate Bond Index UCITS ETF (f)	1.532.400	15.273	0,30
1,607 % fällig am 05.04.2023 (c)(d)	12.000	11.946	0,23	(0,209) % fällig am 06.01.2023 (c)(d)	9.977.000	70.851	1,38				
1,612 % fällig am 22.03.2023 (c)(d)	4.550	4.534	0,09	(0,191) % fällig am 06.01.2023 (c)(d)	3.713.000	26.368	0,52				
1,622 % fällig am 08.03.2023 (c)(d)	33.100	33.006	0,65	(0,182) % fällig am 20.03.2023 (c)(d)	12.787.000	90.838	1,78				
1,625 % fällig am 22.03.2023 (c)(d)	4.700	4.683	0,09	(0,181) % fällig am 13.03.2023 (c)(d)	11.094.000	78.809	1,54				
1,715 % fällig am 05.04.2023 (c)(d)	3.075	3.061	0,06	(0,171) % fällig am 20.03.2023 (c)(d)	2.623.000	18.634	0,36				
1,719 % fällig am 15.03.2023 (c)(d)	1.000	997	0,02	(0,166) % fällig am 13.03.2023 (c)(d)	4.386.000	31.157	0,61				
1,723 % fällig am 05.04.2023 (c)(d)	3.075	3.061	0,06	(0,142) % fällig am 06.03.2023 (c)(d)	12.973.000	92.153	1,80				
1,724 % fällig am 15.03.2023 (c)(d)	700	698	0,01	(0,131) % fällig am 06.03.2023 (c)(d)	12.359.000	87.792	1,72				
1,724 % fällig am 05.04.2023 (c)(d)	7.200	7.168	0,14								
1,727 % fällig am 05.04.2023 (c)(d)	4.800	4.778	0,09								
1,734 % fällig am 15.03.2023 (c)(d)	1.400	1.395	0,03	SPAIN TREASURY BILLS							
1,749 % fällig am 15.03.2023 (c)(d)	5.500	5.482	0,11	1,565 % fällig am 10.02.2023 (c)(d)	€ 10.000	9.984	0,20				
1,765 % fällig am 15.03.2023 (c)(d)	15.900	15.846	0,31								
2,005 % fällig am 04.05.2023 (c)(d)	5.450	5.414	0,11	Summe kurzfristige Instrumente		1.458.423	28,51	Summe Investmentfonds		€ 504.414	9,86
		177.068	3,46	Summe Übertragbare Wertpapiere		€ 4.130.924	80,77				
GERMANY TREASURY BILLS											
0,812 % fällig am 22.03.2023 (c)(d)	4.250	4.235	0,08								
1,257 % fällig am 22.02.2023 (c)(d)	18.460	18.423	0,36								
		22.658	0,44								
ISRAEL TREASURY BILLS											
0,011 % fällig am 04.01.2023 (c)(d)	ILS 8.600	2.283	0,04								
0,022 % fällig am 04.01.2023 (c)(d)	27.300	7.246	0,14								
0,746 % fällig am 05.04.2023 (c)(d)	19.300	5.077	0,10								
0,753 % fällig am 05.04.2023 (c)(d)	12.600	3.314	0,07								
0,886 % fällig am 03.05.2023 (c)(d)	27.300	7.165	0,14								
		25.085	0,49								

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kapital- betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions- geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions- geschäft ⁽¹⁾	% des Netto- vermögens
BPS	(1,000) %	30.12.2022	02.01.2023	€ 5.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0,625 % fällig am 07.01.2028	€ (161)	€ 5.000	€ 5.000	0,10
					Landwirtschaftliche Rentenbank 0,500 % fällig am 28.02.2029	(4.907)			
					Treasury Bills des europäischen Stabilitätsmechanismus 0,000 % fällig am 16.03.2023	(18.150)	17.818	17.837	0,35
CDI	1,780	30.12.2022	02.01.2023	100.000	Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale 4,125 % fällig am 25.04.2023	(100.270)	100.000	100.015	1,96
FICC	1,900	30.12.2022	03.01.2023	\$ 1.906	U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 08.06.2023	(1.822)	1.786	1.786	0,03
Summe Pensionsgeschäfte						€ (125.310)	€ 124.604	€ 124.638	2,44

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Netto- vermögens
Australia Government 10-Year Bond March Futures	Long	03.2023	9.367	€ (38.926)	(0,76)
Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 146,000 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond February 2023 Futures ⁽¹⁾					
Canada Government 10-Year Bond March Futures	Short	01.2023	95	71	0,00
E-mini NASDAQ 100 Index March Futures	Long	03.2023	2.307	(3.827)	(0,07)
E-mini Russell 2000 Index March Futures	Short	03.2023	895	11.145	0,22
E-mini S&P 500 Index March Futures	Short	03.2023	1.734	4.122	0,08
Euro STOXX 50 March Futures	Short	03.2023	2.092	10.442	0,20
Euro-BTP Italy Government Bond March Futures	Short	03.2023	17.128	29.272	0,57
FTSE 100 Index March Futures	Short	03.2023	1.418	11.505	0,23
Nikkei 225 Yen-Denominated March Futures	Short	03.2023	3.230	523	0,01
	Short	03.2023	2.532	16.902	0,33

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Dynamic Multi-Asset Fund (Forts.)

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Netto- vermögens
Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 138.500 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond February 2023 Futures ⁽¹⁾	Short	01.2023	95	€ (455)	(0,01)
U.S. Treasury 5-Year Note March Futures	Long	03.2023	12.716	(2.956)	(0,06)
U.S. Treasury 10-Year Note March Futures	Long	03.2023	8.394	(5.723)	(0,11)
U.S. Treasury 30-Year Bond March Futures	Long	03.2023	2.163	(6.078)	(0,12)
				€ 26.017	0,51

⁽¹⁾ Future-Style-Option.

OPTIONSKAUF

OPTIONEN AUF INDIZES

Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Anzahl der Kontrakte	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
Call – CBOE NASDAQ 100 Index	€ 12.500,00	20.01.2023	625	€ 7.856	€ 180	0,00

VERKAUFSOPTIONEN

OPTIONEN AUF INDIZES

Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
Put – CBOE NASDAQ 100 Index	€ 10.225,000	20.01.2023	190	€ (5.024)	€ (1.029)	(0,02)
Call – CBOE NASDAQ 100 Index	13.200,000	20.01.2023	625	(2.974)	(59)	0,00
Put – CBOE S&P 500 Index	3.300,000	20.01.2023	429	(3.330)	(73)	0,00
Put – CBOE S&P 500 Index	3.500,000	20.01.2023	415	(1.592)	(216)	(0,01)
Call – CBOE S&P 500 Index	4.200,000	20.01.2023	661	(3.998)	(67)	0,00
Call – CBOE S&P 500 Index	4.300,000	20.01.2023	415	(1.140)	(15)	0,00
				€ (18.058)	€ (1.459)	(0,03)

Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate

€ 24.738 0,48

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AT&T, Inc.	1,000 %	20.06.2026	\$ 500	€ (7)	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.06.2027	700	1	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.12.2027	600	4	0,00
				€ (2)	0,00

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.HY-35 5-Year Index	5,000 %	20.12.2025	\$ 297	€ (14)	0,00
CDX.HY-36 5-Year Index	5,000	20.06.2026	24.354	(1.194)	(0,02)
CDX.HY-37 5-Year Index	5,000	20.12.2026	5.074	(204)	(0,01)
CDX.HY-38 5-Year Index	5,000	20.06.2027	27.918	477	0,01
CDX.HY-39 5-Year Index	5,000	20.12.2027	149.200	5.256	0,10
CDX.IG-35 5-Year Index	1,000	20.12.2025	4.400	(34)	0,00
CDX.IG-36 5-Year Index	1,000	20.06.2026	15.000	(134)	0,00
CDX.IG-37 5-Year Index	1,000	20.12.2026	3.200	(29)	0,00
CDX.IG-38 5-Year Index	1,000	20.06.2027	395.500	3.258	0,06
CDX.IG-39 5-Year Index	1,000	20.12.2027	1.070.400	7.001	0,15
iTraxx Crossover 38 5-Year Index	5,000	20.12.2027	€ 16.100	748	0,01
				€ 15.131	0,30

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt	variabler Zinssatz	variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill		1,000 %	16.06.2026	CAD 585.429	€ (25.044)	(0,50)
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill		1,220	03.03.2025	5.692	(299)	(0,01)
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill		1,235	04.03.2025	10.835	(578)	(0,01)
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill		1,250	16.06.2031	82.272	(6.533)	(0,13)
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill		1,275	03.03.2025	5.150	(266)	(0,01)
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill		1,276	03.03.2025	3.072	(159)	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill		1,290	03.03.2025	1.536	(79)	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill		1,500	17.06.2025	102.600	(5.351)	(0,10)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag		Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,500	17.06.2030	CAD 150.600		€ (17.902)	(0,35)
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,900	18.12.2029	181		(21)	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	2,250	15.06.2027	477.100		(4.376)	(0,08)
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	2,500	19.06.2029	123.500		(13.139)	(0,26)
						€ (73.747)	(1,45)
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate						€ (58.618)	(1,15)

- (1) Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.
- (2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

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

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

OPTIONSKAUF

DEISENOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Kosten	Markt- wert	% des Netto- vermögens
BPS	Call – OTC EUR versus USD	\$ 1,070	07.02.2023	645.700	€ 6.463	€ 6.934	0,14

VERKAUFSOPTIONEN

CREDIT DEFAULT SWAPPTIONS AUF KREDITINDIZES

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/ -verkauf	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Netto- vermögens
GST	Put – OTC iTraxx Europe 37 5-Year Index	Verkauf	3,000 %	15.03.2023	9.900	€ (17)	€ (2)	0,00

DEISENOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Netto- vermögens
BPS	Put – OTC EUR versus USD	\$ 1,030	07.02.2023	241.000	€ (1.649)	€ (432)	(0,01)
	Call – OTC EUR versus USD	1,100	07.02.2023	645.700	(1.963)	(1.474)	(0,03)
					€ (3.612)	€ (1.906)	(0,04)

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Netto- vermögens
CBK	Call – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,150 %	09.01.2023	142.900	€ (479)	€ (2)	0,00
	Put – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	09.01.2023	142.900	(480)	(806)	(0,02)
GLM	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,547	07.03.2023	17.200	(360)	(36)	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,547	07.03.2023	17.200	(360)	(1.015)	(0,02)
	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,067	09.06.2023	22.700	(252)	(54)	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	3,140	09.06.2023	22.700	(296)	(696)	(0,01)
							€ (2.227)	€ (2.609)	(0,05)

- (1) Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZKAUF⁽¹⁾

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽²⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Netto- vermögens	
BPS	China Government International Bond	(1,000) %	20.12.2023	\$ 17.130	€ (303)	€ 188	€ (115)	0,00	
BRC	China Government International Bond	(1,000)	20.12.2023	16.800	(309)	197	(112)	0,00	
						€ (612)	€ 385	€ (227)	0,00

- (1) Agiert der Teilfonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Teilfonds entweder (i) vom Sicherungsgeber einen Betrag in Höhe des Nennwerts des Swaps und liefert die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er erhält einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.
- (2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Dynamic Multi-Asset Fund (Forts.)

TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES

Kontrahent	Zahlung/Erhalt	Wertpapier	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Variabler Zinssatz	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BPS	Zahlung	Industrial Select Sector Index	35.821	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	\$ 126.422	21.06.2023	€ 0	€ 440	€ 440	0,01
JPM	Zahlung	JPPMGSH Index	750.458	1-Month USD-LIBOR abzgl. eines bestimmten Spreads	60.667	07.06.2023	0	146	146	0,00
MEI	Zahlung	SX4T Index	43.167	1-Month USD-LIBOR abzgl. eines bestimmten Spreads	€ 127.694	11.01.2023	0	80	80	0,00
							€ 0	€ 666	€ 666	0,01

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2023	€ 9.272	NOK 95.957	€ 0	€ (147)	€ (147)	0,00
	01.2023	190.531	\$ 187.575	0	(14.919)	(14.919)	(0,29)
	01.2023	PEN 31.718	8.350	17	0	17	0,00
	01.2023	\$ 351.492	€ 351.230	22.179	0	22.179	0,43
	01.2023	20.050	HUF 9.073.440	1.897	0	1.897	0,04
	02.2023	PEN 400.000	\$ 102.743	0	(834)	(834)	(0,02)
	05.2023	26.573	6.773	0	(57)	(57)	0,00
	01.2023	BRL 825	152	0	(2)	(2)	0,00
	01.2023	CHF 2.321	€ 2.359	9	0	9	0,00
	01.2023	ILS 938.717	\$ 273.850	3.591	0	3.591	0,07
01.2023	¥ 42.113.501	€ 294.622	0	(4.538)	(4.538)	(0,09)	
01.2023	\$ 110.404	103.467	64	0	64	0,00	
03.2023	139.794	COP 684.131.253	0	(290)	(290)	(0,01)	
03.2023	64.142	INR 5.321.038	0	(87)	(87)	0,00	
03.2023	37.976	PEN 147.652	228	0	228	0,00	
03.2023	296	TWD 8.918	0	(2)	(2)	0,00	
BRC	01.2023	CLP 157.830.036	\$ 183.308	0	(845)	(845)	(0,02)
	01.2023	€ 62.156	£ 53.702	0	(1.644)	(1.644)	(0,03)
	01.2023	£ 4.734	€ 5.381	47	0	47	0,00
	01.2023	¥ 1.611.700	11.332	0	(117)	(117)	0,00
	01.2023	\$ 60.638	57.205	412	0	412	0,01
	03.2023	¥ 40.742.000	284.040	0	(6.536)	(6.536)	(0,13)
	03.2023	\$ 181.610	CLP 157.830.036	896	0	896	0,02
	01.2023	AUD 32.142	€ 20.183	0	(237)	(237)	0,00
	01.2023	€ 10.028	AUD 15.555	0	(146)	(146)	0,00
	01.2023	64.680	CAD 90.956	0	(1.806)	(1.806)	(0,03)
01.2023	2.802	¥ 394.100	0	(3)	(3)	0,00	
01.2023	34.654	\$ 36.590	0	(385)	(385)	(0,01)	
01.2023	£ 13.340	€ 15.479	448	0	448	0,01	
01.2023	ILS 71.787	\$ 22.733	1.119	0	1.119	0,02	
01.2023	\$ 165.640	CLP 157.830.036	9.118	0	9.118	0,18	
01.2023	33	KRW 43.883	1	0	1	0,00	
01.2023	192.058	PEN 770.016	4.411	0	4.411	0,09	
02.2023	115.787	CLP 104.000.000	2.678	0	2.678	0,05	
03.2023	TWD 298.728	\$ 9.905	53	0	53	0,00	
04.2023	ILS 38.353	11.653	338	0	338	0,01	
04.2023	PEN 207.028	51.664	0	(1.007)	(1.007)	(0,02)	
05.2023	ILS 54.141	16.408	443	0	443	0,01	
05.2023	PEN 63.718	16.099	0	(206)	(206)	0,00	
DUB	01.2023	\$ 137.832	HUF 62.323.333	12.975	0	12.975	0,25
	01.2023	316	TRY 6.462	13	0	13	0,00
GLM	01.2023	BRL 159.438	\$ 29.573	0	(288)	(288)	(0,01)
	01.2023	HKD 332.211	42.670	42	0	42	0,00
	01.2023	\$ 22	CNH 152	0	0	0	0,00
	03.2023	CLP 65.400.211	\$ 71.789	0	(1.987)	(1.987)	(0,04)
	03.2023	COP 552.947.156	114.668	1.018	0	1.018	0,02
	03.2023	MXN 3.576.032	173.954	0	(3.236)	(3.236)	(0,06)
	03.2023	\$ 114.566	COP 552.947.156	0	(988)	(988)	(0,02)
	03.2023	106.396	MXN 2.111.676	198	0	198	0,00
	05.2023	762	PEN 3.032	11	0	11	0,00
	01.2023	BRL 1.318.507	\$ 252.781	1.464	0	1.464	0,03
01.2023	€ 2.585	CAD 3.671	0	(47)	(47)	0,00	
01.2023	1.198	£ 1.030	0	(37)	(37)	0,00	
01.2023	3.283	¥ 461.700	0	(3)	(3)	0,00	
01.2023	21.266	\$ 22.308	0	(372)	(372)	(0,01)	
01.2023	£ 38.061	€ 43.978	1.091	0	1.091	0,02	
01.2023	ILS 153.419	\$ 44.939	672	0	672	0,01	
01.2023	¥ 4.798.931	€ 33.571	0	(519)	(519)	(0,01)	
01.2023	NOK 11.545	1.111	13	0	13	0,00	
01.2023	\$ 281.317	BRL 1.478.770	0	(616)	(616)	(0,01)	
01.2023	190	CNY 1.320	1	0	1	0,00	
01.2023	39.721	€ 37.640	438	0	438	0,01	
01.2023	102.057	HUF 45.155.148	8.374	0	8.374	0,16	
01.2023	101.622	PEN 407.727	2.367	0	2.367	0,05	
02.2023	8.682	TWD 263.584	0	(33)	(33)	0,00	
03.2023	341	CNY 2.356	1	0	1	0,00	
04.2023	ILS 25.036	\$ 7.521	180	0	180	0,00	
04.2023	\$ 248.325	BRL 1.318.507	0	(1.372)	(1.372)	(0,03)	

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Netto- vermögens
MBC	01.2023	AUD 35.783	€ 22.752	€ 84	€ (65)	€ 19	0,00
	01.2023	CAD 37.802	€ 26.134	4	(1)	3	0,00
	01.2023	€ 1.938	AUD 3.041	0	(6)	(6)	0,00
	01.2023	3.043	CAD 4.390	0	(8)	(8)	0,00
	01.2023	9.620	¥ 1.349.700	35	(67)	(32)	0,00
	01.2023	105.102	NOK 1.087.930	0	(1.643)	(1.643)	(0,03)
	01.2023	HKD 1.378.854	\$ 177.114	181	0	181	0,00
	01.2023	\$ 1.656.864	€ 1.580.897	29.100	0	29.100	0,56
	01.2023	159.087	PLN 808.002	11.694	0	11.694	0,23
	03.2023	¥ 15.480.000	€ 109.484	0	(935)	(935)	(0,02)
	03.2023	\$ 346	COP 1.578.154	0	(12)	(12)	0,00
	03.2023	152	INR 12.623	0	0	0	0,00
MYI	01.2023	€ 5.149	AUD 7.994	0	(71)	(71)	0,00
	01.2023	1.138	£ 986	0	(27)	(27)	0,00
	01.2023	22.546	SEK 245.724	0	(451)	(451)	(0,01)
	01.2023	7.254	\$ 7.552	0	(184)	(184)	0,00
	01.2023	£ 281	€ 318	1	0	1	0,00
	01.2023	ILS 2.833	752	0	0	0	0,00
	01.2023	NOK 7.970	774	16	0	16	0,00
	01.2023	SEK 4.435	405	6	0	6	0,00
	01.2023	\$ 8.741	8.800	618	0	618	0,01
RBC	02.2023	15.984	TWD 487.312	0	(30)	(30)	0,00
	01.2023	€ 2.705	¥ 385.400	33	0	33	0,00
	01.2023	¥ 13.690.000	€ 95.794	0	(1.429)	(1.429)	(0,03)
	03.2023	\$ 378	MXN 7.554	2	0	2	0,00
	04.2023	MXN 1.782.802	\$ 86.006	0	(1.714)	(1.714)	(0,03)
RYL	01.2023	€ 1.996	¥ 288.400	53	0	53	0,00
	01.2023	186.000	\$ 189.846	0	(8.275)	(8.275)	(0,16)
	01.2023	¥ 724.000	€ 5.071	0	(77)	(77)	0,00
SCX	01.2023	CHF 47.457	48.283	210	0	210	0,00
	01.2023	DKK 345.620	46.489	10	0	10	0,00
	01.2023	€ 8.800	\$ 8.741	0	(618)	(618)	(0,01)
	01.2023	£ 37.636	€ 43.556	1.148	0	1.148	0,02
	01.2023	KRW 295.406.591	\$ 223.554	0	(5.258)	(5.258)	(0,10)
	01.2023	SGD 40	€ 28	0	0	0	0,00
	02.2023	TWD 24.493.966	\$ 796.060	0	(2.214)	(2.214)	(0,04)
	02.2023	\$ 25.645	CLP 23.000.000	574	0	574	0,01
	03.2023	201.975	INR 16.757.881	0	(259)	(259)	(0,01)
SOG	01.2023	£ 136.371	€ 157.794	4.131	0	4.131	0,08
	01.2023	HKD 2.240	\$ 288	0	0	0	0,00
UAG	01.2023	€ 1.752	£ 1.515	0	(45)	(45)	0,00
	01.2023	\$ 506	TRY 10.361	20	0	20	0,00
	03.2023	COP 132.762.251	\$ 27.551	253	0	253	0,01
	03.2023	¥ 3.092.546	€ 21.714	0	(326)	(326)	(0,01)
	03.2023	\$ 27.539	COP 132.762.251	0	(252)	(252)	0,00
				€ 124.980	€ (67.273)	€ 57.707	1,12

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilsklassen BM Retail AUD (Hedged) ausschüttend II und M Retail AUD (Hedged) ausschüttend II die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Netto- vermögens
AZD	01.2023	€ 6	AUD 9	€ 0	€ 0	€ 0	0,00
JPM	01.2023	71	109	0	(1)	(1)	0,00
MBC	01.2023	4	6	0	0	0	0,00
RYL	01.2023	71	109	0	(2)	(2)	0,00
SCX	01.2023	71	109	0	(1)	(1)	0,00
				€ 0	€ (4)	€ (4)	0,00

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilsklasse Institutional CHF (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Netto- vermögens
BPS	01.2023	€ 1.042	CHF 1.025	€ 0	€ (4)	€ (4)	0,00
JPM	01.2023	1.117	1.098	0	(5)	(5)	0,00
MYI	01.2023	CHF 134	€ 137	1	0	1	0,00
	01.2023	€ 136	CHF 134	0	0	0	0,00
RBC	01.2023	CHF 44	€ 45	0	0	0	0,00
SCX	01.2023	€ 1.067	CHF 1.049	0	(5)	(5)	0,00
				€ 1	€ (14)	€ (13)	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Dynamic Multi-Asset Fund (Forts.)

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend und Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2023	€ 138.899	£ 119.411	€ 0	€ (4.347)	€ (4.347)	(0,09)
CLY	01.2023	439	382	0	(8)	(8)	0,00
DUB	01.2023	270	238	0	(2)	(2)	0,00
JPM	01.2023	151.441	131.065	0	(3.757)	(3.757)	(0,07)
MBC	01.2023	£ 9.305	€ 10.527	42	0	42	0,00
RBC	01.2023	€ 248	£ 220	0	0	0	0,00
	01.2023	£ 329	€ 381	11	0	11	0,00
RYL	01.2023	€ 4.929	£ 4.244	0	(147)	(147)	0,00
	01.2023	£ 17.993	€ 20.862	587	0	587	0,01
SCX	01.2023	€ 214.390	£ 185.254	0	(5.645)	(5.645)	(0,11)
	01.2023	£ 6.094	€ 6.880	14	0	14	0,00
SOG	01.2023	€ 212.555	£ 183.691	0	(5.572)	(5.572)	(0,11)
UAG	01.2023	703	611	0	(15)	(15)	0,00
				€ 654	€ (19.493)	€ (18.839)	(0,37)

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilsklasse Institutional ILS (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BRC	01.2023	€ 77	ILS 275	€ 0	€ (4)	€ (4)	0,00
CBK	01.2023	86	312	0	(3)	(3)	0,00
GLM	01.2023	77	282	0	(2)	(2)	0,00
MYI	01.2023	115	414	0	(5)	(5)	0,00
SCX	01.2023	5	20	0	0	0	0,00
SOG	01.2023	77	275	0	(4)	(4)	0,00
				€ 0	€ (18)	€ (18)	0,00

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional SGD (Hedged) thesaurierend und M Retail SGD (Hedged) ausschüttend II die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2023	€ 29.043	SGD 41.491	€ 0	€ (63)	€ (63)	0,00
CBK	01.2023	29.043	41.491	0	(63)	(63)	0,00
JPM	01.2023	SGD 1.223	€ 848	0	(6)	(6)	0,00
RBC	01.2023	€ 1.314	SGD 1.872	0	(6)	(6)	0,00
RYL	01.2023	29.663	42.377	0	(63)	(63)	0,00
	01.2023	SGD 204	€ 143	0	0	0	0,00
SOG	01.2023	41	29	0	0	0	0,00
UAG	01.2023	€ 121	SGD 174	0	0	0	0,00
				€ 0	€ (201)	€ (201)	0,00

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional USD (Hedged) thesaurierend, Institutional USD (Hedged) ausschüttend II, Investor USD (Hedged) thesaurierend, BM Retail USD (Hedged) ausschüttend II, E USD (Hedged) thesaurierend, E USD (Hedged) ausschüttend, E USD (Hedged) ausschüttend II, H Institutional USD (Hedged) thesaurierend, M Retail USD (Hedged) ausschüttend II und T USD (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	01.2023	\$ 2.088	€ 2.005	€ 50	€ 0	€ 50	0,00
BOA	01.2023	€ 25.196	\$ 26.604	0	(280)	(280)	(0,01)
BRC	01.2023	\$ 698	€ 657	3	0	3	0,00
CBK	01.2023	€ 129.647	\$ 134.411	0	(3.759)	(3.759)	(0,07)
	01.2023	\$ 8.850	€ 8.360	71	0	71	0,00
JPM	01.2023	€ 27.622	\$ 28.723	0	(720)	(720)	(0,01)
MBC	01.2023	129.486	135.710	0	(2.381)	(2.381)	(0,05)
	01.2023	\$ 1.332	€ 1.248	1	0	1	0,00
RBC	01.2023	€ 980	\$ 1.032	0	(14)	(14)	0,00
	01.2023	\$ 577	€ 542	2	0	2	0,00
RYL	01.2023	€ 96	\$ 103	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 9.896	€ 9.445	176	0	176	0,00
SCX	01.2023	€ 129.617	\$ 134.912	0	(3.260)	(3.260)	(0,06)
	01.2023	\$ 1.918	€ 1.804	7	0	7	0,00
UAG	01.2023	7.262	6.825	24	0	24	0,00
				€ 334	€ (10.414)	€ (10.080)	(0,20)

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

€ 31.408 0,61

Summe Anlagen

€ 4.757.470 93,01

Sonstige Aktiva und Passiva

€ 357.700 6,99

Nettovermögen

€ 5.115.170 100,00

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

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

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Wertpapier per Emissionstermin.

(b) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.

(c) Nullkuponwertpapier.

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

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

(f) Mit dem Fonds verbunden.

(g) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(h) Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von 17.831 EUR (31. Dezember 2021: 0 EUR) wurden gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen zum 31. Dezember 2022 als Sicherheiten verpfändet.

Barmittel in Höhe von 68.086 EUR (31. Dezember 2021: 0 EUR) wurden zum 31. Dezember 2022 als Sicherheit für Leerverkäufe und Optionen gemäß Prime Brokerage-Vereinbarungen und Vereinbarungen, die börsennotierte Aktienoptionsgeschäfte regeln, verpfändet.

Barmittel in Höhe von 287.910 EUR (31. Dezember 2021: 102.757 EUR) wurden zum 31. Dezember 2022 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 38.420 EUR (31. Dezember 2021: 32.340 USD) wurden gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. zum 31. Dezember 2022 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	€ 1.030.499	€ 3.100.425	€ 0	€ 4.130.924
Investmentfonds	159.134	345.280	0	504.414
Pensionsgeschäfte	0	124.604	0	124.604
Finanzderivate ⁽³⁾	40.774	(43.246)	0	(2.472)
Summen	€ 1.230.407	€ 3.527.063	€ 0	€ 4.757.470

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

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	€ 1.782.223	€ 5.070.325	€ 0	€ 6.852.548
Investmentfonds	433.439	16.631	0	450.070
Pensionsgeschäfte	0	202.276	0	202.276
Finanzderivate ⁽³⁾	(14.811)	15.834	0	1.023
Summen	€ 2.200.851	€ 5.305.066	€ 0	€ 7.505.917

⁽¹⁾ Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

⁽²⁾ Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

⁽³⁾ Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions- geschäften	% des Nettovermögens
BPS	1,550 %	19.12.2022	09.01.2023	€ (17.818)	€ (17.828)	(0,35)
Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte					€ (17.828)	(0,35)

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Dynamic Multi-Asset Fund (Forts.)

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung des Marktwerts der außerbörslich gehandelten Finanzderivate und (erhaltenen)/verpfändeten Sicherheiten nach Kontrahenten zum 31. Dezember 2022 und 31. Dezember 2021:

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2022			Zum 31. Dez. 2021		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Nettoengagement ⁽¹⁾	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Nettoengagement ⁽¹⁾
AZD	€ 50	€ 0	€ 50	€ k. A.	€ k. A.	€ k. A.
BOA	3.446	(3.570)	(124)	1.017	(680)	337
BPS	4.322	(10.200)	(5.878)	(3.252)	12.530	9.278
BRC	(7.900)	5.060	(2.840)	807	7.140	7.947
CBK	10.257	(9.740)	517	(4.836)	4.460	(376)
CLY	(8)	0	(8)	k. A.	k. A.	k. A.
DUB	12.986	(12.970)	16	1.331	(2.120)	(789)
GLM	(7.033)	6.920	(113)	13.260	(12.310)	950
GST	(2)	0	(2)	(26)	0	(26)
HUS	k. A.	k. A.	k. A.	(2.879)	2.270	(609)
IND	k. A.	k. A.	k. A.	(1.607)	1.610	3
JPM	7.259	(7.080)	179	(536)	540	4
MBC	36.023	(33.640)	2.383	k. A.	k. A.	k. A.
MEI	80	(4.040)	(3.960)	k. A.	k. A.	k. A.
MYC	k. A.	k. A.	k. A.	(43)	0	(43)
MYI	(126)	0	(126)	1.628	(1.210)	418
RBC	(3.115)	2.470	(645)	(2.095)	1.700	(395)
RYL	(7.748)	7.780	32	3.591	650	4.241
SCX	(15.297)	14.720	(577)	23.935	(19.060)	4.875
SQG	(1.445)	1.300	(145)	(125)	0	(125)
SSB	k. A.	k. A.	k. A.	(49)	0	(49)
UAG	(341)	170	(171)	(1.551)	1.440	(111)

⁽¹⁾ Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2022:

	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	65,24	78,86
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	15,48	10,60
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,05	0,29
Investmentfonds	9,86	5,89
Pensionsgeschäfte	2,44	2,65
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,48	(0,20)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(1,15)	(0,16)
Freiverkehrsfinanzderivate	0,61	0,37
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(0,35)	k. A.

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2022 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
Unternehmensanleihen und Wechsel	3,28	4,09
Wandelanleihen und Wechsel	0,26	0,21
Non-Agency-MBS	1,78	0,70
Forderungsbesicherte Wertpapiere	6,77	4,43
Staatsemissionen	0,72	0,41
Stammaktien	39,19	48,53
Rechte	0,00	k. A.
Real Estate Investment Trusts	0,26	0,25
Kurzfristige Instrumente	28,51	31,13
Investmentfonds	9,86	5,89
Pensionsgeschäfte	2,44	2,65
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,51	(0,20)
Optionskauf		
Optionen auf Indizes	0,00	k. A.
Verkaufsoptionen		
Optionen auf Indizes	(0,03)	k. A.
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen –		
Schutzverkauf	0,00	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,30	0,02
Zinsswaps	(1,45)	(0,18)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Devisenoptionen	0,14	k. A.
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes	0,00	0,00
Devisenoptionen	(0,04)	k. A.
Zinsswapoptionen	(0,05)	k. A.

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzkauf	0,00	(0,01)
Total Return Swaps auf Indizes	0,01	0,00
Devisenterminkontrakte	1,12	0,29
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	(0,57)	0,09
Sonstige Aktiva und Passiva	6,99	1,70
Nettovermögen	100,00	100,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Local Bond Fund

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	
TRANSFERABLE SECURITIES				STAATSEMISSIONEN				Realkredit Danmark A/S				
ARGENTINIEN				China Government Bond				1,500 % fällig am 01.10.2053 DKK 0 \$ 0 0,00				
STAATSEMISSIONEN				2,700 % fällig am 03.11.2026 CNY 96.600 \$ 13.941 0,73				Summe Dänemark				
Argentina Government International Bond				3,030 % fällig am 11.03.2026	308.500	45.150	2,35	0 0,00				
0,500 % fällig am 09.07.2030	\$	5.624	1,301	0,07				0 0,00				
1,500 % fällig am 09.07.2035		3.692	837	0,04	83.500	12.264	0,64	0 0,00				
Argentina Treasury Bond BONCER				3,280 % fällig am 03.12.2027	164.010	24.313	1,27	DOMINIKANISCHE REPUBLIK				
1,400 % fällig am 25.03.2023	ARS	72.265	219	0,01	89.400	14.124	0,73	STAATSEMISSIONEN				
Autonomous City of Buenos Aires				3,810 % fällig am 14.09.2050				Dominican Republic Central Bank Notes				
72,479 % fällig am 29.03.2024 (a)		88.177	276	0,02				12,000 % fällig am 03.10.2025 DOP 310.500 5.316 0,28				
72,986 % fällig am 22.02.2028 (a)		52.420	150	0,01				Dominican Republic Government International Bond				
Letras de la Nacion Argentina con Ajuste por	CER							8,900 % fällig am 15.02.2023 1.106.650 19.621 1,02				
0,000 % fällig am 19.05.2023 (d)		73.077	222	0,01				Summe Dominikanische Republik				
Summe Argentinien			3.005	0,16				24.937 1,30				
ASERBAIDSCHAN				STAATSEMISSIONEN				UNGARN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Colombia Government International Bond				STAATSEMISSIONEN				
SOCAR Turkey Enerji AS Via Steas Funding DAC				4,375 % fällig am 21.03.2023	19.889.000	4.027	0,21	Hungary Government International Bond				
7,230 % fällig am 17.03.2026	\$	4.500	4.399	0,23	9,850 % fällig am 28.06.2027	25.455.000	4.624	0,24	5,000 % fällig am 22.02.2027 € 7.190 7.624 0,40			
BAHAMAS				Colombian TES				INDONESIEN				
STAATSEMISSIONEN				6,250 % fällig am 09.07.2036				STAATSEMISSIONEN				
Bahamas Government International Bond				7,000 % fällig am 26.03.2031	42.072.100	5.019	0,26	Indonesia Government International Bond				
9,000 % fällig am 16.06.2029		3.000	2.580	0,13	7,000 % fällig am 30.06.2032	3.962.300	555	0,03	6,375 % fällig am 15.08.2028 IDR 34.287.000 2.184 0,11			
BRASILIEN				Republic of Colombia				INDONESIEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				1,000 % fällig am 26.11.2025				STAATSEMISSIONEN				
Banco BTG Pactual S.A.				1,000 % fällig am 26.08.2026	30.696.900	4.463	0,23	Indonesia Government International Bond				
8,300 % fällig am 15.08.2024	BRL	228.000	40.836	2,13	7,000 % fällig am 18.10.2034	62.308.900	8.517	0,45	6,500 % fällig am 15.02.2031 205.262.000 12.893 0,67			
Odebrecht Oil & Gas Finance Ltd.				7,250 % fällig am 26.10.2050	16.745.900	1.971	0,10	7,000 % fällig am 15.09.2030 278.789.000 18.103 0,94				
0,000 % fällig am 30.01.2023 (d)(g)	\$	485	1	0,00	9,250 % fällig am 28.05.2042	107.902.000	16.118	0,84	7,000 % fällig am 15.02.2033 502.143.000 32.439 1,68			
Oi S.A.				1,000 % fällig am 03.11.2027	21.806.500	3.857	0,20	7,125 % fällig am 15.06.2038 138.300.000 8.928 0,47				
0,000 % fällig am 25.02.2035	BRL	4.559	3.890	0,20	1,000 % fällig am 09.07.2036	1.772.000	212	0,01	7,125 % fällig am 15.06.2042 34.279.000 2.208 0,12			
Swiss Insured Brazil Power Finance SARL				1,000 % fällig am 15.03.2034	19.930.500	3.517	0,19	7,125 % fällig am 15.06.2043 157.824.000 10.174 0,53				
9,850 % fällig am 16.07.2032		204.859	34.242	1,78	1,000 % fällig am 09.07.2036	100.736.000	15.761	0,82	8,375 % fällig am 15.03.2034 199.861.000 14.117 0,74			
Vale S.A.								Summe Indonesien				
0,000 % (g)		99.420	7.029	0,37				101.046 5,26				
Summe Brasilien			85.998	4,48				IRLAND				
KAIMANINSELN				TSCHECHISCHE REPUBLIK				FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				STAATSEMISSIONEN				Black Diamond CLO DAC				
Interoceania Finance Ltd.				0,950 % fällig am 15.05.2030	727.940	24.171	1,26	2,316 % fällig am 20.01.2032 € 868 906 0,05				
0,000 % fällig am 30.11.2025 (d)	\$	329	270	0,02	1,200 % fällig am 13.03.2031	235.000	7.749	0,40	BNPP AM Euro CLO DAC			
Kaisa Group Holdings Ltd.				2,000 % fällig am 13.10.2033	29.600	986	0,05	1,978 % fällig am 15.04.2031 500 518 0,03				
9,750 % fällig am 28.09.2023 ^		8.000	1.126	0,06	2,750 % fällig am 23.07.2029	426.500	16.392	0,86	Carlyle Euro CLO DAC			
10,500 % fällig am 15.01.2025 ^		1.900	267	0,01	4,200 % fällig am 04.12.2036	149.900	6.122	0,32	2,078 % fällig am 15.01.2031 4.598 4.788 0,25			
10,875 % fällig am 23.07.2023 ^		500	70	0,00				Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd.				
11,700 % fällig am 11.11.2025 ^		1.900	268	0,01				2,548 % fällig am 15.11.2031 1.900 1.965 0,10				
Odebrecht Drilling Norbe Ltd. (6,350 % bar und 1,000 % PIK)								Dryden Euro CLO DAC				
7,350 % fällig am 01.12.2026 ^ (b)		517	286	0,02				2,622 % fällig am 15.05.2034 7.400 7.675 0,40				
Poinsettia Finance Ltd.								Summe Irland				
6,625 % fällig am 17.06.2031		7.137	6.057	0,32				15.852 0,83				
Summe Kaimaninseln			8.344	0,44				ISRAEL				
CHILE				DÄNEMARK				STAATSEMISSIONEN				
STAATSEMISSIONEN				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Israel Government International Bond				
Bonos de la Tesoreria de la Republica en Pesos				Jyske Realkredit A/S				0,150 % fällig am 31.07.2023 ILS 20.900 5.807 0,30				
2,300 % fällig am 01.10.2028	CLP	8.705.000	8.557	0,45	1,500 % fällig am 01.10.2053 DKK 0 0 0,00			1,500 % fällig am 30.11.2023 76.200 21.193 1,10				
4,500 % fällig am 15.10.2023		175.555	205	0,01	Nordea Kredit Realkreditaktieselskab			4,250 % fällig am 31.03.2023 23.400 6.641 0,35				
4,700 % fällig am 01.09.2030		7.200.000	8.157	0,42	1,500 % fällig am 01.10.2053	0 0 0,00		Summe Israel				
5,000 % fällig am 01.10.2028		17.520.000	19.918	1,04				33.641 1,75				
6,000 % fällig am 01.01.2043		1.520.000	1.981	0,10								
7,000 % fällig am 01.05.2034		530.000	719	0,04								
Summe Chile			39.537	2,06								
CHINA				CHINA								
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL								
Flourish Century												
6,600 % fällig am 04.02.2049 ^ (i)	\$	2.800	311	0,02								

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
ELFENBEINKÜSTE			
KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNGEN			
Republik Côte d'Ivoire			
6,608 % fällig am 19.03.2027	€	7.110	\$ 7.247 0,38

JERSEY, KANALINSELN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Corsair International Ltd.			
5,473 % fällig am 28.01.2027		6.500	6.885 0,36
5,823 % fällig am 28.01.2029		2.800	2.958 0,15
Summe Jersey, Kanalinseln			9,843 0,51

KASACHSTAN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Development Bank of Kazakhstan JSC			
8,950 % fällig am 04.05.2023	KZT	492.250	1.019 0,05

LUXEMBURG			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Constellation Oil Services Holding S.A. (3,000 % bar oder 4,000 % PIK)			
3,000 % fällig am 31.12.2026 (b)	\$	335	198 0,01

MALAYSIA			
STAATSEMISSIONEN			
Malaysia Government International Bond			
2,632 % fällig am 15.04.2031	MYR	25.040	5.122 0,27
3,582 % fällig am 15.07.2032		8.484	1.856 0,09
3,733 % fällig am 15.06.2028		30.750	6.914 0,36
3,757 % fällig am 22.05.2040		75.080	15.886 0,83
3,885 % fällig am 15.08.2029		26.300	5.931 0,31
3,899 % fällig am 16.11.2027		25.050	5.699 0,30
4,065 % fällig am 15.06.2050		44.540	9.270 0,48
4,254 % fällig am 31.05.2035		35.492	8.068 0,42
4,504 % fällig am 30.04.2029		6.420	1.498 0,08
4,696 % fällig am 15.10.2042		27.641	6.527 0,34
4,762 % fällig am 07.04.2037		16.310	3.903 0,20
Malaysia Government Investment Issue			
3,422 % fällig am 30.09.2027		32.700	7.288 0,38
3,465 % fällig am 15.10.2030		35.910	7.811 0,41
3,990 % fällig am 15.10.2025		267.690	61.176 3,19
4,130 % fällig am 09.07.2029		49.250	11.216 0,58
4,193 % fällig am 07.10.2032		13.490	3.074 0,16
4,258 % fällig am 26.07.2027		14.130	3.262 0,17
4,369 % fällig am 31.10.2028		44.670	10.332 0,54
Summe Malaysia			174,833 9,11

AKTIEN

MEXIKO			
STAMMAKTIE			
Hipotecaria Su Casita S.A. (c)		212.074	0 0,00

PARI**(000S)**

UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
America Movil S.A.B. de C.V.			
8,460 % fällig am 18.12.2036	MXN	1.800	80 0,01
Corp. GEO S.A.B. de C.V.			
8,875 % fällig am 25.09.2014 ^	\$	250	0 0,00
9,250 % fällig am 30.06.2020 ^		700	0 0,00
Hipotecaria Su Casita S.A. de C.V.			
9,620 % fällig am 28.06.2018 ^	MXN	22.130	37 0,00
Urbi Desarrollos Urbanos S.A.B. de C.V.			
8,790 % fällig am 09.12.2014 ^		29.700	0 0,00
			117 0,01

STAATSEMISSIONEN

Mexico Government International Bond			
5,500 % fällig am 04.03.2027		1.028.100	46,051 2,40
5,750 % fällig am 05.03.2026		253.900	11,783 0,61
7,500 % fällig am 03.06.2027		363.600	17,573 0,92

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
7,750 % fällig am 29.05.2031	MXN	163.002	\$ 7.727 0,40
7,750 % fällig am 23.11.2034		12.500	580 0,03
7,750 % fällig am 13.11.2042		283.300	12.702 0,66
8,000 % fällig am 07.11.2047		278.900	12.778 0,67
8,500 % fällig am 31.05.2029		608.600	30.354 1,58
8,500 % fällig am 18.11.2038		318.000	15.458 0,80
10,000 % fällig am 20.11.2036		9.600	527 0,03
			155,533 8,10
Summe Mexiko			155,650 8,11

NIEDERLANDE			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Republic of Angola Via Avenir BV			
9,687 % fällig am 07.12.2023	\$	3.160	3.113 0,16
12,639 % fällig am 01.07.2023		689	694 0,04
Summe Niederlande			3,807 0,20

NIGERIA			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
BOI Finance BV			
7,500 % fällig am 16.02.2027	€	4.800	4.137 0,22

PERU			
STAATSEMISSIONEN			
Peru Government International Bond			
5,350 % fällig am 12.08.2040	PEN	6.500	1.276 0,07
5,400 % fällig am 12.08.2034		10.400	2.190 0,11
5,940 % fällig am 12.02.2029		99.800	24.025 1,25
6,150 % fällig am 12.08.2032		12.106	2.798 0,15
6,350 % fällig am 12.08.2028		3.500	873 0,05
6,900 % fällig am 12.08.2037		30.200	7.126 0,37
8,200 % fällig am 12.08.2026		22.628	6.215 0,32
Summe Peru			44,503 2,32

PHILIPPINEN			
STAATSEMISSIONEN			
Philippines Government International Bond			
6,250 % fällig am 14.01.2036	PHP	52.000	852 0,04

POLEN			
STAATSEMISSIONEN			
Poland Government International Bond			
1,250 % fällig am 25.10.2030 (j)	PLN	30.486	4.672 0,24
1,750 % fällig am 25.04.2032 (j)		26.500	3.971 0,21
2,500 % fällig am 25.07.2027		19.800	3.765 0,20
2,750 % fällig am 25.04.2028 (j)		243.700	45.702 2,37
2,750 % fällig am 25.10.2029 (j)		107.700	19.307 1,01
3,750 % fällig am 25.05.2027 (j)		72.600	14.648 0,76
Summe Polen			92,065 4,79

KATAR			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
QNB Finance Ltd.			
6,900 % fällig am 23.01.2025	IDR	276.200.000	17,552 0,92

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
RUMANIEN			
STAATSEMISSIONEN			
Romania Government International Bond			
3,650 % fällig am 28.07.2025	RON	42.200	\$ 8.379 0,44
3,700 % fällig am 25.11.2024		9.700	1.979 0,10
4,150 % fällig am 26.01.2028		46.800	8.595 0,45
4,500 % fällig am 17.06.2024		212.500	44.441 2,31
4,750 % fällig am 11.10.2034		62.000	9.821 0,51
4,850 % fällig am 25.07.2029		6.600	1.200 0,06
5,000 % fällig am 12.02.2029		12.600	2.358 0,12
Summe Rumänien			76,773 3,99

RUSSLAND			
STAATSEMISSIONEN			
Russia Government International Bond			
1,125 % fällig am 20.11.2027	€	100	31 0,00
5,100 % fällig am 28.03.2035	\$	1.200	396 0,02
7,700 % fällig am 23.03.2033	RUB	1.088.800	4,624 0,24
Summe Russland			5,051 0,26

SERBIEN			
STAATSEMISSIONEN			
Serbia Government International Bond			
4,500 % fällig am 20.08.2032	RSD	371.800	2.790 0,15

SÜDAFRIKA			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Development Bank of Southern Africa			
8,600 % fällig am 21.10.2024 (i)	ZAR	221.300	12.807 0,67
Eskom Holdings SOC Ltd.			
0,000 % fällig am 18.08.2027 (d)		100.100	2.886 0,15
0,000 % fällig am 31.12.2032 (d)		254.000	3.097 0,16
			18,790 0,98

STAATSEMISSIONEN			
South Africa Government International Bond			
2,000 % fällig am 31.01.2025 (f)		67.899	3.885 0,20
6,250 % fällig am 31.03.2036		114.500	4.431 0,23
6,500 % fällig am 28.02.2041		513.200	18.883 0,98
7,000 % fällig am 28.02.2031		106.446	5.054 0,26
8,000 % fällig am 31.01.2030		628.027	32.918 1,7
8,250 % fällig am 31.03.2032		374.180	18.787 0,98
8,500 % fällig am 31.01.2037		697.900	32.561 1,70
8,750 % fällig am 31.01.2044		68.700	3.146 0,16
8,875 % fällig am 28.02.2035		320.000	15,865 0,83
9,000 % fällig am 31.01.2040		152.100	7,251 0,38
10,500 % fällig am 21.12.2026		407.300	25,307 1,32
10,500 % fällig am 21.12.2026 (j)		1.224.732	76,096 3,97
			244,184 12,72
Summe Südafrika			262,974 13,70

SÜDKOREA			
STAATSEMISSIONEN			
Export-Import Bank of Korea			
7,250 % fällig am 07.12.2024	IDR	51.400.000	3,338 0,17

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
JAPAN TREASURY BILLS				INVESTMENTFONDS				ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN			
(0,255) % fällig am 11.01.2023 (d)(e)	¥ 4.207.200	\$ 31.887	1,66	PIMCO Funds: Global Investors Series plc – Asia Strategic Interest Bond Fund (h)	250.000	\$ 2.200	0,11	PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short- Term Floating NAV Fund (h)	9.887.838	\$ 98.424	5,13
(0,235) % fällig am 11.01.2023 (d)(e)	1.451.600	11.002	0,57	PIMCO Funds: Global Investors Series plc – Emerging Local Bond ESG Fund (h)	122.324	1.317	0,07	PIMCO Specialty Funds Ireland p.l.c. – PIMCO China Bond Fund (h)	384.409	5.120	0,27
(0,228) % fällig am 11.01.2023 (d)(e)	1.987.200	15.061	0,78	PIMCO Funds: Global Investors Series plc – PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund (h)	2.453.310	24.582	1,28	Summe Investmentfonds		\$ 131.643	6,86
		57.950	3,01								
Summe kurzfristige Instrumente		143.619	4,78								
Summe Übertragbare Wertpapiere	\$ 1.772.984		92,35								

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

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 146,000 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond February 2023 Futures ⁽¹⁾	Short	01.2023	35	\$ 28	0,00
Japan Government 10-Year Bond March Futures	Short	03.2023	44	890	0,05
Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 138,500 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond February 2023 Futures ⁽¹⁾	Short	01.2023	35	(179)	(0,01)
				\$ 739	0,04
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ 739	0,04

⁽¹⁾ Future-Style-Option.

ZENTRALE ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Barclays Bank PLC	1,000 %	20.12.2023	€ 1.200	\$ 2	0,00
General Electric Co.	1,000	20.12.2023	\$ 1.100	(10)	0,00
				\$ (8)	0,00

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	6,250 %	16.03.2032	INR 1.930.950	\$ (1.490)	(0,08)
Zahlung	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	6,500	21.09.2023	15.635.021	(527)	(0,03)
Zahlung	1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS	1,250	15.09.2031	SGD 2.160	(73)	0,00
Erhalt	1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS	1,250	15.09.2031	2.160	244	0,01
Zahlung	1-Year BRL-CDI	4,030	02.01.2023	BRL 184.300	(1.745)	(0,09)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	4,038	02.01.2023	45.000	(426)	(0,02)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	4,070	02.01.2023	161.500	(1.526)	(0,08)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	4,605	02.01.2023	166.600	1.527	0,08
Zahlung	1-Year BRL-CDI	4,870	02.01.2024	326.700	(5.180)	(0,27)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	5,000	02.01.2023	94.400	(812)	(0,04)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	5,100	02.01.2024	50.600	773	0,04
Erhalt	1-Year BRL-CDI	5,160	02.01.2024	348.300	5.312	0,28
Erhalt	1-Year BRL-CDI	5,350	02.01.2023	52.700	441	0,02
Erhalt	1-Year BRL-CDI	5,360	02.01.2023	4.900	41	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	5,440	02.01.2023	19.900	(164)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	5,660	02.01.2025	183.200	(3.331)	(0,17)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	5,680	02.01.2024	19.200	(278)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	5,710	02.01.2025	66.100	(1.158)	(0,06)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	5,745	02.01.2023	66.700	(536)	(0,03)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	5,780	02.01.2023	9.800	(79)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	5,920	02.01.2023	2.600	(21)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	6,010	02.01.2025	34.000	(584)	(0,03)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	6,020	04.01.2027	36.800	826	0,04
Zahlung	1-Year BRL-CDI	6,030	02.01.2025	76.700	(1.309)	(0,07)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	6,050	02.01.2025	102.500	1.756	0,09
Zahlung	1-Year BRL-CDI	6,140	04.01.2027	528.200	(11.945)	(0,62)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	6,180	04.01.2027	79.900	1.755	0,09

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Local Bond Fund (Forts.)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Netto- vermögens
Zahlung	1-Year BRL-CDI	6,230 %	02.01.2023	BRL 141.800	\$ (1.077)	(0,06)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	6,245	04.01.2027	10.400	230	0,01
Erhalt	1-Year BRL-CDI	6,250	04.01.2027	27.100	592	0,03
Zahlung	1-Year BRL-CDI	6,375	02.01.2023	48.800	(365)	(0,02)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	6,410	04.01.2027	80.000	(1.720)	(0,09)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	6,450	04.01.2027	21.800	471	0,02
Erhalt	1-Year BRL-CDI	6,500	04.01.2027	62.500	1.358	0,07
Erhalt	1-Year BRL-CDI	6,510	04.01.2027	66.800	1.436	0,07
Erhalt	1-Year BRL-CDI	6,520	04.01.2027	93.600	1.997	0,10
Zahlung	1-Year BRL-CDI	6,675	02.01.2023	157.400	(1.141)	(0,06)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	6,710	02.01.2025	13.900	(226)	(0,01)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	6,745	02.01.2025	231.100	3.749	0,20
Erhalt	1-Year BRL-CDI	6,810	02.01.2025	147.200	2.378	0,12
Erhalt	1-Year BRL-CDI	6,910	02.01.2023	80.000	708	0,04
Zahlung	1-Year BRL-CDI	6,950	04.01.2027	800	(17)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	6,990	04.01.2027	59.200	(1.220)	(0,06)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	7,115	04.01.2027	82.200	(1.680)	(0,09)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	7,160	02.01.2025	9.100	(155)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	7,170	02.01.2025	11.900	(203)	(0,01)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	7,170	04.01.2027	108.700	2.209	0,12
Erhalt	1-Year BRL-CDI	7,195	02.01.2023	319.800	2.617	0,14
Zahlung	1-Year BRL-CDI	7,305	04.01.2027	37.400	(754)	(0,04)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	7,310	02.01.2024	46.400	(768)	(0,04)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	7,480	02.01.2025	119.400	(1.835)	(0,10)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	7,770	04.01.2027	166.100	3.474	0,18
Zahlung	1-Year BRL-CDI	7,775	02.01.2024	117.500	(1.746)	(0,09)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	7,800	04.01.2027	27.000	(524)	(0,03)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	8,075	02.01.2024	120.000	1.710	0,09
Zahlung	1-Year BRL-CDI	8,300	02.01.2024	65.600	(878)	(0,05)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	8,355	04.01.2027	54.900	(1.291)	(0,07)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	8,450	04.01.2027	102.700	(2.366)	(0,12)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	8,635	04.01.2027	65.500	1.196	0,06
Zahlung	1-Year BRL-CDI	8,640	04.01.2027	105.900	(1.933)	(0,10)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	8,675	04.01.2027	19.900	361	0,02
Erhalt	1-Year BRL-CDI	8,750	04.01.2027	282.400	5.740	0,30
Zahlung	1-Year BRL-CDI	8,805	04.01.2027	37.700	(787)	(0,04)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	9,020	02.01.2023	98.600	(463)	(0,02)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	9,490	04.01.2027	104.000	(1.765)	(0,09)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	9,600	04.01.2027	48.900	804	0,04
Zahlung	1-Year BRL-CDI	9,750	02.01.2025	17.400	(210)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	9,760	02.01.2025	51.200	(619)	(0,03)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	9,780	02.01.2024	110.500	(973)	(0,05)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,120	04.01.2027	2.100	(29)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,206	04.01.2027	8.900	(116)	(0,01)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	10,240	04.01.2027	67.300	1.073	0,06
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,300	02.01.2025	50.300	(575)	(0,03)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	10,300	04.01.2027	77.600	1.232	0,06
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,665	02.01.2024	5.500	(37)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,755	02.01.2024	20.900	(135)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,833	02.01.2024	82.000	(510)	(0,03)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,860	02.01.2023	115.200	(323)	(0,02)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,898	02.01.2024	160.100	(982)	(0,05)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,995	02.01.2024	12.900	(73)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,995	04.01.2027	54.800	(462)	(0,02)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,020	04.01.2027	43.300	(358)	(0,02)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,045	04.01.2027	53.100	(432)	(0,02)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,048	04.01.2027	82.500	(670)	(0,03)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,050	04.01.2027	58.600	(475)	(0,02)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,055	04.01.2027	53.500	(432)	(0,02)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,065	02.01.2024	43.700	(234)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,065	04.01.2027	30.400	(244)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,130	04.01.2027	31.500	(247)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,140	04.01.2027	37.700	(294)	(0,02)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,148	02.01.2024	10.900	(55)	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,445	02.01.2025	72.300	290	0,02
Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,505	02.01.2024	102.300	440	0,02
Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,515	02.01.2025	140.000	522	0,03
Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,535	02.01.2024	111.800	471	0,02
Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,540	02.01.2024	101.600	426	0,02
Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,543	02.01.2024	102.300	429	0,02
Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,708	02.01.2025	13.400	40	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,734	02.01.2025	94.900	(311)	(0,02)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,740	02.01.2025	29.300	85	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,750	02.01.2025	29.500	85	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,800	02.01.2025	93.800	(287)	(0,02)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,835	02.01.2025	93.800	(277)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,845	02.01.2025	186.600	(477)	(0,02)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,870	02.01.2025	141.600	(351)	(0,02)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,935	02.01.2025	46.100	122	0,01
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,005	02.01.2025	177.400	(457)	(0,02)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,290	02.01.2024	111.700	(88)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,425	02.01.2025	172.800	(231)	(0,01)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	1-Year BRL-CDI	12,525 %	04.01.2027	BRL 29.300	\$ 12	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	12,740	02.01.2025	133.400	(34)	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	12,765	02.01.2025	22.000	(9)	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	12,850	02.01.2025	67.400	(36)	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	13,190	02.01.2025	39.800	(58)	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	13,215	02.01.2025	40.300	(61)	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	13,400	02.01.2025	94.800	(193)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	13,995	02.01.2024	322.400	288	0,02
Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,250	21.12.2027	CNY 151.070	(32)	0,00
Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,500	16.03.2027	170.800	(265)	(0,01)
Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,625	16.12.2025	30.320	24	0,00
Erhalt	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,750	21.12.2027	30.320	2	0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	2,740	24.07.2024	COP 7.014.700	(123)	(0,01)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	3,090	26.11.2025	76.500.000	1.676	0,09
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	3,125	15.01.2026	3.301.000	79	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	3,130	17.07.2025	34.734.600	808	0,04
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	3,240	15.10.2025	77.435.000	(1.882)	(0,10)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	3,255	11.12.2025	57.933.000	1.297	0,07
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	3,620	26.11.2025	69.048.400	(1.735)	(0,09)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	3,680	03.11.2027	17.350.000	474	0,02
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	3,975	23.06.2027	11.832.300	329	0,02
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	4,005	20.08.2028	53.353.700	(1.596)	(0,08)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	4,060	26.11.2025	66.789.000	1.893	0,10
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	4,075	26.11.2025	21.848.700	621	0,03
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	4,090	26.11.2025	56.359.000	1.615	0,08
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	4,115	01.02.2031	14.558.000	397	0,02
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	4,120	01.02.2031	10.388.000	284	0,01
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	4,155	15.01.2031	5.060.000	143	0,01
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	4,690	26.11.2025	25.630.900	807	0,04
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	4,820	26.11.2025	63.629.600	(1.960)	(0,10)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	4,945	29.07.2026	35.000.000	1.224	0,06
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	5,175	28.05.2027	32.437.000	(1.189)	(0,06)
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	5,670	26.11.2025	23.575.500	(621)	(0,03)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	5,675	18.06.2031	20.000.000	881	0,05
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	5,780	04.10.2026	35.370.900	(1.099)	(0,06)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	6,130	26.10.2026	10.907.100	310	0,02
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	6,140	03.11.2027	6.325.300	200	0,01
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	6,260	03.11.2027	17.357.500	532	0,03
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	6,290	03.11.2027	17.357.500	528	0,03
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	6,355	18.11.2027	9.235.100	274	0,01
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	6,380	03.11.2027	11.709.000	348	0,02
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	6,630	07.10.2031	12.820.000	(484)	(0,03)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	6,640	11.01.2027	31.028.800	804	0,04
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	6,650	03.11.2027	26.004.000	717	0,04
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	6,660	07.10.2031	6.347.000	(237)	(0,01)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	6,670	11.01.2027	47.000.000	1.208	0,06
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	6,690	07.10.2031	6.347.000	(235)	(0,01)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	6,885	31.01.2025	40.172.000	694	0,04
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	7,040	25.01.2027	30.993.600	712	0,04
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	7,080	02.02.2027	9.610.900	217	0,01
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	7,090	28.04.2028	1.944.500	49	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	7,130	31.01.2027	14.472.000	322	0,02
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	7,130	28.04.2028	687.200	16	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	7,140	01.02.2027	29.583.000	657	0,03
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	7,140	28.04.2028	2.061.800	48	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	7,380	21.01.2029	9.688.000	232	0,01
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	7,500	15.02.2025	22.196.000	325	0,02
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	7,585	14.02.2027	35.037.000	(663)	(0,03)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	7,855	22.02.2025	13.754.500	180	0,01
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	7,860	26.08.2026	12.602.700	204	0,01
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	7,890	08.04.2027	21.093.600	366	0,02
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	7,913	08.04.2027	32.467.300	558	0,03
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	7,940	08.04.2027	16.342.600	278	0,01
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,020	08.04.2025	53.651.900	710	0,04
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,200	11.03.2027	45.342.000	(649)	(0,03)
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,240	15.03.2027	15.813.700	(222)	(0,01)
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,320	31.03.2027	10.203.000	(135)	(0,01)
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,360	02.06.2027	58.618.000	(788)	(0,04)
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,560	30.03.2027	4.356.600	(51)	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,610	26.11.2025	15.715.400	172	0,01
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,686	30.03.2027	25.932.000	(279)	(0,01)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,720	26.11.2025	23.335.000	242	0,01
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,960	09.06.2025	64.923.500	(565)	(0,03)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	9,055	26.08.2026	16.741.600	145	0,01
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	9,177	26.11.2025	18.899.000	150	0,01
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	9,270	26.11.2025	34.576.000	258	0,01
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	9,310	26.11.2025	40.887.100	297	0,02
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	9,325	12.07.2027	45.452.000	(300)	(0,02)
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	9,430	26.11.2025	77.000.000	(510)	(0,03)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	9,430	16.06.2027	26.792.900	149	0,01
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	9,470	06.07.2025	26.426.500	(176)	(0,01)
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	9,490	30.06.2032	9.544.300	(34)	0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	9,830	26.03.2031	4.395.000	2	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Local Bond Fund (Forts.)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag		Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Netto- vermögens
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	9,840 %	03.11.2027	COP	27.201.700	61	0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	9,920	13.09.2027		33.559.000	(52)	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	10,110	26.11.2025		9.311.000	28	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	10,180	03.11.2027		14.025.400	(7)	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	10,400	21.11.2029		4.122.900	(22)	0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	10,420	02.12.2027		10.311.000	26	0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	10,500	26.11.2025		49.157.500	(49)	0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	10,720	18.11.2025		45.299.900	5	0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	10,800	02.12.2025		102.940.000	61	0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	10,820	02.12.2025		25.672.100	18	0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	10,950	19.12.2024		41.386.700	(31)	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	10,990	21.11.2025		16.209.500	(25)	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	11,030	21.11.2025		15.885.200	(28)	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	11,640	21.10.2025		37.195.000	(184)	(0,01)
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	11,930	10.11.2025		19.843.000	129	0,01
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	12,000	26.11.2025		1.431.000	(10)	0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	12,060	09.11.2025		14.050.000	101	0,01
Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	3,210	17.06.2025	ILS	7.100	11	0,00
Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	1,750	15.12.2026	KRW	107.046.200	(6.173)	(0,32)
Erhalt	3-Month KRW-KORIBOR	1,750	15.12.2026		107.046.200	(372)	(0,02)
Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	1,750	15.12.2031		53.394.300	(1.935)	(0,10)
Erhalt	3-Month KRW-KORIBOR	1,750	15.12.2031		53.394.300	5.631	0,29
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	5,750	02.03.2024	ZAR	771.100	1.049	0,05
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	5,757	14.04.2026		335.500	(1.132)	(0,06)
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	6,124	08.03.2024		587.600	647	0,03
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	6,635	04.02.2027		53.800	15	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	6,956	11.03.2027		157.800	(373)	(0,02)
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	6,991	31.03.2027		215.900	(503)	(0,03)
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	7,120	26.05.2030		88.500	(405)	(0,02)
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	7,205	22.04.2027		178.200	323	0,02
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	7,210	22.04.2027		137.000	247	0,01
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	7,250	19.09.2023		142.300	(607)	(0,03)
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	7,490	06.03.2030		53.400	277	0,01
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	7,740	17.08.2027		103.100	94	0,00
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	8,180	05.07.2027		95.700	(30)	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,500	17.10.2027		177.400	231	0,01
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	1,020	01.03.2025	CLP	6.193.000	742	0,04
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	1,025	01.03.2025		6.451.000	774	0,04
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	1,030	01.03.2025		8.262.000	992	0,05
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	1,150	24.07.2025		290.500	(39)	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	1,165	14.07.2025		6.564.000	(914)	(0,05)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	1,170	14.07.2025		6.564.000	(914)	(0,05)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	1,220	14.07.2025		13.854.000	(1.950)	(0,10)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	1,470	01.03.2025		12.050.000	(1.599)	(0,08)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	1,582	02.02.2026		9.746.000	(1.377)	(0,07)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	1,684	04.06.2027		18.963.600	(1.749)	(0,09)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	1,715	04.06.2027		3.782.600	(354)	(0,02)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	1,740	09.12.2025		7.836.000	(882)	(0,05)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	1,780	17.02.2026		7.036.000	1.000	0,05
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	1,785	17.02.2026		3.197.000	455	0,02
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	1,790	17.02.2026		12.255.000	1.745	0,09
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	1,840	13.03.2025		457.000	63	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	1,935	10.03.2025		9.206.000	1.311	0,07
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	1,940	10.03.2025		4.602.900	656	0,03
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	1,947	23.11.2027		9.776.000	1.003	0,05
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	1,950	05.05.2026		5.894.100	(687)	(0,04)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	1,965	24.11.2027		8.553.000	881	0,05
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	2,080	01.06.2030		3.688.000	(288)	(0,02)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	2,110	01.06.2030		1.385.000	(110)	(0,01)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	2,120	14.07.2030		7.000.000	809	0,04
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	2,170	14.07.2030		7.199.000	846	0,04
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	2,245	10.12.2027		1.305.000	(141)	(0,01)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	2,255	10.12.2027		6.892.000	(748)	(0,04)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	2,260	10.09.2027		7.948.100	1.037	0,05
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	2,300	05.09.2026		4.789.900	701	0,04
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	2,305	10.03.2026		2.958.700	443	0,02
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	2,325	10.03.2026		1.972.500	297	0,02
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	2,335	03.09.2026		2.007.400	297	0,02
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	2,340	08.10.2027		2.970.700	363	0,02
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	2,565	27.11.2030		2.740.000	(268)	(0,01)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	2,580	05.02.2026		5.159.000	(884)	(0,05)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	2,585	27.11.2030		2.730.000	(270)	(0,01)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	2,640	01.03.2026		10.523.000	1.727	0,09
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	2,740	10.12.2030		5.395.000	(547)	(0,03)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	2,770	12.02.2031		2.650.000	(336)	(0,02)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	3,000	07.01.2030		4.970.000	(803)	(0,04)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	3,030	19.07.2025		12.024.100	(1.808)	(0,09)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	3,060	08.01.2030		4.500.000	(737)	(0,04)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	3,120	05.02.2030		1.679.000	(262)	(0,01)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	3,215	14.01.2030		9.767.400	1.642	0,09
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	3,420	01.09.2030		3.448.000	509	0,03
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	3,470	15.06.2028		17.495.300	2.226	0,12
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	3,475	19.07.2027		8.288.650	1.273	0,07

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Netto- vermögens
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	3,520 %	14.06.2028	CLP 2.761.600	\$ 344	0,02
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	3,530	06.07.2026	5.681.000	826	0,04
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	3,530	06.08.2026	6.336.400	879	0,05
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	3,640	30.04.2031	4.264.000	581	0,03
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	3,725	19.07.2028	2.502.900	379	0,02
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	3,731	20.07.2028	13.716.000	2.023	0,11
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	3,920	06.08.2028	9.384.500	1.241	0,06
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	3,990	06.07.2028	5.482.000	748	0,04
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	4,000	06.07.2028	2.901.000	388	0,02
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	4,410	01.09.2030	2.839.400	284	0,01
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	4,660	14.09.2026	3.793.000	(319)	(0,02)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	4,690	14.09.2026	1.821.600	(151)	(0,01)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	4,870	15.11.2026	3.806.000	(236)	(0,01)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	4,870	01.10.2028	3.460.000	(222)	(0,01)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	5,015	13.09.2028	1.869.500	(111)	(0,01)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	5,030	13.09.2028	6.500.000	(379)	(0,02)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,045	14.12.2026	2.269.200	110	0,01
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	5,100	15.11.2031	731.000	(19)	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	5,120	15.11.2031	731.000	(18)	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,130	01.03.2025	4.395.000	336	0,02
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,180	01.10.2028	1.905.000	86	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,240	01.09.2030	3.103.000	110	0,01
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,250	01.10.2028	7.411.400	238	0,01
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,260	01.03.2026	4.550.000	299	0,02
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,370	01.10.2028	1.735.700	59	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,400	01.10.2028	949.000	30	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,420	01.10.2028	2.094.000	64	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,460	01.10.2028	952.100	19	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,470	01.09.2030	3.420.000	60	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,570	01.10.2028	1.925.000	42	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	5,590	15.11.2032	4.589.900	74	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,600	12.12.2027	3.791.000	54	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	5,610	08.02.2027	9.105.000	(407)	(0,02)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,635	12.12.2027	7.773.000	96	0,01
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	5,640	21.11.2032	9.072.200	199	0,01
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,680	01.10.2028	2.490.200	15	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	5,755	08.03.2032	4.456.700	86	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,820	01.09.2030	5.080.500	(114)	(0,01)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	5,835	12.10.2031	1.482.900	44	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	5,865	14.01.2027	3.024.900	(112)	(0,01)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,890	17.03.2032	1.533.000	(52)	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	5,910	21.01.2027	5.517.100	(186)	(0,01)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	5,910	14.11.2032	439.400	20	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	5,920	08.10.2031	973.000	36	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,930	17.03.2032	1.533.100	(57)	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	5,940	01.03.2025	4.450.000	(243)	(0,01)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	5,975	11.02.2027	8.621.000	(231)	(0,01)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,000	11.02.2027	16.819.000	(430)	(0,02)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,000	01.10.2028	5.006.600	22	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,010	16.02.2029	2.164.000	5	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,020	02.03.2029	1.250.400	7	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,030	10.02.2027	6.830.000	(167)	(0,01)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,055	10.02.2027	4.654.000	(109)	(0,01)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	6,100	01.04.2032	1.225.000	(67)	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,110	01.09.2030	3.599.900	117	0,01
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	6,115	01.04.2032	1.273.000	(71)	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	6,120	08.03.2027	10.373.600	160	0,01
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,130	16.02.2027	2.866.000	(54)	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,140	28.06.2032	623.200	45	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,195	04.03.2027	3.008.200	(37)	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,195	04.04.2028	4.230.000	40	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,250	01.10.2028	1.580.100	31	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	6,255	08.04.2032	3.198.000	(223)	(0,01)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	6,260	08.04.2032	3.004.000	(211)	(0,01)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,270	02.03.2027	2.736.000	(26)	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	6,299	08.04.2032	3.373.000	(249)	(0,01)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	6,300	11.03.2027	10.495.100	65	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,333	05.04.2027	3.323.000	0	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	6,350	15.03.2027	1.288.500	4	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,350	04.04.2027	3.495.000	2	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,360	25.05.2027	3.858.600	46	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,370	29.06.2029	4.532.000	236	0,01
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,380	03.06.2027	9.491.000	156	0,01
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,386	24.05.2027	11.557.400	150	0,01
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,420	24.03.2029	1.107.000	40	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,460	03.11.2032	67.100	6	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,470	28.06.2027	8.573.100	211	0,01
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	6,470	01.10.2028	3.085.000	(119)	(0,01)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,480	01.04.2027	2.449.000	16	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,495	01.04.2027	2.228.000	16	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	6,500	12.12.2025	5.668.000	55	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	6,500	01.10.2028	2.650.000	(107)	(0,01)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,550	15.06.2032	2.352.600	253	0,01

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Local Bond Fund (Forts.)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variable Zinssatz	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	6,567 %	12.12.2025	CLP 2.575.000	\$ 18	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	6,580	01.10.2028	3.089.700	(139)	(0,01)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,590	16.06.2032	6.916.000	769	0,04
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,610	17.06.2032	2.813.000	320	0,02
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	6,625	04.04.2025	11.033.000	332	0,02
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	6,628	04.04.2025	16.183.000	486	0,03
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	6,635	23.03.2027	3.805.000	(45)	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	6,640	01.10.2028	1.614.000	(78)	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	6,650	01.10.2028	3.129.000	(153)	(0,01)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,650	20.07.2032	2.352.400	229	0,01
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	6,670	05.04.2025	10.709.000	306	0,02
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,670	14.06.2030	1.602.000	139	0,01
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	6,765	09.06.2027	12.547.900	(421)	(0,02)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,800	05.07.2027	6.650.000	113	0,01
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,850	01.03.2026	1.660.000	(11)	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	7,000	27.09.2032	67.900	9	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	7,030	28.03.2027	2.697.100	84	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	7,040	10.05.2027	3.264.700	(131)	(0,01)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	7,090	22.07.2029	7.495.700	(598)	(0,03)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	7,100	18.11.2024	5.248.800	103	0,01
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	7,110	15.06.2027	4.107.000	(209)	(0,01)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	7,150	15.06.2027	9.495.000	(500)	(0,03)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	7,160	16.06.2027	28.123.000	(1.499)	(0,08)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	7,160	22.06.2027	3.224.200	174	0,01
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	7,160	01.10.2028	2.439.300	182	0,01
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	7,195	01.10.2028	1.355.100	104	0,01
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	7,214	21.09.2025	8.657.000	(27)	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	7,270	15.09.2027	6.333.000	(341)	(0,02)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	7,325	23.03.2025	11.983.000	(158)	(0,01)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	7,390	15.11.2024	19.628.700	275	0,01
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	7,420	14.07.2027	595.100	30	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	7,520	25.08.2027	1.466.100	(93)	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	7,540	13.06.2025	6.833.300	59	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	7,550	21.11.2024	41.237.200	386	0,02
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	7,550	13.06.2025	6.855.400	61	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	7,610	29.08.2027	1.753.000	120	0,01
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	7,690	10.05.2025	1.573.600	9	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	7,780	14.11.2024	1.849.600	11	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	8,230	04.08.2025	6.982.600	(151)	(0,01)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	8,690	19.07.2025	10.594.100	(333)	(0,02)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	8,740	29.08.2025	1.250.000	52	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	9,135	01.03.2025	14.196.000	457	0,02
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	9,270	01.03.2025	10.647.000	381	0,02
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	9,300	01.03.2025	13.761.900	510	0,03
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	9,350	01.03.2025	3.976.300	(154)	(0,01)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	9,370	01.03.2025	4.040.000	(159)	(0,01)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	9,820	15.09.2024	9.152.900	(258)	(0,01)
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	0,650	31.03.2030	CZK 31.300	224	0,01
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	0,800	11.05.2030	468.900	3.322	0,17
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	0,929	13.03.2030	266.700	2.017	0,11
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	1,477	04.02.2030	358.600	(2.989)	(0,16)
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	1,733	08.03.2031	66.300	(596)	(0,03)
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	1,872	05.08.2026	65.000	(231)	(0,01)
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	1,890	15.01.2030	353.500	(3.110)	(0,16)
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	2,000	20.06.2028	69.000	(405)	(0,02)
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	2,015	10.08.2026	267.200	(1.019)	(0,05)
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	2,250	19.12.2023	669.100	(1.993)	(0,10)
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	2,715	20.10.2031	546.200	(527)	(0,03)
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	3,490	18.01.2032	412.200	1.760	0,09
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	3,530	27.12.2026	106.100	(243)	(0,01)
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	3,770	11.02.2027	136.000	(294)	(0,02)
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	3,930	18.01.2027	772.500	(1.679)	(0,09)
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	4,164	14.03.2027	277.100	402	0,02
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	4,220	14.03.2027	629.100	842	0,04
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	4,310	15.03.2027	103.600	119	0,01
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	4,320	15.03.2027	39.100	44	0,00
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	4,490	25.03.2027	157.050	116	0,01
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	4,560	25.03.2027	157.050	95	0,00
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	4,570	12.07.2032	24.000	33	0,00
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	4,675	20.09.2032	198.900	100	0,01
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	4,700	29.03.2027	188.300	61	0,00
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	4,700	20.09.2032	376.700	243	0,01
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	5,138	14.11.2027	201.200	(68)	0,00
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	5,180	14.11.2027	312.900	(81)	0,00
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	5,220	07.07.2027	185.200	(120)	(0,01)
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	5,340	07.07.2027	186.500	(77)	0,00
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	5,600	11.11.2027	173.400	93	0,00
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	5,606	28.06.2027	181.200	312	0,02
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	6,221	17.06.2027	354.500	1.035	0,05
Zahlung	6-Month HUF-BBR	1,500	19.06.2024	HUF 8.026.600	(3.107)	(0,16)
Zahlung	6-Month HUF-BBR	1,760	21.01.2030	1.296.900	(335)	(0,02)
Zahlung	6-Month HUF-BBR	1,770	24.02.2026	3.010.400	(2.110)	(0,11)
Zahlung	6-Month HUF-BBR	2,420	02.08.2026	3.964.700	(3.228)	(0,17)

Zahlung/ Erhalt	variabler Zinssatz	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
	variabler Zinssatzindex					
Zahlung	6-Month HUF-BBR	2,680 %	29.06.2031	HUF 1.938.800	\$ (1.572)	(0,08)
Zahlung	6-Month HUF-BBR	4,790	17.01.2027	7.857.000	(4.277)	(0,22)
Zahlung	6-Month HUF-BBR	8,670	23.05.2029	1.828.200	(251)	(0,01)
Zahlung	6-Month HUF-BBR	9,230	26.08.2032	1.440.400	(134)	(0,01)
Zahlung	6-Month HUF-BBR	9,240	02.09.2032	673.500	(64)	0,00
Zahlung	6-Month HUF-BBR	10,570	22.08.2027	5.227.600	(439)	(0,02)
Erhalt	6-Month HUF-BBR	13,550	12.12.2024	1.598.400	30	0,00
Erhalt	6-Month HUF-BBR	13,600	12.12.2024	4.521.500	76	0,00
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	0,663	25.06.2027	PLN 21.300	378	0,02
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	0,925	16.10.2030	1.500	(76)	0,00
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	1,097	25.02.2027	136.300	(4.999)	(0,26)
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	1,163	03.12.2030	32.800	(1.696)	(0,09)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	1,280	08.02.2031	23.500	1.324	0,07
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	1,460	28.05.2026	44.900	(1.484)	(0,08)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	1,490	29.08.2029	57.400	3.014	0,16
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	1,930	05.10.2026	59.500	(2.014)	(0,11)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	2,585	14.10.2029	15.200	615	0,03
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	2,920	13.12.2031	31.400	1.566	0,08
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	4,075	07.03.2027	82.000	1.249	0,07
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	4,135	08.02.2027	48.000	(719)	(0,04)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	4,320	09.03.2027	20.100	256	0,01
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	4,350	09.03.2027	20.100	250	0,01
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	4,885	22.03.2027	52.300	362	0,02
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	5,175	24.03.2027	38.700	152	0,01
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	5,285	25.03.2027	41.900	120	0,01
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	5,290	25.03.2027	42.300	119	0,01
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	5,340	28.03.2027	20.800	49	0,00
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	5,470	08.04.2027	64.800	62	0,00
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	5,550	08.04.2027	40.400	7	0,00
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	5,575	08.04.2027	40.400	(3)	0,00
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	5,870	22.04.2027	1.000	(3)	0,00
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	5,960	25.04.2027	67.900	(249)	(0,01)
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	5,980	13.04.2027	58.600	240	0,01
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	5,985	13.04.2027	59.400	246	0,01
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	6,010	13.04.2027	59.500	261	0,01
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	6,210	26.04.2027	19.800	(121)	(0,01)
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	6,260	25.04.2032	24.200	55	0,00
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	6,300	25.04.2028	23.400	(111)	(0,01)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	6,456	25.05.2027	40.800	(285)	(0,01)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	6,480	25.05.2027	45.100	(192)	(0,01)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	6,495	25.05.2027	37.400	(265)	(0,01)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	6,560	25.05.2027	15.800	(125)	(0,01)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	6,650	29.09.2027	38.200	(144)	(0,01)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	6,725	27.06.2027	17.900	(218)	(0,01)
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	6,745	05.07.2027	88.500	344	0,02
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	6,755	10.05.2027	47.000	540	0,03
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	6,830	19.08.2024	52.600	76	0,00
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	6,843	28.06.2027	52.600	701	0,04
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	6,890	22.08.2024	119.500	140	0,01
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	6,940	09.06.2027	95.100	1.325	0,07
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	7,310	30.06.2027	37.000	(664)	(0,03)
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	7,725	23.06.2027	43.700	959	0,05
Zahlung	28-Day MXN-TIE	4,610	27.06.2024	MXN 496.500	(1.171)	(0,06)
Erhalt	28-Day MXN-TIE	5,405	26.12.2030	740.000	3.022	0,16
Zahlung	28-Day MXN-TIE	5,445	05.12.2030	199.200	(820)	(0,04)
Zahlung	28-Day MXN-TIE	5,540	31.12.2030	143.700	(596)	(0,03)
Erhalt	28-Day MXN-TIE	5,590	03.07.2030	172.600	705	0,04
Erhalt	28-Day MXN-TIE	5,610	03.07.2030	393.000	1.612	0,08
Zahlung	28-Day MXN-TIE	5,865	13.06.2030	226.900	(1.002)	(0,05)
Zahlung	28-Day MXN-TIE	5,870	12.06.2030	116.800	(517)	(0,03)
Zahlung	28-Day MXN-TIE	5,880	13.06.2030	140.000	(620)	(0,03)
Erhalt	28-Day MXN-TIE	5,893	05.06.2030	282.900	1.220	0,06
Erhalt	28-Day MXN-TIE	5,940	23.05.2030	82.600	365	0,02
Zahlung	28-Day MXN-TIE	5,980	12.02.2031	111.200	(489)	(0,03)
Zahlung	28-Day MXN-TIE	5,990	12.02.2031	264.600	(1.164)	(0,06)
Erhalt	28-Day MXN-TIE	6,040	02.05.2030	87.300	389	0,02
Zahlung	28-Day MXN-TIE	6,040	12.02.2031	951.600	(4.223)	(0,22)
Erhalt	28-Day MXN-TIE	6,060	16.05.2030	102.300	466	0,02
Erhalt	28-Day MXN-TIE	6,095	29.05.2030	18.700	84	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIE	6,260	07.06.2040	139.400	566	0,03
Erhalt	28-Day MXN-TIE	6,288	25.04.2030	230.700	1.078	0,06
Zahlung	28-Day MXN-TIE	6,380	25.02.2025	89.900	(361)	(0,02)
Erhalt	28-Day MXN-TIE	6,380	05.06.2040	146.300	612	0,03
Erhalt	28-Day MXN-TIE	6,430	04.06.2040	88.600	375	0,02
Erhalt	28-Day MXN-TIE	6,435	18.05.2040	61.000	256	0,01
Erhalt	28-Day MXN-TIE	6,463	18.05.2040	76.000	321	0,02
Erhalt	28-Day MXN-TIE	6,465	26.09.2040	94.900	402	0,02
Erhalt	28-Day MXN-TIE	6,480	28.05.2040	342.800	1.484	0,08
Zahlung	28-Day MXN-TIE	6,510	24.02.2025	692.800	(2.847)	(0,15)
Erhalt	28-Day MXN-TIE	6,540	31.05.2040	240.300	1.049	0,05
Erhalt	28-Day MXN-TIE	6,545	30.05.2040	75.100	329	0,02
Erhalt	28-Day MXN-TIE	6,550	04.04.2031	160.200	779	0,04
Zahlung	28-Day MXN-TIE	6,600	13.01.2025	341.200	(1.388)	(0,07)

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Local Bond Fund (Forts.)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	6,600 %	26.02.2030	MXN 41.200	\$ 202	0,01
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	6,623	17.05.2040	132.400	580	0,03
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	6,630	31.03.2031	272.600	1.348	0,07
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	6,635	31.03.2031	330.000	1.633	0,09
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	6,678	29.05.2031	445.400	(2.782)	(0,15)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	6,715	30.05.2031	473.100	(2.899)	(0,15)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	6,755	29.04.2031	226.900	1.142	0,06
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	7,065	26.12.2039	142.800	693	0,04
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	7,070	27.08.2031	283.800	1.452	0,08
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	7,100	13.06.2031	316.400	1.828	0,10
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,127	10.08.2039	204.800	(1.009)	(0,05)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	7,180	31.10.2039	118.500	589	0,03
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	7,200	31.10.2039	102.500	512	0,03
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	7,210	28.10.2039	49.700	249	0,01
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	7,253	28.10.2039	99.600	502	0,03
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,418	27.10.2031	52.300	(219)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,525	26.09.2031	214.200	(798)	(0,04)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,533	07.01.2027	173.300	(420)	(0,02)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,600	08.10.2031	66.300	(236)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,625	12.07.2039	163.200	(883)	(0,05)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,640	13.07.2039	117.200	(635)	(0,03)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	7,643	18.11.2031	158.900	542	0,03
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,650	24.09.2031	32.600	(109)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,650	29.09.2031	30.420	(104)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,675	09.06.2039	438.200	(2.397)	(0,13)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,690	16.10.2031	90.000	(293)	(0,02)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	7,784	13.11.2031	445.300	1.328	0,07
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	7,800	13.11.2031	120.600	354	0,02
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,875	17.02.2032	189.800	(531)	(0,03)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,885	27.05.2039	470.900	(2.649)	(0,14)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,895	21.02.2040	200.000	(1.126)	(0,06)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,900	19.02.2032	144.300	(391)	(0,02)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,950	20.02.2032	151.500	(385)	(0,02)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,990	17.02.2040	15.800	(90)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,035	31.05.2029	232.700	427	0,02
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,050	24.02.2032	237.500	(524)	(0,03)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,080	31.05.2029	122.500	211	0,01
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,103	04.01.2038	6.300	37	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,120	04.03.2027	321.700	452	0,02
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,135	31.05.2029	80.900	128	0,01
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,140	04.03.2027	176.100	241	0,01
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,180	04.03.2027	287.900	373	0,02
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,300	17.02.2040	123.300	(742)	(0,04)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,320	07.01.2032	195.200	(1.217)	(0,06)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,414	14.12.2027	310.400	269	0,01
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,431	24.05.2027	575.800	486	0,03
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,465	16.08.2027	38.900	30	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,515	17.12.2027	198.600	128	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,680	30.03.2032	234.300	(41)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,700	05.11.2027	36.700	(11)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,740	30.08.2027	147.500	(31)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,743	05.11.2027	160.400	(35)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,750	05.04.2024	914.300	756	0,04
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,750	30.08.2027	292.200	(56)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,760	05.11.2027	107.500	(20)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,773	05.11.2027	159.300	(25)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,915	04.03.2027	55.800	(1)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,940	22.05.2024	1.038.700	1.131	0,06
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,975	03.06.2027	173.600	33	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	9,018	07.07.2027	175.100	(53)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	9,045	04.11.2027	86.800	34	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	9,053	04.11.2027	95.000	39	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	9,060	18.06.2027	319.300	(110)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	9,070	04.06.2026	86.800	3	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	9,090	08.07.2027	202.800	(90)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	9,117	04.11.2027	237.200	128	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	9,165	05.11.2026	128.900	45	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	9,260	04.10.2032	20.900	(36)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	9,335	02.08.2023	1.952.800	1.038	0,05
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	9,350	13.10.2032	82.400	169	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	9,360	11.10.2027	170.300	175	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	9,470	11.10.2032	66.300	162	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	9,500	03.07.2023	3.190.100	(1.325)	(0,07)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	9,525	22.09.2027	95.400	127	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	9,580	30.06.2023	1.796.800	(679)	(0,04)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	9,600	21.09.2027	86.200	128	0,01
					\$ (19.792)	(1,03)
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					\$ (19.800)	(1,03)

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

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

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

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

OPTIONSKAUF

DEISENOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Put – OTC EUR versus CZK	CZK	23,830	01.11.2023	3.137	\$ 327	\$ 595 0,03
	Call – OTC USD versus INR	INR	92,600	16.06.2025	2.200	132	43 0,00
GLM	Put – OTC USD versus INR		92,600	16.06.2025	2.200	132	168 0,01
	Put – OTC EUR versus HUF	HUF	385,000	01.11.2023	788	105	112 0,01
JPM	Put – OTC EUR versus PLN	PLN	4,560	01.11.2023	3.150	349	479 0,02
	Call – OTC AUD versus USD	\$	0,735	04.05.2023	3.540	213	354 0,02
MBC	Put – OTC EUR versus HUF	HUF	385,000	01.11.2023	1.581	151	224 0,01
	Put – OTC USD versus MXN	MXN	18,310	04.05.2023	2.143	214	156 0,01
MYI	Put – OTC USD versus BRL	BRL	4,450	04.05.2023	2.082	208	64 0,00
	Put – OTC USD versus ZAR	ZAR	15,925	04.05.2023	2.082	208	374 0,02
						\$ 2.039	\$ 2.569 0,13

VERKAUFSOPTIONEN

DEISENOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
MYI	Call – OTC USD versus MXN	MXN	20,500	28.02.2023	18.449	\$ (187)	\$ (118) (0,01)

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
GLM	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,067 %	09.06.2023	5.300	\$ (67)	\$ (14)	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	3,140	09.06.2023	5.300	(71)	(173)	(0,01)
							\$ (138)	\$ (187)	(0,01)

(1) Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag ⁽²⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Montenegro Government International Bond	1,000 %	20.06.2023	€ 800	\$ (62)	\$ 51	\$ (11)	0,00
BPS	Poland Government International Bond	1,000	20.12.2023	\$ 500	2	0	2	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2023	1.800	(3)	6	3	0,00
BRC	Turkey Government International Bond	1,000	20.12.2024	16.200	(1.920)	951	(969)	(0,05)
CBK	Turkey Government International Bond	1,000	20.12.2024	3.500	(405)	196	(209)	(0,01)
DUB	Turkey Government International Bond	1,000	20.12.2024	2.900	(335)	161	(174)	(0,01)
GST	Poland Government International Bond	1,000	20.12.2023	1.200	4	1	5	0,00
JPM	Turkey Government International Bond	1,000	20.12.2024	3.100	(361)	176	(185)	(0,01)
	Ghana Government International Bond	5,000	20.06.2024	1.400	4	(926)	(922)	(0,05)
MYC	Turkey Government International Bond	1,000	20.12.2024	2.900	(332)	159	(173)	(0,01)
						\$ (3.408)	\$ 775	\$ (2.633) (0,14)

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

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

CROSS-CURRENCY SWAPS

Kontrahent	Erhalt	Zahlung	Fälligkeits-datum	Nennbetrag erhaltener Währung	Nennbetrag gelieferter Währung	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
GLM	Variabler Zinssatz entspricht 6-Month USD-LIBOR zzgl. 0,330 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 6-Month ARS-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	28.05.2024	USD 1.900	ARS 85.633	\$ 0	\$ 1.750	\$ 1.750	0,09

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Local Bond Fund (Forts.)

Kontrahent	Erhalt	Zahlung	Fälligkeits- datum	Nennbetrag erhaltener Währung	Nennbetrag gelieferter Währung	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Netto- vermögens
SCX	Variabler Zinssatz entspricht 6-Month USD-LIBOR zzgl. 0,333 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 6-Month ARS-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	30.05.2024	USD 4.820	ARS 214.249	\$ (15)	\$ 4.456	\$ 4.441	0,23
	Variabler Zinssatz entspricht 6-Month USD-LIBOR zzgl. 0,282 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 6-Month ARS-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	07.06.2027	2.090	93.789	(3)	1.946	1.943	0,10
	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month IDR-LIBOR zzgl. 0,067% basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	23.09.2029	18.851	IDR 283.145.680	47	(87)	(40)	0,00
						\$ 29	\$ 8.065	\$ 8.094	0,42

ZINSSWAPS

Kontrahent	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Netto- vermögens
BOA	Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	0,295 %	08.09.2025	ILS 89.000	\$ 0	\$ 2.213	\$ 2.213	0,11
	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	0,680	08.09.2030	44.500	0	(2.475)	(2.475)	(0,13)
	Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	0,800	24.04.2028	120.000	0	4.658	4.658	0,24
	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	1,963	16.02.2028	21.300	0	(397)	(397)	(0,02)
	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	1,998	20.06.2028	13.700	0	(280)	(280)	(0,02)
	Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	0,795	20.06.2028	32.000	0	1.245	1.245	0,06
BRC	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	1,950	20.06.2028	34.500	0	(732)	(732)	(0,04)
	Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	3,300	21.06.2029	CLP 3.450.000	0	539	539	0,03
BSH	Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	3,750	22.03.2026	8.000.000	0	(964)	(964)	(0,05)
	Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	3,790	14.03.2026	3.885.000	7	(476)	(469)	(0,02)
CBK	Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	5,960	10.05.2029	COP 27.236.900	0	1.028	1.028	0,05
	Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	0,485	09.08.2024	ILS 68.500	0	1.064	1.064	0,05
	Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	0,950	23.05.2024	122.500	0	1.287	1.287	0,07
	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	1,041	15.05.2024	101.800	0	(1.010)	(1.010)	(0,05)
	Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	3,763	24.05.2029	CLP 1.841.700	11	(247)	(236)	(0,01)
	Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	3,770	19.03.2026	64.800	0	(8)	(8)	0,00
CKL	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	2,100	20.06.2028	ILS 14.000	(46)	(219)	(265)	(0,01)
DUB	Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	0,690	27.09.2027	20.100	0	720	720	0,04
GLM	Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,708	02.01.2025	BRL 18.800	0	56	56	0,00
	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	0,235	15.01.2023	ILS 198.900	0	(314)	(314)	(0,02)
	Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	0,520	12.08.2024	93.500	0	1.434	1.434	0,07
	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	0,540	11.05.2027	11.600	0	(411)	(411)	(0,02)
	Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	0,720	20.06.2028	8.800	0	352	352	0,02
	Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	0,820	15.01.2030	43.800	0	2.136	2.136	0,11
	Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	0,950	23.05.2024	75.700	0	795	795	0,04
	Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	0,960	24.05.2024	70.700	0	736	736	0,04
	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	1,048	27.02.2024	132.400	0	(974)	(974)	(0,05)
	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	1,883	21.03.2028	28.100	0	(558)	(558)	(0,03)
	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	1,898	17.12.2025	57.400	0	(819)	(819)	(0,04)
	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	1,971	16.02.2028	43.600	0	(806)	(806)	(0,04)
	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	1,998	20.06.2028	28.300	0	(579)	(579)	(0,03)
	Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	2,990	01.08.2029	CLP 2.813.100	0	(586)	(586)	(0,03)
	Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	3,015	20.06.2026	5.555.000	0	710	710	0,04
	Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	3,265	14.06.2029	4.122.200	0	(636)	(636)	(0,03)
	Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	3,830	22.05.2029	7.729.900	0	(949)	(949)	(0,05)
	Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	4,095	01.06.2027	12.230.000	0	(1.157)	(1.157)	(0,06)
	Zahlung ⁽¹⁾	6-Month CLP-CHILIBOR	4,319	22.05.2029	19.808.000	0	(322)	(322)	(0,02)
	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	1,018	11.03.2024	ILS 82.600	0	(622)	(622)	(0,03)
HUS	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	1,018	15.05.2024	91.500	0	(920)	(920)	(0,05)
	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	1,998	20.06.2028	14.900	1	(306)	(305)	(0,02)
JPM	Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	0,475	09.08.2024	71.500	0	1.115	1.115	0,06
	Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	0,813	20.06.2028	18.100	0	699	699	0,04
	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	1,027	19.03.2024	37.000	0	(278)	(278)	(0,01)
	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	1,095	10.05.2024	19.800	0	(191)	(191)	(0,01)
	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	2,078	20.06.2028	12.600	0	(242)	(242)	(0,01)
	Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	3,540	04.06.2029	CLP 4.115.000	0	581	581	0,03
MYC	Zahlung	1-Year BRL-CDI	7,800	04.01.2027	BRL 12.200	17	(209)	(192)	(0,01)
						\$ (10)	\$ 3.681	\$ 3.671	0,19

⁽¹⁾ Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

VOLATILITÄTSSWAPS

Kontrahent	Zahlung/ Erhalt Volatilität	Referenzinheit	Volatilität Ausübungskurs	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Gezahlt/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Netto- vermögens
GLM	Zahlung	USD versus JPY 1-Year ATM Realized Volatility ⁽¹⁾	12,025 %	20.06.2023	\$ 320	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00

(1) Varianz-Swap.

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Netto- vermögens		
BOA	01.2023	CNH	297.323	\$ 46.075	\$ 3.048	\$ 3.048	0,16		
	01.2023	€	103	110	0	0	0,00		
	01.2023	HUF	1.205.335	3.077	0	(135)	(0,01)		
	01.2023	¥	7.646.000	53.472	0	(4.523)	(4,523)	(0,24)	
	01.2023	MYR	656.557	147.529	0	(1.609)	(1.609)	(0,08)	
	01.2023	PEN	182.650	46.942	105	(977)	(872)	(0,05)	
	01.2023	PLN	1.423	324	0	0	0	0,00	
	01.2023	RON	2.756	545	0	(50)	(50)	0,00	
	01.2023	\$	59.989	HUF 27.145.024	12.143	0	12.143	0,64	
	01.2023	253.317	MYR 1.122.954	1.931	0	1.931	0,10		
	01.2023	218	PLN 965	2	0	2	0,00		
	02.2023	CHF	151	\$ 159	0	(4)	(4)	0,00	
	02.2023	€	23.212	24.735	0	(109)	(109)	(0,01)	
	02.2023	NOK	2.011	203	0	(2)	(2)	0,00	
	02.2023	\$	46.029	CNH 297.323	0	(2.894)	(2.894)	(0,15)	
	02.2023	30.034	€ 28.334	292	0	292	0,02		
	02.2023	2.232	ZAR 40.708	152	0	152	0,01		
	03.2023	CLP	2.087.832	\$ 2.407	0	(21)	(21)	0,00	
	03.2023	\$	2.197	CLP 1.946.103	66	0	66	0,00	
	03.2023	2.108	IDR 32.829.360	14	0	14	0,00		
	03.2023	4.476	MXN 88.943	31	0	31	0,00		
	03.2023	30.526	ZAR 539.003	969	0	969	0,05		
	04.2023	PLN	69.105	€ 13.725	0	(839)	(839)	(0,04)	
	05.2023	€	3.205	CZK 80.981	107	0	107	0,01	
	05.2023	\$	2.762	ZAR 50.751	189	0	189	0,01	
	03.2030	12.534	IDR 246.110.438	650	0	650	0,03		
	BPS	01.2023	BRL	296.178	\$ 56.738	641	0	641	0,03
		01.2023	HUF	3.934.842	10.122	0	(347)	(347)	(0,02)
		01.2023	ILS	22.130	6.456	181	0	181	0,01
		01.2023	MYR	454.368	102.070	0	(1.158)	(1.158)	(0,06)
		01.2023	PEN	18.435	4.771	0	(63)	(63)	0,00
		01.2023	RON	17.688	3.439	0	(375)	(375)	(0,02)
		01.2023	THB	1.387.787	40.249	121	0	121	0,01
		01.2023	\$	1.857	BRL 9.838	6	0	6	0,00
		01.2023	633	CLP 555.304	19	0	19	0,00	
01.2023		45.468	CNH 297.323	0	(2.441)	(2.441)	(0,13)		
01.2023		1.834	CZK 45.940	195	0	195	0,01		
01.2023		556	HUF 211.060	5	0	5	0,00		
01.2023		124.235	MYR 558.334	3.451	0	3.451	0,18		
01.2023		17.326	PHP 963.494	16	0	16	0,00		
01.2023		2.857	PLN 13.749	276	0	276	0,01		
01.2023		156	THB 5.407	0	0	0	0,00		
02.2023		€	62.802	\$ 65.122	0	(2.097)	(2.097)	(0,11)	
02.2023		\$	56.387	BRL 296.178	0	(596)	(596)	(0,03)	
03.2023		CLP	26.851.347	\$ 27.807	0	(3.372)	(3.372)	(0,18)	
03.2023		COP	16.292.726	3.467	152	0	152	0,01	
03.2023		INR	86.452	1.042	3	0	3	0,00	
03.2023		MXN	74.003	3.662	0	(84)	(84)	0,00	
03.2023		MYR	855.046	185.396	0	(10.845)	(10.845)	(0,57)	
03.2023		TWD	3.953	131	2	0	2	0,00	
03.2023		\$	24.556	CNY 169.655	109	0	109	0,01	
03.2023		38.812	COP 189.180.037	29	0	(346)	(346)	(0,02)	
03.2023		23.182	MXN 458.485	131	0	(109)	22	0,00	
03.2023		9.246	PEN 35.930	115	0	0	115	0,01	
03.2023		40.505	THB 1.387.787	0	(163)	(163)	(0,01)		
03.2023		ZAR	15.161	\$ 833	0	(53)	(53)	0,00	
04.2023		CLP	5.294.110	5.697	0	(418)	(418)	(0,02)	
05.2023		€	1.122	CZK 29.415	84	0	84	0,00	
11.2023		ILS	31.394	\$ 9.118	41	(5)	36	0,00	
BRC		01.2023	CLP	15.651.214	18.178	0	(179)	(179)	(0,01)
		01.2023	CZK	5.968	244	0	(20)	(20)	0,00
	01.2023	MYR	217.982	46.207	0	(3.653)	(3.653)	(0,19)	
	01.2023	PHP	936.999	16.787	0	(79)	(79)	0,00	
	01.2023	PLN	1.526	304	0	(44)	(44)	0,00	
	01.2023	SGD	1.092	811	0	(4)	(4)	0,00	
	01.2023	\$	6.060	BRL 32.055	12	0	12	0,00	
	01.2023	9.712	CNH 67.715	87	0	87	0,00		
	01.2023	1.827	CZK 41.680	14	0	14	0,00		
	01.2023	29.130	MYR 136.247	2.034	0	2.034	0,11		
	01.2023	82.747	PLN 370.557	1.683	(1)	1.682	0,09		
	02.2023	10.513	€ 9.907	91	0	91	0,01		

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Local Bond Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Netto- vermögens		
	03.2023	\$	18.009	CLP	15.651.214	\$	191	0,01	
	03.2023		2.069	IDR	32.468.610		30	0,00	
	03.2023		4.147	PEN	16.059		36	0,00	
BSH	09.2023	ZAR	1.341.373	\$	75.949		0	(1.296)	(0,07)
	01.2023	CLP	1.730.753		1.959		0	(71)	0,00
	02.2023		1.537.729		1.717		0	(78)	0,00
	08.2023	PEN	7.590		1.898		0	(58)	0,00
CBK	01.2023	CLP	55.044.170		63.552		0	(950)	(0,05)
	01.2023	HUF	5.334.655		13.197		0	(979)	(0,05)
	01.2023	IDR	749.069		48		0	0	0,00
	01.2023	PLN	14.470		3.073		0	(224)	(0,01)
	01.2023	\$	5.362	BRL	28.928		117	0	0,01
	01.2023		37.010	CLP	35.264.834		4.351	0	0,23
	01.2023		889	HUF	363.036		75	0	0,00
	01.2023		50.332	PEN	196.458		1.110	0	0,06
	01.2023		5.189	PLN	24.424		376	0	0,02
	01.2023		8.105	THB	280.284		0	(1)	0,00
	02.2023	AUD	624	\$	418		0	(6)	0,00
	02.2023	EGP	13.438		500		0	(2)	0,00
	02.2023	PEN	69.448		17.476		0	(664)	(0,03)
	02.2023	\$	970	BRL	5.255		20	0	0,00
	02.2023		5.194	CLP	4.646.428		229	0	0,01
	02.2023		4.875	COP	23.564.304		0	(60)	0,00
	02.2023		964	EGP	27.823		76	0	0,00
	02.2023		12.532	€	11.707		0	(1)	0,00
	02.2023		4.649	PEN	18.690		229	0	0,01
	03.2023	COP	14.830.279	\$	3.241		224	0	0,01
	03.2023	ILS	24.179		7.087		200	0	0,01
	03.2023	PEN	5.437		1.386		0	(30)	0,00
	03.2023	TWD	290.213		9.551		39	0	0,00
	03.2023	\$	16.099	COP	78.395.447		0	(144)	(0,01)
	03.2023		48	IDR	749.069		1	0	0,00
	03.2023		6.290	MXN	126.385		113	0	0,01
	03.2023		3.919	PEN	15.755		190	0	0,01
	03.2023		3.386	UYU	133.920		0	(79)	0,00
	04.2023		58.357	CLP	51.154.101		727	0	0,04
	04.2023		45.665	PEN	182.662		1.827	0	0,10
	05.2023	MXN	151	\$	7		0	0	0,00
	05.2023	PEN	215.745		54.938		0	(1.053)	(0,05)
	07.2023	ILS	20.463		5.930		54	0	0,00
	07.2023	\$	4.787	EGP	90.000		0	(1.647)	(0,09)
	11.2023	ILS	37.683	\$	11.421		521	0	0,03
	11.2023	\$	181	EGP	5.845		16	0	0,00
CLY	01.2023	HUF	4.897.557	\$	12.448		0	(604)	(0,03)
	01.2023	MYR	100.000		21.157		0	(1.716)	(0,09)
	01.2023	\$	59.382	MYR	280.694		4.821	0	0,25
	03.2023		4.269	PEN	16.423		9	0	0,00
	11.2023	€	1.739	HUF	805.467		96	0	0,01
DUB	01.2023	RON	8.759	\$	1.748		0	(141)	(0,01)
	01.2023	TRY	73.639		3.599		0	(305)	(0,02)
	02.2023	EGP	10.906		402		0	(4)	0,00
	02.2023	€	6.655		6.951		0	(172)	(0,01)
	02.2023	ZAR	111.056		6.650		145	0	0,01
	03.2023	MXN	17.616		883		0	(9)	0,00
	03.2023	PEN	4.455		1.132		0	(29)	0,00
	11.2023	EGP	14.282		501		19	0	0,00
GLM	01.2023	BRL	328.513		62.268		216	(170)	0,00
	01.2023	CLP	8.704.593		9.492		0	(717)	(0,04)
	01.2023	COP	24.795.094		5.126		18	0	0,00
	01.2023	CZK	46.471		1.840		0	(212)	(0,01)
	01.2023	HUF	4.602.432		11.757		0	(498)	(0,03)
	01.2023	MYR	65.439		13.965		0	(1.003)	(0,05)
	01.2023	PLN	70.679		14.321		0	(1.782)	(0,09)
	01.2023	\$	10.326	BRL	55.112		113	0	0,01
	01.2023		24.773	CLP	24.375.964		3.800	0	0,20
	01.2023		10.538	CNH	73.335		74	0	0,00
	01.2023		38.423	COP	186.274.890		0	(53)	0,00
	01.2023		426	CZK	9.913		12	0	0,00
	01.2023		46	HKD	362		0	0	0,00
	01.2023		2.306	HUF	894.606		71	0	0,00
	01.2023		29.436	MYR	137.579		2.033	0	0,11
	01.2023		1.413	PLN	6.558		81	0	0,00
	01.2023		1.995	RON	9.456		44	0	0,00
	01.2023		71.147	THB	2.479.750		555	0	0,03
	02.2023	COP	42.009.794	\$	8.603		209	(191)	0,00
	02.2023	DOP	941.273		17.023		406	0	0,02
	02.2023	\$	59.902	BRL	317.822		172	(206)	0,00
	02.2023		7.629	EGP	220.376		567	0	0,03
	02.2023		44.267	MXN	905.063		1.894	0	0,10
	03.2023	CLP	29.828.275	\$	32.742		0	(1.943)	(0,10)
	03.2023	COP	272.651.216		56.277		794	0	0,04
	03.2023	MXN	1.018.547		49.890		0	(1.659)	(0,09)
	03.2023	\$	10.319	COP	49.824.723		0	(180)	(0,01)
	03.2023		15.645	IDR	244.526.150		162	0	0,01

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Netto- vermögens
	04.2023	DOP	299.685	\$ 5.448	\$ 217	\$ 217	0,01
	04.2023	\$	229	MXN 4.598	3	3	0,00
	05.2023		3.491	PEN 14.127	177	177	0,01
	05.2023	ZAR	124.117	\$ 7.427	210	210	0,01
	07.2023	EGP	188.808	7.215	657	657	0,03
	11.2023		14.312	501	18	18	0,00
	11.2023	\$	747	EGP 22.633	16	16	0,00
HUS	07.2023	EGP	469.250	\$ 25.000	8.627	8.627	0,45
IND	06.2024	\$	7.206	TWD 185.403	0	(834)	(0,04)
JPM	01.2023	£	7.576	\$ 9.148	34	34	0,00
	01.2023	HUF	5.338.049	13.515	0	(694)	(0,04)
	01.2023	PHP	1.648	30	0	0	0,00
	01.2023	TRY	40.626	2.108	0	(46)	0,00
	01.2023	\$	97.145	BRL 512.802	27	(46)	0,00
	01.2023		19.492	CNY 135.667	157	0	0,01
	01.2023		6.906	IDR 108.836.219	103	0	0,01
	01.2023		2.771	MXN 55.232	57	0	0,00
	01.2023		4.493	RON 22.078	268	0	0,01
	01.2023		7.204	TRY 137.056	62	0	0,00
	02.2023	EGP	203.372	\$ 7.454	0	(110)	(0,01)
	02.2023	MXN	738.855	36.119	0	(1.565)	(0,08)
	02.2023	TWD	77.233	2.544	21	21	0,00
	03.2023	COP	8.107.706	1.766	116	116	0,01
	03.2023	IDR	108.953.618	6.906	0	(137)	(0,01)
	03.2023	MXN	17.616	882	0	(9)	0,00
	03.2023	\$	10.472	CNY 72.446	60	0	0,00
	03.2023		27.114	IDR 424.536.831	329	0	0,02
	03.2023		36.119	MXN 744.652	1.568	0	0,08
	03.2023		13.242	PEN 51.368	140	0	0,01
	03.2023	ZAR	40.981	\$ 2.352	0	(43)	0,00
	06.2023	\$	238	VND 5.712.000	0	0	0,00
	11.2023	HUF	806.200	€ 1.739	0	(98)	(0,01)
	03.2030	IDR	252.540.875	\$ 12.118	0	(1.410)	(0,07)
MBC	03.2030	\$	11.598	IDR 246.110.438	1.586	0	0,08
	01.2023	CLP	989.172	\$ 1.107	0	(53)	0,00
	01.2023	CNH	13.781	1.979	0	(15)	0,00
	01.2023	£	6.876	8.367	94	0	0,01
	01.2023	¥	199.600	1.473	0	(41)	0,00
	01.2023	MYR	51.983	11.089	0	(802)	(0,04)
	01.2023	THB	69.587	2.008	0	(4)	0,00
	01.2023	\$	2.633	CNH 18.303	16	0	0,00
	01.2023		1.610	CZK 37.519	47	0	0,00
	01.2023		6.227	£ 5.088	0	(106)	(0,01)
	01.2023		193	HKD 1.502	0	0	0,00
	01.2023		1.676	HUF 673.947	115	0	0,01
	01.2023		122	ILS 420	0	(3)	0,00
	01.2023		1.000	¥ 131.500	0	(3)	0,00
	01.2023		87.680	MYR 388.835	591	0	0,03
	01.2023		602	PEN 2.339	10	0	0,00
	01.2023		40.463	PLN 205.511	6.361	0	0,33
	02.2023	CLP	2.428.917	\$ 2.594	0	(242)	(0,01)
	02.2023	\$	3.283	EGP 94.410	248	0	0,01
	02.2023		3.441	MXN 67.378	0	(6)	0,00
	03.2023	IDR	32.934.383	\$ 2.098	0	(31)	0,00
	03.2023	MYR	27.974	5.948	0	(472)	(0,02)
	03.2023	PEN	75.862	19.666	0	(97)	(0,01)
	03.2023	THB	88.785	2.590	9	9	0,00
	03.2023	\$	1.881	COP 9.181.424	0	(13)	0,00
	03.2023		6.163	IDR 96.058.839	46	0	0,00
	05.2023		9.495	CNH 63.720	0	(196)	(0,01)
	05.2023		105	ZAR 1.892	5	0	0,00
MYI	09.2023	ZAR	158.510	\$ 8.762	0	(366)	(0,02)
	01.2023	€	6	7	0	0	0,00
	01.2023	£	12.873	15.846	359	0	0,02
	01.2023	HUF	484.472	1.119	0	(168)	(0,01)
	01.2023	IDR	108.087.150	7.005	45	0	0,00
	01.2023	MYR	278.443	58.947	0	(4.741)	(0,25)
	01.2023	PLN	3.864	813	0	(68)	0,00
	01.2023	THB	4.952	143	0	0	0,00
	01.2023	\$	4.958	CZK 122.422	449	0	0,02
	01.2023		18.237	£ 14.837	0	(386)	(0,02)
	01.2023		7.724	HUF 3.214.237	817	0	0,04
	01.2023		11.046	MYR 51.983	844	0	0,04
	01.2023		2.363	PLN 11.524	262	0	0,01
	01.2023		2.245	THB 78.008	11	0	0,00
	01.2023		600	TRY 11.904	31	0	0,00
	01.2023	ZAR	90.371	\$ 5.273	0	(36)	0,00
	02.2023	EGP	17.848	649	0	(18)	0,00
	02.2023	TWD	142.787	4.684	19	19	0,00
	02.2023	\$	13.279	ZAR 234.701	467	0	0,02
	02.2023	ZAR	155.744	\$ 8.930	0	(192)	(0,01)
	03.2023	COP	8.953.904	1.814	0	(8)	0,00
	03.2023	\$	4.948	IDR 77.601.052	68	0	0,00
	03.2023		115	MXN 2.276	0	0	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Local Bond Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	03.2023	\$	2.694	THB	92.385	\$	0
	03.2023	ZAR	363.975	\$	20.087		(1.180)
	04.2023	\$	97.473	MXN	2.020.794		4.223
	05.2023	CZK	11.554	€	438		(36)
	07.2023	\$	25.730	EGP	568.058		(5.939)
RBC	01.2023	PLN	1.384	\$	302		(14)
	01.2023	\$	297	HUF	120.716		24
	02.2023	MXN	77.533	\$	3.911		(44)
	02.2023	NOK	3.066		307		(4)
	03.2023	\$	5.780	MXN	115.957		99
	04.2023	MXN	2.071.344	\$	99.926		(4.314)
RYL	01.2023	\$	4.913	MYR	23.126		377
	02.2023	ZAR	99.971	\$	5.751		(103)
SCX	01.2023	MYR	309.850		69.986		(354)
	01.2023	PEN	8.902		2.273		(56)
	01.2023	THB	2.401.559		69.661		220
	01.2023	\$	27.572	CLP	27.007.761		4.064
	01.2023		460	KRW	608.180		23
	01.2023		72.307	MYR	319.998		862
	01.2023		4.795	PEN	18.402		30
	01.2023		29.513	THB	1.020.435		(14)
	01.2023	ZMW	35.882	\$	1.989		6
	02.2023	EGP	65.327		2.424		(19)
	02.2023	TWD	109.820		3.569		(21)
	02.2023	ZAR	9.426		510		(42)
	03.2023	AED	28.635		7.796		0
	03.2023	CLP	7.787.406		8.917		(139)
	03.2023	IDR	305.310.835		19.509		(227)
	03.2023	\$	18	CNY	126		0
	03.2023		9.862	IDR	153.912.754		87
	03.2023		71	PEN	273		0
	03.2023		70.098	THB	2.401.559		(287)
	03.2023	ZAR	118.886	\$	6.420		(526)
	04.2023	KES	101.841		764		(54)
	05.2023	\$	2.648	ZAR	46.243		41
	06.2023	CLP	23.031	\$	25		(2)
SOG	03.2030	IDR	239.680.000		10.700		(2.140)
	01.2023	RON	27.923		5.497		(524)
	03.2023	CLP	1.835.492		2.063		(71)
	03.2023	KES	79.902		617		(25)
	05.2023	CZK	19.582	€	752		(51)
	05.2023	\$	1.383	ZAR	25.231		84
SSB	01.2023	COP	161.479.796	\$	31.497		(1.765)
	01.2023	\$	11.050	MYR	51.983		841
TOR	01.2023		1.846	PEN	7.306		66
	02.2023		3.602	ZAR	65.637		243
UAG	01.2023	BRL	14.044	\$	2.617		(43)
	01.2023	CLP	5.298.881		5.938		(277)
	01.2023	CZK	74.918		3.285		(24)
	01.2023	HUF	8.165.269		20.775		(983)
	01.2023	RON	44.384		9.501		(70)
	01.2023	TRY	214.957		10.607		(768)
	01.2023	\$	32.420	CZK	824.499		3.991
	01.2023		8.995	£	7.265		(255)
	01.2023		2.858	HUF	1.127.600		139
	01.2023		10.855	TRY	205.287		6
	01.2023		5.652	TWD	146.785		(870)
	02.2023	CNH	297.323	\$	46.242		3.107
	02.2023	€	347		362		(10)
	02.2023	\$	1.887	ZAR	35.151		172
	02.2023	ZAR	2.619	\$	154		1
	03.2023	\$	3.934	MXN	78.179		27
	05.2023	€	1.928	CZK	48.788		67
	09.2023	\$	7.246	ZAR	128.361		146
	11.2023	ILS	6.376	\$	1.844		(1)
						\$	100.579
						\$	(90.871)
						\$	9.708
							0,52
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						\$	21.104
							1,10

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖGENS	
EINLAGENZERTIFIKATE				
BanColombia S.A.				
2,860 % fällig am 25.02.2024	COP	4.650.000	\$ 895	0,05
8,711 % fällig am 04.04.2023		14.801.400	3.012	0,16
12,021 % fällig am 04.08.2023		10.966.000	2.217	0,11
14,763 % fällig am 12.05.2023		4.523.900	930	0,05
Summe Einlagenzertifikate			\$ 7.054	0,37
Summe Anlagen			\$ 1.913.724	99,69
Sonstige Aktiva und Passiva			\$ 5.944	0,31
Nettovermögen			\$ 1.919.668	100,00

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

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

- ^ Das Wertpapier ist in Verzug.
- (a) Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.
- (b) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.
- (c) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.
- (d) Nullkuponwertpapier.
- (e) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.
- (f) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.
- (g) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.
- (h) Mit dem Fonds verbunden.
- (i) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2021: 2,03 %):

Emittentenbeschreibung	Kaufdatum	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
Constellation Oil Services Holding S.A. 'B'	06.10.2022	\$ 41	\$ 41	0,00
Development Bank of Southern Africa 8,600 % fällig am 21.10.2024	07.10.2021	14.861	12.807	0,67
Flourish Century 6,600 % fällig am 04.02.2049	25.08.2021	2.759	311	0,02
JPMorgan Structured Products BV 3,660 % fällig am 04.01.2027	15.06.2021	899	1.223	0,07
		\$ 18.560	\$ 14.382	0,76

- (j) Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von 86.429 USD (31. Dezember 2021: 404.051 USD) und Barmittel in Höhe von 1.840 USD (31. Dezember 2021: 6.127 USD) wurden gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen zum 31. Dezember 2022 als Sicherheiten verpfändet.

Barmittel in Höhe von 0 USD (31. Dezember 2021: 968 USD) wurden gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen zum 31. Dezember 2022 als Sicherheiten erhalten.

Barmittel in Höhe von 21.557 USD (31. Dezember 2021: 22.709 USD) wurden zum 31. Dezember 2022 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 28.320 USD (31. Dezember 2021: 13.610 USD) wurden gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. zum 31. Dezember 2022 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 1.695.287	\$ 77.697	\$ 1.772.984
Investmentfonds	131.643	0	0	131.643
Finanzderivate ⁽³⁾	739	1.315	(11)	2.043
Einlagen bei Kreditinstituten	0	3.012	4.042	7.054
Summen	\$ 132.382	\$ 1.699.614	\$ 81.728	\$ 1.913.724

Es folgt eine Zusammenfassung der wesentlichen nicht beobachtbaren Inputfaktoren, die bei der marktgerechten Bewertung der in Stufe 3 der Zeitwerthierarchie eingeordneten Vermögenswerte und Verbindlichkeiten verwendet wurden:

Kategorie und Unterkategorie	Marktwert zum 31. Dez. 2022	Bewertungstechnik	nicht beobachtbare Daten	Eingangswert(e) (% Sofern nicht anders angegeben)
Übertragbare Wertpapiere				
Stammaktien	\$ 0	Andere Bewertungstechniken	Broker-Quotierung	\$ 0,01
	41	Comparable Multiple	EBITDA	\$ 4,40
Unternehmensanleihen und Wechsel	311	Erwartete Einbringlichkeit	Diskontierungssatz	\$ 0,00–20,00
	36	Erwartete Einbringlichkeit	Basispreis	MXN 0,00
	16.697	Abgezinsten Barmittelfluss	Diskontierungssatz	BRL 0,00–9,76
	40.534	Andere Bewertungstechniken	Basispreis	\$ 98,93–101,85
Kreditbeteiligungen und -abtretungen	7.248	Indikative Marktquotierung	Broker-Quotierung	\$ 95,00
Staatsemissionen	31	Erwartete Einbringlichkeit	Basispreis	€ 29,00
	396	Erwartete Einbringlichkeit	Basispreis	\$ 33,00
	4.624	Erwartete Einbringlichkeit	Basispreis	RUB 31,00
	7.779	Drittanbieter	Broker-Quotierung	\$ 99,00
Credit Default Swaps – Schutzverkauf	(11)	Indikative Marktquotierung	Broker-Quotierung	\$ (1,36)
Einlagen bei Kreditinstituten	4.042	Proxy Pricing	Basispreis	\$ 95,90–99,56
Summen	\$ 81.728			

Die folgende Tabelle zeigt die Sensitivität der Änderungen des Marktwerts der als Anlagen der Stufe 3 eingestuften Wertpapieranlagen gegenüber einer nach vernünftigem Ermessen möglichen Änderung des Marktwerts, sollte sich der Markt um 10 % nach oben oder unten bewegt haben, unter der Annahme, dass alle anderen Variablen konstant bleiben:

Kategorie und Unterkategorie	31. Dez. 2022 Sensitivität gegenüber Änderungen des Marktwerts der Anlagen Zunahme/(Abnahme)
Übertragbare Wertpapiere	
Stammaktien	\$ 4
Unternehmensanleihen und Wechsel	5.758
Kreditbeteiligungen und -abtretungen	1.503
Staatsemissionen	505
Credit Default Swaps – Schutzverkauf	(1)
Einlagen bei Kreditinstituten	404
Summen	\$ 8.173

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Local Bond Fund (Forts.)

Level 3 Roll-forward	31. Dez. 2022
Marktwert zu Beginn des Geschäftsjahres	\$ 260.903
Käufe während des Geschäftsjahres	13.610
Verkäufe während des Geschäftsjahres	(157.479)
Übertragungen in	4.934
Übertragungen aus	(17.119)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust)	(13.437)
Nettoveränderung der nicht realisierten Wertsteigerung/(-minderung)	(9.684)
Marktwert zum Ende des Geschäftsjahres	\$ 81.728

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

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 2.063.357	\$ 260.952	\$ 2.324.309
Investmentfonds	171.278	0	0	171.278
Pensionsgeschäfte	0	591	0	591
Finanzderivate ⁽³⁾	0	26.571	(49)	26.522
Summen	\$ 171.278	\$ 2.090.519	\$ 260.903	\$ 2.522.700

⁽¹⁾ Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

⁽²⁾ Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

⁽³⁾ Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Es folgt eine Zusammenfassung der wesentlichen nicht beobachtbaren Inputfaktoren, die bei der marktgerechten Bewertung der in Stufe 3 der Zeitwerthierarchie eingeordneten Vermögenswerte und Verbindlichkeiten verwendet wurden:

Kategorie und Unterkategorie	Marktwert zum 31. Dez. 2021	Bewertungstechnik	nicht beobachtbare Daten	Eingangswert(e) (% Sofern nicht anders angegeben)
Übertragbare Wertpapiere				
Stammaktien	\$ 0	Indikative Marktquotierung	Broker-Quotierung	\$ 0,00
Unternehmensanleihen und Wechsel	17.225	Indikative Marktquotierung	Broker-Quotierung	\$ 6,25-74,36
	8.338	Referenzinstrument	Gewichteter Durchschnitt	BRL 50,47
	215.282	Referenzinstrument	Rendite	5,52-6,66
	34	Proxy Pricing	Basispreis	\$ 0,15
	—	Proxy Pricing	Basispreis	\$ 0,00
Kreditbeteiligungen und -abtretungen	20.073	Indikative Marktquotierung	Broker-Quotierung	\$ 112,01-113,72
Credit Default Swaps – Schutzverkauf	(49)	Indikative Marktquotierung	Broker-Quotierung	\$ (0,44)-(5,24)
Summen	\$ 260.903			

Die folgende Tabelle zeigt die Sensitivität der Änderungen des Marktwerts der als Anlagen der Stufe 3 eingestuften Wertpapieranlagen gegenüber einer nach vernünftigem Ermessen möglichen Änderung des Marktwerts, sollte sich der Markt um 10 % nach oben oder unten bewegt haben, unter der Annahme, dass alle anderen Variablen konstant bleiben:

Kategorie und Unterkategorie	31. Dez. 2021 Sensitivität gegenüber Änderungen des Marktwerts der Anlagen Zunahme/(Abnahme)
Übertragbare Wertpapiere	
Stammaktien	\$ 0
Unternehmensanleihen und Wechsel	24.088
Kreditbeteiligungen und -abtretungen	2.007
Credit Default Swaps – Schutzverkauf	(5)
Summen	\$ 26.090

Level 3 Roll-forward	31. Dez. 2021
Marktwert zu Beginn des Geschäftsjahres	\$ 289.170
Käufe während des Geschäftsjahres	57.544
Verkäufe während des Geschäftsjahres	(23.163)
Übertragungen in	—
Übertragungen aus	(38.524)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust)	(1.013)
Nettoveränderung der nicht realisierten Wertsteigerung/(-minderung)	(23.111)
Marktwert zum Ende des Geschäftsjahres	\$ 260.903

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions- geschäften	% des Nettovermögens
BPS	7,000 %	12.12.2022	TBD ⁽¹⁾	PLN (88.241)	\$ (20.198)	(1,05)
	8,400	12.12.2022	08.12.2024	(82.688)	(18.934)	(0,99)
	7,000	12.12.2022	TBD ⁽¹⁾	PLN (197.832)	(45.279)	(2,36)
BRC	7,500	12.12.2022	TBD ⁽¹⁾	ZAR (15.306)	(902)	(0,05)
Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte					\$ (85.313)	(4,45)

⁽¹⁾ Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung des Marktwerts der außerbörslich gehandelten Finanzderivate und (erhaltenen)/verpfändeten Sicherheiten nach Kontrahenten zum 31. Dezember 2022 und 31. Dezember 2021:

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2022			Zum 31. Dez. 2021		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾
BOA	\$ 13.050	\$ (12.520)	\$ 530	\$ 2.550	\$ (1.970)	\$ 580
BPS	(16.890)	15.580	(1.310)	10.355	(10.190)	165
BRC	(1.554)	1.440	(114)	1.066	(1.080)	(14)
BSH	(1.101)	0	(1.101)	(247)	0	(247)
BSS	0	920	920	217	0	217
CBK	6.571	(6.325)	246	(9.214)	9.960	746
CKL	(265)	0	(265)	387	0	387
CLY	2.606	0	2.606	k. A.	k. A.	k. A.
DUB	50	0	50	(55)	1.100	1.045
GLM	10.551	(10.070)	481	12.692	(11.150)	1.542
GST	(180)	190	10	k. A.	k. A.	k. A.
HUS	6.780	(6.910)	(130)	852	(1.360)	(508)
IND	(834)	(1.510)	(2.344)	(342)	360	18
JPM	1.710	(1.280)	430	11.239	(11.570)	(331)
MBC	5.248	(4.930)	318	k. A.	k. A.	k. A.
MYC	(365)	410	45	(1)	(294)	(295)
MYI	(4.865)	3.730	(1.135)	2.801	(3.190)	(389)
RBC	(4.253)	4.420	167	47	0	47
RYL	274	(260)	14	464	(280)	184
SCX	1.418	(1.120)	298	(1.236)	790	(446)
SOG	(587)	590	3	585	(390)	195
SSB	(924)	1.040	116	(1.012)	930	(82)
TOR	309	(270)	39	(340)	460	120
UAG	4.355	(4.700)	(345)	4.605	(4.570)	35

⁽¹⁾ Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2022:

	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	63,67	73,96
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	27,35	32,81
Sonstige übertragbare Wertpapiere	1,33	1,27
Investmentfonds	6,86	7,96
Pensionsgeschäfte	k. A.	0,03
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,04	k. A.
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(1,03)	(0,41)
Freiverkehrsfinanzderivate	1,10	1,65
Einlagenzertifikate	0,37	k. A.
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(4,45)	(17,42)

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2022 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
Argentinien	0,16	0,20
Aserbaidschan	0,23	k. A.
Bahamas	0,13	k. A.
Brasilien	4,48	4,08
Kaimaninseln	0,44	0,50
Chile	2,06	4,74
China	5,74	14,54
Kolumbien	3,65	6,44
Tschechische Republik	2,89	2,23
Dänemark	0,00	0,23
Dominikanische Republik	1,30	0,87
Ägypten	k. A.	2,32
Frankreich	k. A.	1,37
Deutschland	k. A.	2,23
Ungarn	0,40	1,08
Indien	k. A.	0,25
Indonesien	5,26	1,44
Irland	0,83	1,49
Israel	1,75	0,47
Italien	k. A.	0,29
Elfenbeinküste	0,38	0,42
Jersey, Kanalinseln	0,51	k. A.
Kasachstan	0,05	0,26
Luxemburg	0,01	0,01
Malaysia	9,11	8,39
Mexiko	8,11	3,56
Niederlande	0,20	0,35
Nigeria	0,22	0,24

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
Peru	2,32	3,41
Philippinen	0,04	0,90
Polen	4,79	1,81
Katar	0,92	5,22
Rumänien	3,99	3,08
Russland	0,26	5,87
Serbien	0,15	0,33
Singapur	k. A.	1,63
Südafrika	13,70	12,47
Südkorea	0,18	0,02
Spanien	k. A.	0,03
Supranational	0,37	0,47
Schweiz	k. A.	0,26
Tansania	0,49	0,64
Thailand	4,23	5,88
Türkei	0,53	1,33
Ukraine	k. A.	0,22
Vereinigte Arabische Emirate	1,60	1,25
Großbritannien	0,58	0,27
USA	2,50	3,93
Jungferninseln (Britisch)	0,31	k. A.
Sambia	k. A.	0,16
Kurzfristige Instrumente	7,48	0,86
Investmentfonds	6,86	7,96
Pensionsgeschäfte	k. A.	0,03
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,04	k. A.
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,00	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	k. A.	0,00
Zinsswaps	(1,03)	(0,41)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Devisenoptionen	0,13	0,10
Verkaufsoptionen		
Devisenoptionen	(0,01)	(0,01)
Zinsswapoption	(0,01)	k. A.
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzkauf	k. A.	0,02
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	(0,14)	(0,01)
Cross-Currency Swaps	0,42	0,33
Zinsswaps	0,19	0,30
Volatilitätswaps	0,00	0,01
Devisenterminkontrakte	0,52	0,91
Einlagenzertifikate	0,37	k. A.
Sonstige Aktiva und Passiva	0,31	(17,27)
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE			
CHILE STAATSEMISSIONEN			
Bonos de la Tesorería de la República en Pesos			
2,800 % fällig am 01.10.2033	CLP 45.000	\$ 43	0,65
4,700 % fällig am 01.09.2030	20.000	23	0,34
5,000 % fällig am 01.10.2028	60.000	68	1,03
		134	2,02
KOLUMBIEN STAATSEMISSIONEN			
Colombian TES			
7,000 % fällig am 26.03.2031	COP 1.603.200	234	3,54
TSCHECHISCHE REPUBLIK STAATSEMISSIONEN			
Czech Republic Government International Bond			
0,050 % fällig am 29.11.2029	CZK 3.400	107	1,62
0,250 % fällig am 10.02.2027	1.300	47	0,71
2,000 % fällig am 13.10.2033	2.300	77	1,17
2,400 % fällig am 17.09.2025	4.800	197	2,98
4,200 % fällig am 04.12.2036	600	24	0,36
		452	6,84
DOMINIKANISCHE REPUBLIK STAATSEMISSIONEN			
Dominican Republic Central Bank Notes			
12,000 % fällig am 03.10.2025	DOP 900	15	0,23
DEUTSCHLAND UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau			
0,625 % fällig am 25.07.2025	PLN 500	96	1,45
UNGARN STAATSEMISSIONEN			
Hungary Government International Bond			
4,000 % fällig am 28.04.2051	HUF 15.900	22	0,33
4,500 % fällig am 27.05.2032	46.600	89	1,35
5,000 % fällig am 22.02.2027	€ 30	32	0,49
		143	2,17
INDONESIEN STAATSEMISSIONEN			
Indonesia Government International Bond			
6,375 % fällig am 15.04.2042	IDR 1.175.000	68	1,03
7,000 % fällig am 15.02.2033	796.000	51	0,77
7,125 % fällig am 15.06.2042	17.000	1	0,02
8,250 % fällig am 15.05.2036	1.335.000	94	1,42
8,375 % fällig am 15.03.2034	554.000	39	0,59
8,750 % fällig am 15.05.2031	1.386.000	99	1,50
		352	5,33
ISRAEL STAATSEMISSIONEN			
Israel Government International Bond			
0,150 % fällig am 31.07.2023	ILS 500	139	2,10
1,500 % fällig am 30.11.2023	100	28	0,42
		167	2,52

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
MALAYSIEN STAATSEMISSIONEN			
Malaysia Government International Bond			
2,632 % fällig am 15.04.2031	MYR 200	\$ 41	0,62
3,582 % fällig am 15.07.2032	320	70	1,06
3,757 % fällig am 22.05.2040	200	42	0,64
4,696 % fällig am 15.10.2042	134	32	0,48
Malaysia Government Investment Issue			
3,990 % fällig am 15.10.2025	208	47	0,71
4,130 % fällig am 09.07.2029	850	194	2,94
4,369 % fällig am 31.10.2028	610	141	2,13
		567	8,58
MEXIKO STAATSEMISSIONEN			
Mexico Government International Bond			
7,500 % fällig am 03.06.2027	MXN 3.400	164	2,48
7,750 % fällig am 29.05.2031	1.300	62	0,94
8,000 % fällig am 07.11.2047	429	20	0,30
8,500 % fällig am 18.11.2038	2.100	102	1,54
		348	5,26
PERU STAATSEMISSIONEN			
Peru Government International Bond			
6,350 % fällig am 12.08.2028	PEN 300	75	1,13
6,900 % fällig am 12.08.2037	300	71	1,07
		146	2,20
POLEN STAATSEMISSIONEN			
Poland Government International Bond			
1,250 % fällig am 25.10.2030	PLN 59	9	0,14
1,750 % fällig am 25.04.2032	250	37	0,56
2,500 % fällig am 25.07.2026	500	99	1,50
2,750 % fällig am 25.10.2029	100	18	0,27
		163	2,47
RUMÄNIEN STAATSEMISSIONEN			
Romania Government International Bond			
3,250 % fällig am 29.04.2024	RON 800	165	2,50
4,150 % fällig am 26.01.2028	300	55	0,83
4,150 % fällig am 24.10.2030	200	34	0,52
4,250 % fällig am 28.04.2036	200	29	0,44
4,750 % fällig am 11.10.2034	40	6	0,09
		289	4,38
SÜDAFRIKA STAATSEMISSIONEN			
South Africa Government International Bond			
2,000 % fällig am 31.01.2025	ZAR 509	29	0,44
6,500 % fällig am 28.02.2041	3.000	111	1,68
8,000 % fällig am 31.01.2030	1.000	53	0,80
8,250 % fällig am 31.03.2032	1.700	85	1,28
8,500 % fällig am 31.01.2037	500	23	0,35
8,750 % fällig am 28.02.2048	3.900	179	2,71
10,500 % fällig am 21.12.2026	3.600	224	3,39
		704	10,65

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
SUPRANATIONAL UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Asian Development Bank			
4,700 % fällig am 12.03.2024	MXN 2.200	\$ 104	1,57
6,000 % fällig am 05.02.2026	BRL 750	123	1,86
Europäische Bank für Wiederaufbau und Entwicklung			
3,010 % fällig am 13.03.2028	PLN 600	110	1,67
5,080 % fällig am 15.12.2025	MXN 1.900	85	1,29
Inter-American Development Bank			
5,500 % fällig am 07.02.2023	IDR 2.110.000	136	2,06
Internationale Bank für Wiederaufbau und Entwicklung			
4,500 % fällig am 22.01.2026	ZAR 2.200	118	1,79
4,750 % fällig am 21.01.2027	IDR 2.880.000	174	2,63
9,750 % fällig am 21.01.2027	BRL 750	135	2,04
		985	14,91
THAILAND STAATSEMISSIONEN			
Thailand Government International Bond			
1,585 % fällig am 17.12.2035	THB 3.726	92	1,39
2,000 % fällig am 17.06.2042	180	4	0,06
3,350 % fällig am 17.06.2033	808	25	0,38
3,390 % fällig am 17.06.2037	3.900	117	1,77
3,450 % fällig am 17.06.2043	1.520	45	0,68
		283	4,28
URUGUAY STAATSEMISSIONEN			
Uruguay Government International Bond			
8,500 % fällig am 15.03.2028	UYU 3.200	74	1,12
KURZFRISTIGE INSTRUMENTE HUNGARY TREASURY BILLS			
18,250 % fällig am 03.01.2023 (a)(b)	HUF 56.000	149	2,26
ISRAEL TREASURY BILLS			
0,529 % fällig am 08.02.2023 (a)(b)	ILS 500	141	2,14
1,727 % fällig am 05.07.2023 (a)(b)	200	56	0,85
1,734 % fällig am 05.07.2023 (a)(b)	200	56	0,85
1,828 % fällig am 02.08.2023 (a)(b)	200	55	0,83
1,837 % fällig am 02.08.2023 (a)(b)	300	83	1,26
		391	5,93
JAPAN TREASURY BILLS			
(0,201) % fällig am 16.01.2023 (a)(b)	¥ 9.000	68	1,03
(0,200) % fällig am 25.01.2023 (a)(b)	10.000	76	1,15
(0,190) % fällig am 16.01.2023 (a)(b)	5.000	38	0,57
		182	2,75
U.S. TREASURY BILLS			
4,397 % fällig am 23.03.2023 (a)(b)	\$ 400	396	5,99
Summe kurzfristige Instrumente		1.118	16,93
Summe Übertragbare Wertpapiere		\$ 6.270	94,88

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

ZINSSWAPS

Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,445 %	02.01.2025	BRL 300	\$ 1	0,02
Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,515	02.01.2025	400	2	0,02
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,725	02.01.2025	1.500	(5)	(0,07)

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Local Bond ESG Fund (Forts.)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag		Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,734 %	02.01.2025	BRL	200	\$ (1)	(0,01)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,740	02.01.2025		100	0	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,750	02.01.2025		100	0	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,800	02.01.2025		300	(1)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,835	02.01.2025		300	(1)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,845	02.01.2025		600	(1)	(0,02)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,870	02.01.2025		500	(1)	(0,02)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,005	02.01.2025		500	(1)	(0,02)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,210	02.01.2025		300	(1)	(0,01)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	12,740	02.01.2025		300	0	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	12,765	02.01.2025		100	0	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	13,190	02.01.2025		200	0	(0,01)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	13,215	02.01.2025		100	0	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	13,400	02.01.2025		400	(1)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	13,800	02.01.2024		3.400	3	0,04
Zahlung	1-Year BRL-CDI	13,995	02.01.2024		900	1	0,01
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	10,400	21.11.2029	COP	18.300	0	0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	10,820	02.12.2025		70.900	0	0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	10,950	19.12.2024		4.300	0	0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	11,353	15.11.2027		169.100	2	0,02
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	12,000	26.11.2025		1.148.000	(9)	(0,13)
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	12,060	09.11.2025		378.000	4	0,04
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	12,070	26.11.2025		128.000	(1)	(0,01)
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	7,740	17.08.2027	ZAR	400	0	0,01
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	5,590	15.11.2032	CLP	10.400	0	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,600	12.12.2027		13.000	0	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,635	12.12.2027		28.000	0	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	5,640	21.11.2032		32.000	1	0,01
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,770	21.11.2027		28.300	0	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,460	03.11.2032		13.400	1	0,02
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	6,500	12.12.2025		20.000	0	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	6,567	12.12.2025		9.000	0	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	7,160	01.10.2028		3.800	0	0,01
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	7,195	01.10.2028		2.100	0	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	7,390	15.11.2024		44.400	0	0,01
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	7,550	21.11.2024		145.500	1	0,01
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	7,815	04.10.2027		32.600	(4)	(0,05)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	9,135	01.03.2025		22.000	1	0,01
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	9,155	27.10.2024		14.800	0	0,01
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	9,270	01.03.2025		17.000	1	0,01
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	9,350	01.03.2025		4.900	0	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	9,370	01.03.2025		5.000	0	0,00
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	5,138	14.11.2027	CZK	700	0	0,00
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	5,180	14.11.2027		1.300	0	(0,01)
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	5,600	11.11.2027		1.300	1	0,01
Zahlung	6-Month HUF-BBR	9,240	02.09.2032	HUF	5.200	0	(0,01)
Zahlung	6-Month HUF-BBR	10,570	22.08.2027		9.800	(1)	(0,01)
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	5,870	22.04.2027	PLN	200	3	0,03
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	6,830	19.08.2024		100	0	0,00
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	6,890	22.08.2024		300	0	0,01
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,225	28.07.2027	MXN	1.100	1	0,02
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,414	14.12.2027		1.500	1	0,02
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,465	16.08.2027		100	0	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,515	17.12.2027		700	1	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,700	05.11.2027		100	0	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,743	05.11.2027		600	0	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,750	30.08.2027		700	0	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,760	05.11.2027		400	0	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,773	05.11.2027		500	0	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,850	31.07.2024		400	0	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,975	13.08.2024		6.900	1	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	9,045	04.11.2027		200	0	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	9,053	04.11.2027		200	0	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	9,117	04.11.2027		900	1	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	9,600	21.09.2027		300	0	0,01
						\$ (1)	(0,02)
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate						\$ (1)	(0,02)

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

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

OPTIONSKAUF

DEVIENSOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
BOA	Put – OTC EUR versus CZK	CZK 23,830	01.11.2023	12	\$ 1	\$ 2	0,03
GLM	Put – OTC EUR versus HUF	HUF 385,000	01.11.2023	3	0	1	0,01
	Put – OTC EUR versus PLN	PLN 4,560	01.11.2023	12	1	2	0,03

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Kosten	Markt-wert	% des Netto- vermögens
MYI	Put – OTC USD versus BRL	BRL 4,450	04.05.2023	7	\$ 1	\$ 0	0,00
	Put – OTC USD versus ZAR	ZAR 15,925	04.05.2023	7	1	1	0,02
					\$ 4	\$ 6	0,09

VERKAUFSoPTIONEN**DEVIsoENOPTIONEN**

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Netto- vermögens
MYI	Call – OTC USD versus MXN	MXN 20,500	28.02.2023	65	\$ (1)	\$ 0	0,00

⁽¹⁾ Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISsIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag ⁽²⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Netto- vermögens
CBK	Turkey Government International Bond	1,000 %	20.12.2024	\$ 100	\$ (11)	\$ 5	\$ (6)	(0,09)

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

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

VOLATILITÄTSSWAPS

Kontrahent	Zahlung/ Erhalt Volatilität	Referenzeinheit	Volatilität Ausübungskurs	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Netto- vermögens
GLM	Zahlung	USD versus JPY 1-Year ATM Realized Volatility ⁽¹⁾	12,025 %	20.06.2023	\$ 1	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00

⁽¹⁾ Varianz-Swap

DEVIsoENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Netto- vermögens	
BOA	01.2023	HUF 35.460	\$ 91	\$ 0	\$ (4)	\$ (4)	(0,06)	
	01.2023	¥ 30.000	223	0	(5)	(5)	(0,07)	
	01.2023	MYR 4.906	1.108	0	(6)	(6)	(0,09)	
	01.2023	TRY 633	32	0	(2)	(2)	(0,03)	
	01.2023	\$ 11	BRL 57	0	0	0	0,00	
	01.2023	148	HUF 66.794	31	0	31	0,44	
	01.2023	2.079	MYR 9.213	18	0	18	0,26	
	01.2023	ZAR 1.219	\$ 69	0	(3)	(3)	(0,04)	
	02.2023	€ 85	90	0	0	0	(0,01)	
	02.2023	\$ 13	EGP 288	0	(2)	(2)	(0,03)	
	02.2023	105	€ 99	1	0	1	0,02	
	02.2023	33	£ 27	0	(1)	(1)	(0,01)	
	03.2023	MYR 2.839	\$ 626	0	(26)	(26)	(0,38)	
	03.2023	THB 241	7	0	0	0	0,00	
	03.2023	\$ 27	MXN 541	0	0	0	0,00	
	BRC	01.2023	HUF 487	\$ 1	0	0	0	0,00
		01.2023	MYR 509	116	0	0	0	0,00
		01.2023	RON 244	50	0	(3)	(3)	(0,04)
		01.2023	\$ 21	BRL 109	0	0	0	0,00
		01.2023	81	HUF 33.771	9	0	9	0,14
01.2023		147	¥ 20.000	5	0	5	0,08	
01.2023		179	MYR 840	13	0	13	0,20	
01.2023		3	PHP 152	0	0	0	0,00	
01.2023		91	RON 446	5	0	5	0,08	
01.2023		54	SGD 72	0	0	0	0,00	
01.2023		248	THB 8.635	2	0	2	0,02	
01.2023		15	ZAR 265	1	0	1	0,02	
02.2023		£ 50	\$ 62	1	0	1	0,02	
02.2023		\$ 36	€ 34	0	0	0	0,00	
03.2023		COP 164.446	\$ 33	0	0	0	0,00	
03.2023		IDR 450.672	29	0	0	0	(0,01)	
03.2023		\$ 41	IDR 639.013	0	0	0	0,01	
CBK		01.2023	COP 265.661	\$ 55	1	0	1	0,01
	01.2023	HUF 13.496	34	0	(2)	(2)	(0,03)	
	01.2023	PEN 49	12	0	0	0	(0,01)	
	01.2023	PLN 33	7	0	(1)	(1)	(0,01)	
	01.2023	TRY 112	6	0	0	0	0,00	

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Local Bond ESG Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	01.2023	\$	201	BRL 1.052	\$ 0	\$ (1)	(0,02)
	01.2023		31	COP 149.060	0	0	0,00
	01.2023		39	CZK 984	5	0	0,07
	01.2023		7	PLN 33	0	0	0,00
	01.2023		1	THB 45	0	0	0,00
	01.2023		46	TRY 891	1	0	0,02
	02.2023	BRL	31	\$ 6	0	0	0,00
	02.2023	EGP	60	2	0	0	0,00
	02.2023	£	27	33	0	0	0,01
	02.2023	ILS	497	145	4	0	0,05
	02.2023	\$	12	EGP 335	1	0	0,01
	02.2023		14	€ 13	0	0	0,00
	02.2023		93	£ 76	0	(2)	(0,03)
	02.2023		9	PEN 35	0	0	0,01
	03.2023	COP	546.480	\$ 109	0	(3)	(0,04)
	03.2023	MXN	3.068	154	0	(1)	(0,02)
	03.2023	TWD	980	32	0	0	0,00
	03.2023	\$	156	COP 766.163	1	(1)	0,00
	03.2023		9	MXN 175	0	0	0,00
	03.2023		1	TWD 42	0	0	0,00
	03.2023	UYU	2.136	\$ 54	1	0	0,02
	05.2023	\$	256	MXN 5.182	3	0	0,05
	07.2023	ILS	688	\$ 209	11	0	0,17
	08.2023		491	152	11	0	0,17
	08.2023	PEN	6	1	0	0	0,00
	11.2023	ILS	98	29	1	0	0,01
	11.2023	\$	35	EGP 1.145	3	0	0,05
GLM	01.2023	BRL	1.972	\$ 370	0	(3)	(0,05)
	01.2023	COP	546.360	113	0	0	0,01
	01.2023	CZK	2.490	101	0	(9)	(0,13)
	01.2023	HUF	21.993	56	0	(2)	(0,03)
	01.2023	MYR	383	84	0	(4)	(0,05)
	01.2023	PLN	575	119	0	(13)	(0,18)
	01.2023	RON	103	21	0	(1)	(0,02)
	01.2023	\$	140	BRL 753	3	0	0,04
	01.2023		137	COP 662.962	0	0	0,00
	01.2023		219	MYR 1.031	18	0	0,25
	01.2023		27	PEN 109	2	0	0,02
	01.2023		160	PLN 810	26	0	0,38
	01.2023		11	ZAR 189	0	0	0,00
	02.2023	EGP	292	\$ 11	0	0	0,00
	02.2023	MXN	150	7	0	0	0,00
	02.2023	\$	11	BRL 57	0	0	0,00
	02.2023		7	COP 29.966	0	0	(0,01)
	03.2023	COP	662.962	\$ 135	0	0	0,00
	03.2023	MXN	1.555	76	0	(3)	(0,04)
	03.2023	\$	73	CLP 66.408	4	0	0,06
	03.2023		49	MXN 970	0	0	0,00
	04.2023	DOP	869	\$ 16	1	0	0,01
	04.2023	\$	353	BRL 1.914	3	0	0,05
	05.2023		25	PEN 100	1	0	0,01
	07.2023	ILS	196	\$ 58	2	0	0,03
	11.2023	EGP	1.242	43	2	0	0,02
	11.2023	\$	2	EGP 75	0	0	0,00
MYI	01.2023	HUF	35.396	\$ 86	0	(8)	(0,12)
	01.2023	IDR	354.890	23	0	0	0,00
	01.2023	MYR	1.473	313	0	(25)	(0,36)
	01.2023	PEN	105	26	0	(1)	(0,02)
	01.2023	PLN	22	4	0	(1)	(0,01)
	01.2023	RON	139	28	0	(2)	(0,03)
	01.2023	\$	179	CZK 4.401	16	0	0,24
	01.2023		3	HUF 1.393	0	0	0,00
	01.2023		23	IDR 357.474	0	0	0,01
	01.2023		105	MYR 494	8	0	0,12
	01.2023		27	PEN 109	2	0	0,02
	01.2023		108	PLN 523	11	0	0,16
	01.2023		10	ZAR 184	1	0	0,01
	02.2023	EGP	275	\$ 10	0	0	0,00
	02.2023	€	30	31	0	(1)	(0,01)
	02.2023	\$	33	€ 31	0	0	0,00
	02.2023		119	TWD 3.621	0	0	(0,01)
	02.2023	ZAR	315	\$ 18	0	(1)	(0,01)
	03.2023	CLP	19.781	23	0	0	0,00
	03.2023	COP	49.360	10	0	0	0,00
	03.2023	IDR	990.047	63	0	(1)	(0,02)
	03.2023	MXN	153	8	0	0	0,00
	03.2023	\$	108	COP 528.223	1	(2)	(0,01)
	03.2023		7	TWD 211	0	0	0,00
SCX	01.2023	¥	14.000	\$ 98	0	(9)	(0,13)
	01.2023	MYR	1.471	332	0	(2)	(0,03)
	01.2023	PEN	181	45	0	(2)	(0,04)
	01.2023	RON	31	7	0	0	0,00

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Netto- vermögens	
	01.2023	THB	12.144	\$ 352	\$ 1	\$ 0	0,02	
	01.2023	TRY	1.363	67	0	(5)	(0,07)	
	01.2023	\$	347	MYR 1.535	4	0	0,06	
	01.2023		100	THB 3.464	0	0	0,00	
	01.2023		44	TRY 832	0	0	0,00	
	02.2023	ZAR	2.589	\$ 144	0	(8)	(0,12)	
	03.2023	MYR	825	179	0	(12)	(0,16)	
	03.2023	\$	55	IDR 862.688	1	0	0,01	
	03.2023		354	THB 12.144	0	(1)	(0,02)	
	04.2023	ZAR	440	\$ 24	0	(2)	(0,03)	
					\$ 236	\$ (181)	\$ 55	0,83
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						\$ 55	0,83	

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖGENS
EINLAGENZERTIFIKATE			
BanColombia S.A. 2,860 % fällig am 25.02.2024	COP 20.000	\$ 4	0,06
Summe Einlagenzertifikate		\$ 4	0,06
Summe Anlagen		\$ 6.328	95,75
Sonstige Aktiva und Passiva		\$ 281	4,25
Nettovermögen		\$ 6.609	100,00

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

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

- (a) Nullkuponwertpapier.
 (b) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.
 (c) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Barmittel in Höhe von 39 USD wurden zum 31. Dezember 2022 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 6.270	\$ 0	\$ 6.270
Finanzderivate ⁽³⁾	0	54	0	54
Einlagen bei Kreditinstituten	0	0	4	4
Summen	\$ 0	\$ 6.324	\$ 4	\$ 6.328

⁽¹⁾ Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

⁽²⁾ Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

⁽³⁾ Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung des Marktwerts der außerbörslich gehandelten Finanzderivate und (erhaltenen)/verpfändeten Sicherheiten nach Kontrahenten zum 31. Dezember 2022 und 31. Dezember 2021:

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2022	
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet
BOA	\$ 3	\$ 0
BRC	33	0
CBK	26	0
GLM	30	0
MYI	(2)	0
SCX	(35)	0
		Netto- engagement ⁽¹⁾
		\$ 3
		33
		26
		30
		(2)
		(35)

⁽¹⁾ Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2022:

	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%) ⁽¹⁾
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	69,10	k. A.
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	24,21	k. A.
Sonstige übertragbare Wertpapiere	1,57	k. A.
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,02)	k. A.
Freiverkehrsfinanzderivate	0,83	k. A.
Einlagezertifikate	0,06	k. A.

⁽¹⁾ Der Emerging Local Bond ESG Fund wurde am 27. Juli 2022 aufgelegt.

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS		
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE													
ALBANIEN													
STAATSEMISSIONEN													
Albania Government International Bond				4,950 % fällig am 22.01.2035	€	2.000	\$ 1.556	0,05	S.A. Global Sukuk Ltd.				
3,500 % fällig am 23.11.2031	€ 3.500	\$ 3.046	0,09	Summe Benin			6.012	0,18	1,602 % fällig am 17.06.2026	\$ 6.800	\$ 6.086	0,18	
									2,694 % fällig am 17.06.2031	4.600	3.940	0,12	
ANGOLA													
STAATSEMISSIONEN													
Angolan Government International Bond				BRASILIEN									
8,250 % fällig am 09.05.2028	\$ 6.200	5.670	0,17	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL									
8,750 % fällig am 14.04.2032	300	261	0,01	Banco do Brasil S.A.			7.700	7,098	0,22	6,500 % fällig am 10.01.2025 ^	8.500	1.863	0,06
9,500 % fällig am 12.11.2025	400	413	0,01	Banco Votorantim S.A.			1.100	1,069	0,03	7,000 % fällig am 09.07.2025 ^	4.700	1.027	0,03
Summe Angola		6.344	0,19	Brazil Minas SPE Via State of Minas Gerais			26.334	25,740	0,78	7,250 % fällig am 14.06.2022 ^	900	189	0,01
				5,333 % fällig am 15.02.2028						Tencent Holdings Ltd.			
				CSN Inova Ventures			15.800	15,111	0,46	3,840 % fällig am 22.04.2051	200	142	0,00
				6,750 % fällig am 28.01.2028						Zhongsheng Group Holdings Ltd.			
				Odebrecht Oil & Gas Finance Ltd.			14.563	35	0,00	3,000 % fällig am 13.01.2026	3.900	3.491	0,11
				0,000 % fällig am 30.01.2023 (c)(e)						Summe Kaimaninseln		116.423	3,52
				Vale S.A.			188.860	13,352	0,40				
				0,000 % (e)	BRL			62.405	1,89				
										CHILE			
										UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
										Banco del Estado de Chile			
										2,704 % fällig am 09.01.2025	4.300	4.066	0,12
										Banco Santander Chile			
										2,700 % fällig am 10.01.2025	5.200	4.942	0,15
										Corp. Nacional del Cobre de Chile			
										3,625 % fällig am 01.08.2027	6.700	6.291	0,19
										4,500 % fällig am 01.08.2047	3.200	2.727	0,08
										4,875 % fällig am 04.11.2044 (i)	10.600	9.679	0,29
										6,150 % fällig am 24.10.2036	1.000	1.046	0,03
										Embotelladora Andina S.A.			
										3,950 % fällig am 21.01.2050	3.900	2.898	0,09
										Empresa de los Ferrocarriles del Estado			
										3,068 % fällig am 18.08.2050	1.500	944	0,03
										3,830 % fällig am 14.09.2061	7.000	4.836	0,15
										Empresa de Transporte de Pasajeros Metro S.A.			
										3,650 % fällig am 07.05.2030	1.600	1.456	0,04
										Empresa Nacional del Petroleo			
										3,450 % fällig am 16.09.2031	8.700	7.347	0,22
										4,500 % fällig am 14.09.2047	3.000	2.291	0,07
										GNL Quintero S.A.			
										4,634 % fällig am 31.07.2029	7.659	7.409	0,23
											55.932	1,69	
										STAATSEMISSIONEN			
										Chile Government International Bond			
										2,750 % fällig am 31.01.2027 (i)	13.400	12.347	0,37
										3,250 % fällig am 21.09.2071	11.900	7.371	0,22
										3,625 % fällig am 30.10.2042	2.000	1.534	0,05
										4,340 % fällig am 07.03.2042	13.000	11.032	0,34
											32.284	0,98	
										Summe Chile		88.216	2,67
										CHINA			
										UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
										Yango Justice International Ltd.			
										7,500 % fällig am 15.04.2024 ^	4.700	171	0,01
										ZhongAn Online P&C Insurance Co. Ltd.			
										3,125 % fällig am 16.07.2025	11.800	10.267	0,31
										Summe China		10.438	0,32
										KOLUMBIEN			
										UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
										Banco Davivienda S.A.			
										6,650 % fällig am 22.04.2031 (e)(g)	900	695	0,02
										Ecopetrol S.A.			
										4,125 % fällig am 16.01.2025	600	573	0,02
										4,625 % fällig am 02.11.2031	9.800	7.506	0,23
										5,375 % fällig am 26.06.2026	2.200	2.080	0,06
										5,875 % fällig am 18.09.2023	5.500	5.476	0,16
										5,875 % fällig am 28.05.2045	3.100	2.165	0,07
										6,875 % fällig am 29.04.2030	200	182	0,01
										7,375 % fällig am 18.09.2043	2.400	2.048	0,06
											20.725	0,63	
										STAATSEMISSIONEN			
										Colombia Government International Bond			
										2,625 % fällig am 15.03.2023	5.800	5.773	0,17

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Markets Bond Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
3,125 % fällig am 15.04.2031 (i)	\$ 17.307	\$ 12.906	0,39	7,125 % fällig am 20.01.2050	\$ 12.707	\$ 5.031	0,15	UNGARN			
3,875 % fällig am 25.04.2027	5.000	4.442	0,13	7,625 % fällig am 21.09.2034	3.800	1.520	0,05	STAATSEMISSIONEN			
3,875 % fällig am 15.02.2061	13.000	7.268	0,22	7,625 % fällig am 01.02.2041	530	210	0,01	Hungary Government International Bond			
4,000 % fällig am 26.02.2024	12.100	11.873	0,36	7,650 % fällig am 15.06.2035	200	81	0,00	0,500 % fällig am 18.11.2030	€ 800	\$ 588	0,02
4,125 % fällig am 15.05.2051	13.700	8.245	0,25	8,250 % fällig am 10.04.2032	2.610	1.162	0,04	1,625 % fällig am 28.04.2032		1.418	0,089
4,500 % fällig am 15.03.2029	400	347	0,01	8,625 % fällig am 28.02.2029	185	83	0,00	2,125 % fällig am 22.09.2031	\$ 2.700	2.012	0,06
5,000 % fällig am 15.06.2045	3.400	2.326	0,07	9,500 % fällig am 15.07.2052	1.400	626	0,02	3,125 % fällig am 21.09.2051	2.500	1.518	0,05
5,200 % fällig am 15.05.2049	12.700	8.698	0,26	Summe El Salvador		9.205	0,28	5,000 % fällig am 22.02.2027	€ 8.200	8.695	0,26
5,625 % fällig am 26.02.2044	4.800	3.544	0,11	ÄTHIOPIEN				5,250 % fällig am 16.06.2029	\$ 17.800	17.072	0,52
6,125 % fällig am 18.01.2041	4.895	3.910	0,12	STAATSEMISSIONEN				5,500 % fällig am 16.06.2034	700	658	0,02
7,375 % fällig am 18.09.2037	1.400	1.317	0,04	Ethiopia Government International Bond	3.300	2.073	0,06	Summe Ungarn		31.632	0,96
8,125 % fällig am 21.05.2024	500	516	0,02	6,625 % fällig am 11.12.2024				INDIEN			
Summe Kolumbien		91.890	2,78	GEORGIEN				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
COSTA RICA				Georgian Railway JSC				Indian Railway Finance Corp. Ltd.			
STAATSEMISSIONEN				4,000 % fällig am 17.06.2028	300	266	0,01	3,950 % fällig am 13.02.2050	2.200	1.581	0,04
Costa Rica Government International Bond				DEUTSCHLAND				NTPC Ltd.			
4,250 % fällig am 26.01.2023	6.300	6.285	0,19	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				3,750 % fällig am 03.04.2024	2.000	1.950	0,06
5,625 % fällig am 30.04.2043	3.000	2.468	0,08	Deutsche Bank AG				Reliance Industries Ltd.			
Summe Costa Rica		8.753	0,27	3,700 % fällig am 30.05.2024	4.222	4.105	0,13	2,875 % fällig am 12.01.2032	2.400	1.948	0,06
DOMINIKANISCHE REPUBLIK				3,950 % fällig am 27.02.2023	6.769	6.746	0,20	Summe Deutschland		5.479	0,16
STAATSEMISSIONEN				Summe Deutschland		10.851	0,33	STAATSEMISSIONEN			
Dominican Republic Central Bank Notes				GHANA				Export-Import Bank of India			
12,000 % fällig am 03.10.2025	DOP 128.200	2.195	0,07	STAATSEMISSIONEN				3,375 % fällig am 05.08.2026	600	563	0,02
Dominican Republic Government International Bond				Ghana Government International Bond				3,875 % fällig am 12.03.2024	4.100	4.019	0,12
4,875 % fällig am 23.09.2032	\$ 6.200	5.170	0,16	6,375 % fällig am 11.02.2027 ^	17.900	6.937	0,21	Summe Indien		10.061	0,30
5,300 % fällig am 21.01.2041	7.700	5.970	0,18	7,625 % fällig am 16.05.2029 ^	800	302	0,01	INDONESIEN			
5,500 % fällig am 27.01.2025	9.600	9.539	0,29	7,750 % fällig am 07.04.2029 ^	7.600	2.861	0,09	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
5,500 % fällig am 22.02.2029	18.600	17.184	0,52	7,875 % fällig am 26.03.2027 ^	6.889	2.706	0,08	Indonesia Asahan Aluminium Persero PT			
5,875 % fällig am 30.01.2060	7.650	5.639	0,17	7,875 % fällig am 11.02.2035 ^	4.229	1.533	0,04	5,450 % fällig am 15.05.2030	8.000	7.634	0,23
5,950 % fällig am 25.01.2027	15.000	14.730	0,44	8,125 % fällig am 26.03.2032 ^	11.200	4.109	0,12	5,800 % fällig am 15.05.2050	3.000	2.520	0,08
6,000 % fällig am 19.07.2028	12.400	11.996	0,36	8,625 % fällig am 07.04.2034 ^	9.000	3.290	0,10	LLPL Capital Pte. Ltd.			
6,000 % fällig am 22.02.2033	10.800	9.783	0,29	8,750 % fällig am 11.03.2061 ^	1.750	620	0,02	6,875 % fällig am 04.02.2039	939	829	0,03
6,400 % fällig am 05.06.2049	250	203	0,01	8,875 % fällig am 07.05.2042 ^	1.600	576	0,02	Pelabuhan Indonesia Persero PT			
6,875 % fällig am 29.01.2026	6.400	6.474	0,20	8,950 % fällig am 26.03.2051 ^	4.600	1.652	0,05	4,250 % fällig am 05.05.2025	6.500	6.283	0,19
7,450 % fällig am 30.04.2044	100	94	0,00	Summe Ghana		24.586	0,74	4,500 % fällig am 02.05.2023	18.700	18.661	0,56
Summe Dominikanische Republik		88.977	2,69	Summe Ghana		24.586	0,74	4,875 % fällig am 01.10.2024	3.100	3.065	0,09
ECUADOR				GUATEMALA				5,375 % fällig am 05.05.2045	3.693	3.404	0,10
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				STAATSEMISSIONEN				Pertamina Persero PT			
Ecuador Social Bond SARL				Guatemala Government International Bond				1,400 % fällig am 09.02.2026	600	537	0,02
0,000 % fällig am 30.01.2035 (c)	1.063	880	0,03	4,375 % fällig am 05.06.2027	8.600	8.170	0,24	4,175 % fällig am 21.01.2050	5.000	3.851	0,12
STAATSEMISSIONEN				4,500 % fällig am 03.05.2026	6.900	6.650	0,20	5,625 % fällig am 20.05.2043	1.800	1.658	0,05
Ecuador Government International Bond				4,650 % fällig am 07.10.2041	800	646	0,02	6,000 % fällig am 03.05.2042	21.100	20.268	0,61
0,000 % fällig am 31.07.2030 (c)	6.032	2.367	0,07	4,875 % fällig am 13.02.2028	7.120	6.883	0,21	6,450 % fällig am 30.05.2044	12.400	12.419	0,38
1,500 % fällig am 31.07.2040	22.463	9.213	0,28	5,375 % fällig am 24.04.2032	300	296	0,01	6,500 % fällig am 07.11.2048	9.500	9.548	0,29
2,500 % fällig am 31.07.2035	25.871	11.969	0,36	Summe Guatemala		22.645	0,68	Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara			
5,500 % fällig am 31.07.2030	19.026	12.214	0,37	HONGKONG				4,000 % fällig am 30.06.2050	16.800	12.054	0,36
Summe Ecuador		36.643	1,11	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				4,125 % fällig am 15.05.2027	6.300	6.063	0,18
ÄGYPTEN				AIA Group Ltd.				4,375 % fällig am 05.02.2050	2.900	2.178	0,07
STAATSEMISSIONEN				Fortune Star BVI Ltd.				5,250 % fällig am 24.10.2042	2.300	1.965	0,06
Egypt Government International Bond				4,350 % fällig am 06.05.2023	€ 900	886	0,03	5,250 % fällig am 15.05.2047	8.400	7.102	0,21
4,750 % fällig am 16.04.2026	€ 14.508	12.918	0,39	6,850 % fällig am 02.07.2024	\$ 2.200	1.903	0,06	6,150 % fällig am 21.05.2048	2.700	2.570	0,08
5,625 % fällig am 16.04.2030	5.370	3.997	0,12	Huarong Finance Co. Ltd.				6,250 % fällig am 25.01.2049	7.800	7.405	0,22
5,875 % fällig am 16.02.2031	€ 5.900	4.124	0,13	3,375 % fällig am 24.02.2030	1.100	839	0,02	Summe Indonesien		130.014	3,93
6,375 % fällig am 11.04.2031	€ 2.300	1.713	0,05	3,875 % fällig am 13.11.2029	300	237	0,01	STAATSEMISSIONEN			
6,875 % fällig am 30.04.2040	\$ 3.100	2.012	0,06	4,500 % fällig am 29.05.2029	3.450	2.867	0,08	Indonesia Government International Bond			
7,053 % fällig am 15.01.2032	7.300	5.361	0,16	5,000 % fällig am 19.11.2025	3.700	3.420	0,10	1,100 % fällig am 12.03.2033	€ 8.400	6.588	0,20
7,300 % fällig am 30.09.2033	14.900	10.616	0,32	5,500 % fällig am 16.01.2025	200	190	0,01	4,750 % fällig am 18.07.2047	\$ 2.700	2.466	0,07
7,500 % fällig am 16.02.2061	2.600	1.614	0,05	5,824 % fällig am 24.02.2023 (i)	9.000	8.972	0,27	5,350 % fällig am 11.02.2049	200	196	0,01
7,625 % fällig am 29.05.2032	6.800	5.056	0,16	Summe Hongkong		27.449	0,83	6,625 % fällig am 17.02.2037	5.900	6.696	0,20
7,903 % fällig am 21.02.2048	9.900	6.291	0,19	STAATSEMISSIONEN				6,750 % fällig am 15.01.2044	4.000	4.496	0,14
8,150 % fällig am 20.11.2059	2.100	1.381	0,04	Airport Authority Hong Kong				7,750 % fällig am 17.01.2038	1.000	1.205	0,04
8,500 % fällig am 31.01.2047	9.000	6.026	0,18	2,100 % fällig am 08.03.2026 (e)	7.500	6.845	0,21	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia			
8,875 % fällig am 29.05.2050	12.300	8.360	0,25	2,625 % fällig am 04.02.2051	1.000	646	0,02	3,800 % fällig am 23.06.2050	7.000	5.451	0,16
Summe Ägypten		69.469	2,10	Summe Hongkong		27.449	0,83	Summe Indonesien		157.112	4,75
EL SALVADOR				IRLAND				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
STAATSEMISSIONEN				Alfa Bank AO Via Alfa Bond Issuance PLC				5,950 % fällig am 15.04.2030 ^ (g)	6.600	416	0,01
El Salvador Government International Bond											
6,375 % fällig am 18.01.2027	1.100	492	0,01								

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Markets Bond Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTO-VERMÖGENS	% DES	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTO-VERMÖGENS	% DES	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTO-VERMÖGENS	% DES	
USA					NON-AGENCY-MBS										
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE					Banc of America Mortgage Trust										
Aames Mortgage Investment Trust					2,843 % fällig am 25.02.2036 ^	\$	4	\$	4	0,00					
4,869 % fällig am 25.04.2036	\$	3.052	\$	2.725	0,08										
Argent Mortgage Loan Trust					BCAP LLC Trust										
4,869 % fällig am 25.05.2035		467		418	0,01	2,980 % fällig am 26.05.2037	3.628		3.226	0,10					
Argent Securities Trust					Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust										
4,689 % fällig am 25.07.2036		976		845	0,03	3,255 % fällig am 25.05.2047 ^	90		80	0,00					
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust					Bear Stearns ALT-A Trust										
4,869 % fällig am 25.02.2037		1.648		1.580	0,05	3,810 % fällig am 25.01.2035	4		4	0,00					
5,514 % fällig am 25.11.2035		3.660		3.524	0,11	Countrywide Alternative Loan Trust									
GSAA Home Equity Trust					4,739 % fällig am 25.05.2036 ^										
4,829 % fällig am 25.05.2047		754		494	0,01	4,993 % fällig am 20.12.2035									
4,869 % fällig am 25.11.2036		266		99	0,00	Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust									
6,502 % fällig am 25.11.2036		887		349	0,01	3,229 % fällig am 20.05.2036 ^									
Home Equity Asset Trust					3,725 % fällig am 25.11.2037										
5,739 % fällig am 25.02.2033		236		226	0,01	Countrywide Home Loan Reperforming REMIC Trust									
Humboldt Americas LLC					4,540 % fällig am 25.11.2034										
0,000 % fällig am 31.07.2022	COP	20.000.000		3.990	0,12	Deutsche ALT-A Securities Mortgage Loan Trust									
JPMorgan Mortgage Acquisition Trust					4,719 % fällig am 25.08.2037 ^										
4,659 % fällig am 25.08.2036	\$	100		89	0,00	GSMPS Mortgage Loan Trust									
Lehman XS Trust					4,739 % fällig am 25.01.2036										
5,049 % fällig am 25.01.2036 ^		2.143		1.971	0,06	GSR Mortgage Loan Trust									
MASTR Asset-Backed Securities Trust					3,796 % fällig am 25.01.2036 ^										
4,829 % fällig am 25.11.2036		1.107		675	0,02	HarborView Mortgage Loan Trust									
Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust					4,048 % fällig am 19.10.2035										
4,589 % fällig am 25.02.2037		1.455		710	0,02	HomeBanc Mortgage Trust									
5,154 % fällig am 25.01.2035		185		169	0,01	4,909 % fällig am 25.01.2036									
Morgan Stanley Mortgage Loan Trust					Impac CMB Trust										
4,849 % fällig am 25.02.2037		182		50	0,00	5,029 % fällig am 25.03.2035									
Option One Mortgage Loan Trust					IndyMac Mortgage Loan Trust										
4,609 % fällig am 25.04.2037		751		533	0,02	3,141 % fällig am 25.11.2037									
4,609 % fällig am 25.05.2037		581		354	0,01	4,749 % fällig am 25.02.2037 ^									
Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates					4,749 % fällig am 25.02.2037										
5,169 % fällig am 25.09.2035		3.900		3.256	0,10	5,029 % fällig am 25.07.2045									
Renaissance Home Equity Loan Trust					JPMorgan Resecuritized Trust										
5,797 % fällig am 25.08.2036		780		316	0,01	2,500 % fällig am 25.03.2056									
Saxon Asset Securities Trust					Lehman XS Trust										
4,699 % fällig am 25.09.2037		286		269	0,01	4,769 % fällig am 25.09.2046									
Soundview Home Loan Trust					Residential Accredit Loans, Inc. Trust										
4,559 % fällig am 25.08.2037		614		527	0,02	6,000 % fällig am 25.08.2036 ^									
4,889 % fällig am 25.11.2036		74		69	0,00	Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust									
4,914 % fällig am 25.03.2036		693		685	0,02	4,081 % fällig am 25.09.2037									
5,289 % fällig am 25.10.2037		1.350		1.054	0,03	Structured Asset Mortgage Investments Trust									
					24.977										
					0,76										
AKTIEN															
STAMMAKTIEN															
ENERGIE															
Constellation Oil Services Holding S.A. 'B' (b)(h)		4.243.669		460	0,01										
					PARI (000S)										
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL															
DAE Funding LLC						3,118 % fällig am 25.01.2046	87		74	0,00					
1,625 % fällig am 15.02.2024	\$	4.700		4.464	0,14	3,122 % fällig am 25.03.2036	927		833	0,03					
2,625 % fällig am 20.03.2025		3.500		3.279	0,10	3,266 % fällig am 25.02.2037 ^	161		142	0,00					
JPMorgan Structured Products BV					4,759 % fällig am 25.05.2034										
12,000 % fällig am 04.01.2027 (h) ZMW		47.000		1.793	0,05	Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust									
14,000 % fällig am 09.12.2031 (h)		14.300		429	0,01	4,479 % fällig am 25.10.2036									
Pricoa Global Funding					14.342										
4,200 % fällig am 28.08.2025	\$	450		441	0,01	23.388									
Rio Oil Finance Trust					0,71										
8,200 % fällig am 06.04.2028		8.682		8.810	0,28	US-REGIERUNGSBEHÖRDEN									
9,250 % fällig am 06.07.2024		4.846		4.919	0,15	Fannie Mae									
9,750 % fällig am 06.01.2027		6.814		7.089	0,22	2,323 % fällig am 01.03.2036									
Rutas 2 and 7 Finance Ltd.					3,868 % fällig am 01.12.2035										
0,000 % fällig am 30.09.2036 (c)		5.227		3.303	0,10	Uniform Mortgage-Backed Security									
					34.527										
					1,06										
US-SCHATZOBBLIGATIONEN															
U.S. Treasury Bonds															
1,750 % fällig am 15.08.2041		12.300		8.424	0,25										

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	% DES		BESCHREIBUNG	PARI (000S)	% DES		BESCHREIBUNG	PARI (000S)	% DES	
		MARKT- WERT	NETTO- VERMÖ- GENS			MARKT- WERT	NETTO- VERMÖ- GENS			MARKT- WERT	NETTO- VERMÖ- GENS
Crown Castle International Corp. 5,000 % fällig am 04.01.2023	\$ 4.500	\$ 4.497	0,14	ISRAEL TREASURY BILLS				(0,118) % fällig am 13.02.2023 (c)(d)	¥ 8.510.000	\$ 64.510	1,96
5,150 % fällig am 10.01.2023	2.400	2.396	0,07	0,889 % fällig am 03.05.2023 (c)(d)	ILS 132.800	\$ 37.196	1,12			102.185	3,10
Duke Energy Corp. 4,620 % fällig am 17.01.2023	3.100	3.093	0,09	1,716 % fällig am 05.07.2023 (c)(d)	62.700	17.441	0,53	Summe kurzfristige Instrumente		316.745	9,58
Humana, Inc. 4,850 % fällig am 10.01.2023	1.800	1.797	0,05	1,718 % fällig am 03.05.2023 (c)(d)	7.000	1.961	0,06	Summe Übertragbare Wertpapiere		\$ 3.267.661	98,83
National Grid Holdings Ltd. 4,780 % fällig am 23.01.2023	4.000	3.988	0,12	1,727 % fällig am 05.07.2023 (c)(d)	3.100	862	0,03				
4,810 % fällig am 24.01.2023	2.200	2.193	0,07	1,734 % fällig am 05.07.2023 (c)(d)	85.400	23.755	0,72	AKTIEN			
Oracle Corp. 4,760 % fällig am 27.01.2023	3.700	3.687	0,11	1,755 % fällig am 05.07.2023 (c)(d)	26.400	7.343	0,22	INVESTMENTFONDS			
4,800 % fällig am 26.01.2023	2.950	2.940	0,09	1,783 % fällig am 03.05.2023 (c)(d)	25.300	7.086	0,21	ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN			
Quanta Services, Inc. 5,100 % fällig am 09.01.2023	1.250	1.248	0,04	1,828 % fällig am 02.08.2023 (c)(d)	84.000	23.303	0,70	PIMCO Funds: Global Investors Series plc – PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund (f)	2.357.350	23.621	0,71
5,100 % fällig am 11.01.2023	900	899	0,03	1,837 % fällig am 02.08.2023 (c)(d)	109.600	30.405	0,92	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short- Term Floating NAV Fund (f)	2.416.750	24.056	0,73
VW Credit, Inc. 4,750 % fällig am 24.01.2023	2.850	2.841	0,09			149.352	4,51	PIMCO Specialty Funds Ireland p.l.c. - PIMCO China Bond Fund (f)	384.360	5.120	0,16
		29.978	0,91	JAPAN TREASURY BILLS				Summe Investmentfonds		\$ 52.797	1,60
HUNGARY TREASURY BILLS				(0,129) % fällig am 13.02.2023 (c)(d)	¥ 3.902.500	29.583	0,89				
18,250 % fällig am 03.01.2023 (c)(d)	HUF 13.219.000	35.230	1,06	(0,125) % fällig am 13.02.2023 (c)(d)	1.067.500	8.092	0,25				

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kapital- betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions- geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions- geschäft ⁽¹⁾	% des Netto- vermögens
FICC	1,900 %	30.12.2022	03.01.2023	\$ 9.160	U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 08.06.2023	\$(9.343)	\$ 9.160	\$ 9.161	0,28
Summe Pensionsgeschäfte						\$(9.343)	\$ 9.160	\$ 9.161	0,28

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Netto- vermögens
Euro-Bobl March Futures	Long	03.2023	453	\$ (1.749)	(0,05)
Euro-Bund 10-Year Bond March Futures	Short	03.2023	459	4.181	0,13
Euro-Buxl 30-Year Bond March Futures	Short	03.2023	68	1.783	0,05
Japan Government 10-Year Bond March Futures	Short	03.2023	75	1.515	0,04
U.S. Treasury 2-Year Note March Futures	Short	03.2023	291	(80)	0,00
U.S. Treasury 5-Year Note March Futures	Short	03.2023	3.365	537	0,02
U.S. Treasury 10-Year Note March Futures	Long	03.2023	6.705	(5.793)	(0,18)
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond March Futures	Long	03.2023	300	(62)	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond March Futures	Short	03.2023	116	21	0,00
				\$ 353	0,01
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ 353	0,01

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZKAUF⁽¹⁾

Referenzinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Netto- vermögens
Standard Chartered PLC	(1,000) %	20.12.2027	€ 10.000	\$ (133)	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Markets Bond Fund (Forts.)

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽²⁾

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽³⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
AT&T, Inc.	1,000 %	20.06.2023	\$ 300	\$ 1	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2024	500	1	0,00
General Electric Co.	1,000	20.12.2023	1.500	7	0,00
				\$ 9	0,00

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF⁽²⁾

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽³⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.EM-38 5-Year Index	1,000 %	20.12.2027	\$ 79.900	\$ (519)	(0,02)

ZINSSWAPS

Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,000 %	21.09.2024	\$ 90.600	\$ 2.311	0,07
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,000	15.06.2029	11.100	(1.251)	(0,04)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2024	93.700	(1.562)	(0,05)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,415	04.01.2027	BRL 104.000	(541)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,453	04.01.2027	57.600	(290)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,620	04.01.2027	15.800	(67)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,828	02.01.2025	87.000	(226)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,220	02.01.2025	210.200	(550)	(0,02)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	13,015	04.01.2027	102.700	(223)	(0,01)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	13,190	02.01.2025	36.500	(53)	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	13,215	02.01.2025	38.600	(59)	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	13,400	02.01.2025	86.600	(176)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	13,400	02.01.2025	124.500	257	0,01
Erhalt ⁽⁴⁾	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,750	15.03.2028	CNY 348.226	22	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,500	21.06.2027	\$ 13.700	(2.256)	(0,07)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,500	15.12.2028	400	(55)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,750	15.12.2031	5.700	(1.002)	(0,03)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,250	21.12.2046	1.200	537	0,02
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,500	15.06.2046	600	277	0,01
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	5,950	30.11.2024	ZAR 560.000	1.094	0,03
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,820	28.12.2027	CLP 3.300.400	4	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	6,700	28.12.2025	11.322.100	10	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	6,700	30.12.2025	555.000	0	0,00
Erhalt ⁽⁴⁾	6-Month CLP-CHILIBOR	6,757	03.01.2026	10.955.500	(23)	0,00
Erhalt ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	1,750	15.03.2033	€ 8.000	88	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	5,470	21.04.2025	MXN 182.700	1.001	0,03
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	5,520	24.04.2025	175.900	969	0,03
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	5,530	24.04.2025	37.200	205	0,01
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	5,615	23.04.2025	719.200	4.024	0,12
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	6,080	26.02.2025	196.200	(1.156)	(0,03)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	6,100	26.02.2025	58.000	(343)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	6,100	28.02.2025	372.800	(2.200)	(0,07)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	6,140	26.02.2025	65.000	(386)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	6,150	26.02.2025	388.000	(2.310)	(0,07)
					\$ (3.930)	(0,12)
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					\$ (4.573)	(0,14)

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

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

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

⁽⁴⁾ Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

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

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

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZKAUF⁽¹⁾

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽³⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	Oman Government International Bond	(1,000) %	20.12.2027	\$ 2.300	\$ 76	\$ 11	\$ 87	0,00
	Turkey Government International Bond	(1,000)	20.12.2026	8.500	1.413	(329)	1.084	0,03
BPS	Oman Government International Bond	(1,000)	20.12.2027	1.100	36	5	41	0,00
BRC	Oman Government International Bond	(1,000)	20.12.2027	2.400	64	26	90	0,00
CBK	Turkey Government International Bond	(1,000)	20.12.2026	3.900	651	(154)	497	0,02
GST	South Korea Government International Bond	(1,000)	20.06.2027	20.900	(729)	308	(421)	(0,01)
HUS	Dubai Government International Bond	(1,000)	20.12.2024	3.600	(12)	(27)	(39)	0,00
JPM	Dubai Government International Bond	(1,000)	20.12.2024	1.500	(2)	(14)	(16)	0,00
	South Africa Government International Bond	(1,000)	20.06.2026	27.250	1.274	(479)	795	0,02
MYC	Turkey Government International Bond	(1,000)	20.12.2025	6.300	608	(15)	593	0,02
	Turkey Government International Bond	(1,000)	20.12.2026	800	135	(33)	102	0,00
					\$ 3.514	\$ (701)	\$ 2.813	0,08

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽²⁾

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽³⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	Chile Government International Bond	1,000 %	20.06.2024	\$ 8.100	\$ 26	\$ 35	\$ 61	0,00
	Chile Government International Bond	1,000	20.12.2026	700	4	0	4	0,00
	Chile Government International Bond	1,000	20.12.2027	5.000	(18)	0	(18)	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2024	13.200	4	78	82	0,00
	Montenegro Government International Bond	1,000	20.06.2023	€ 1.800	(140)	115	(25)	0,00
	Peru Government International Bond	1,000	20.06.2026	\$ 2.900	26	(16)	10	0,00
	Peru Government International Bond	1,000	20.12.2031	2.000	(84)	(21)	(105)	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2025	9.600	(526)	340	(186)	(0,01)
	Turkey Government International Bond	1,000	20.06.2027	5.500	(1.085)	294	(791)	(0,02)
BPS	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2027	2.500	(171)	10	(161)	0,00
	Chile Government International Bond	1,000	20.12.2023	1.100	2	5	7	0,00
	Chile Government International Bond	1,000	20.12.2024	5.400	6	43	49	0,00
	Chile Government International Bond	1,000	20.12.2026	6.800	39	(4)	35	0,00
	Chile Government International Bond	1,000	20.06.2027	10.000	(182)	189	7	0,00
	China Government International Bond	1,000	20.12.2027	5.000	62	(3)	59	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2023	5.800	(3)	(4)	(7)	0,00
	Indonesia Government International Bond	1,000	20.12.2027	5.000	22	(20)	2	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2023	900	1	4	5	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2024	3.900	(6)	30	24	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2024	2.000	(4)	18	14	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2026	4.900	6	(13)	(7)	0,00
	Peru Government International Bond	1,000	20.06.2026	32.100	116	(9)	107	0,00
	Philippines Government International Bond	1,000	20.12.2027	15.000	67	(42)	25	0,00
	Poland Government International Bond	1,000	20.12.2023	900	3	0	3	0,00
	Poland Government International Bond	1,000	20.12.2027	2.150	(15)	(2)	(17)	0,00
	Romania Government International Bond	1,000	20.12.2023	1.800	(8)	6	(2)	0,00
	Romania Government International Bond	1,000	20.12.2027	1.100	(80)	(4)	(84)	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2023	2.900	(5)	10	5	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.06.2027	1.100	(217)	59	(158)	0,00
BRC	Argentina Government International Bond	5,000	20.12.2023	6.800	(985)	140	(845)	(0,02)
	Chile Government International Bond	1,000	20.06.2024	4.500	12	22	34	0,00
	Hungary Government International Bond	1,000	20.12.2023	5.300	(38)	45	7	0,00
	Poland Government International Bond	1,000	20.12.2027	2.200	(44)	27	(17)	0,00
	QNB Finance Ltd.	1,000	20.06.2023	3.600	28	(18)	10	0,00
	Romania Government International Bond	1,000	20.12.2023	1.000	(8)	7	(1)	0,00
	Saudi Arabia Government International Bond	1,000	20.12.2024	15.687	(277)	470	193	0,01
CBK	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2026	5.000	(237)	51	(186)	(0,01)
	Chile Government International Bond	1,000	20.12.2024	3.300	8	22	30	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2023	5.800	(2)	(5)	(7)	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2024	500	(5)	2	(3)	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2026	6.000	11	(19)	(8)	0,00
	Panama Government International Bond	1,000	20.06.2024	3.400	6	18	24	0,00
	Panama Government International Bond	1,000	20.12.2024	5.900	0	50	50	0,00
	Peru Government International Bond	1,000	20.06.2026	2.200	19	(12)	7	0,00
	Saudi Arabia Government International Bond	1,000	20.12.2024	1.200	(41)	56	15	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.06.2027	2.600	(516)	142	(374)	(0,01)
DUB	South Africa Government International Bond	1,000	20.06.2024	10.000	(131)	112	(19)	0,00
FBF	Turkey Government International Bond	1,000	20.12.2023	1.400	(68)	35	(33)	0,00
GLM	Romania Government International Bond	1,000	20.12.2023	800	(3)	2	(1)	0,00
GST	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2026	600	(32)	16	(16)	0,00
	Chile Government International Bond	1,000	20.12.2026	3.600	33	(15)	18	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2023	2.700	(40)	37	(3)	0,00
	Indonesia Government International Bond	1,000	20.12.2027	70.500	(1.367)	1.394	27	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2023	1.000	1	4	5	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2024	100	(1)	2	1	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2027	3.900	(164)	113	(51)	0,00
	Peru Government International Bond	1,000	20.06.2026	29.100	118	(21)	97	0,00
	Poland Government International Bond	1,000	20.12.2023	2.100	7	1	8	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Markets Bond Fund (Forts.)

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽¹⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
HUS	Saudi Arabia Government International Bond	1,000	20.06.2024	\$ 3.000	\$ 29	\$ 0	\$ 29	0,00
	Saudi Arabia Government International Bond	1,000	20.12.2024	3.413	36	6	42	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.06.2027	7.200	(1.405)	371	(1.034)	(0,03)
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2023	400	(6)	8	2	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2024	100	(1)	2	1	0,00
JPM	Saudi Arabia Government International Bond	1,000	20.06.2024	9.700	103	(9)	94	0,00
	Argentina Government International Bond	5,000	20.12.2023	4.700	(703)	119	(584)	(0,02)
	Chile Government International Bond	1,000	20.12.2026	7.700	41	(2)	39	0,00
	Chile Government International Bond	1,000	20.06.2027	10.000	(178)	185	7	0,00
	Nigeria Government International Bond	1,000	20.06.2023	9.100	(216)	80	(136)	0,00
MYC	Peru Government International Bond	1,000	20.06.2026	1.500	13	(8)	5	0,00
	Saudi Arabia Government International Bond	1,000	20.06.2024	11.100	140	(32)	108	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2023	10.600	(171)	190	19	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.12.2023	900	(48)	27	(21)	0,00
	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2027	9.100	(564)	100	(464)	(0,01)
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2023	5.100	(1)	(5)	(6)	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2024	1.500	(1)	10	9	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2024	4.100	(15)	44	29	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2027	200	(1)	0	(1)	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2027	300	(10)	6	(4)	0,00
MYI	Peru Government International Bond	1,000	20.06.2026	39.200	122	9	131	0,00
	Peru Government International Bond	1,000	20.12.2026	3.000	(10)	12	2	0,00
	Saudi Arabia Government International Bond	1,000	20.06.2024	18.000	98	77	175	0,01
	Peru Government International Bond	1,000	20.06.2026	2.700	23	(14)	9	0,00
						\$ (8.601)	\$ 4.952	\$ (3.649)

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

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

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

VOLATILITÄTSSWAPS

Kontrahent	Zahlung/ Erhalt Volatilität	Referenzeinheit	Volatilität Ausübungskurs	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
GLM	Zahlung	USD versus JPY 1-Year ATM Realized Volatility ⁽¹⁾	12,025 %	20.06.2023	\$ 567	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00

⁽¹⁾ Varianz-Swap

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens	
BOA	01.2023	€	1.079	\$ 1.138	\$ 0	\$ (14)	0,00	
	01.2023	HUF	2.538	6	0	0	0,00	
	01.2023	\$	297	HUF 134.335	60	0	60	0,00
	01.2023	ZAR	32.992	\$ 1.856	0	(82)	(82)	0,00
	02.2023	¥	13.480.000	92.242	0	(10.450)	(10.450)	(0,31)
	03.2023	ZAR	60.875	3.448	0	(109)	(109)	0,00
BPS	01.2023	HUF	3.341.796	8.753	0	(153)	(153)	0,00
	01.2023	\$	1.209	€ 1.134	2	0	2	0,00
	01.2023	TRY	796	14.998	0	0	0	0,00
	01.2023	ZAR	371	6.449	8	0	8	0,00
	03.2023	COP	3.191.768	\$ 660	11	0	11	0,00
	03.2023	MXN	34.745	1.724	0	(35)	(35)	0,00
BRC	03.2023	PEN	42.770	11.001	0	(141)	(141)	0,00
	03.2023	\$	20.109	MXN 399.901	162	(32)	130	0,00
	05.2023	ILS	6.916	\$ 2.145	171	0	171	0,01
	07.2023		61.760	19.366	1.661	0	1.661	0,05
	01.2023	CNH	30.461	4.369	0	(39)	(39)	0,00
	01.2023	SGD	42	31	0	0	0	0,00
CBK	09.2023	ZAR	347.160	19.656	0	(336)	(336)	(0,01)
	01.2023	BRL	16.287	3.103	18	0	18	0,00
	01.2023	€	1.496	1.572	0	(26)	(26)	0,00
	01.2023	PEN	78.322	19.447	0	(1.046)	(1.046)	(0,03)
	01.2023	\$	5.475	€ 5.166	41	0	41	0,00
	01.2023	ZAR	104.510	\$ 5.965	0	(166)	(166)	(0,01)
02.2023	COP	20.000.000	4.118	37	0	37	0,00	
02.2023	PEN	9.408	2.362	0	(97)	(97)	0,00	

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Netto- vermögens
	02.2023	\$ 10.054	PEN 40.097	\$ 429	\$ 0	\$ 429	0,01
	03.2023	COP 7.815.687	\$ 1.623	32	0	32	0,00
	03.2023	MXN 338.796	17.269	123	0	123	0,00
	03.2023	\$ 498	PEN 2.003	24	0	24	0,00
	05.2023	ILS 156.657	\$ 46.697	1.978	0	1.978	0,06
	05.2023	PEN 6.254	1.582	0	(41)	(41)	0,00
	07.2023	ILS 113.145	35.324	2.887	0	2.887	0,09
	08.2023	190.199	58.940	4.319	0	4.319	0,13
	11.2023	106.261	32.205	1.468	0	1.468	0,04
	11.2023	\$ 2.209	EGP 71.296	196	0	196	0,01
CLY	01.2023	HUF 3.688.572	\$ 9.377	0	(454)	(454)	(0,01)
DUB	11.2023	EGP 98.621	3.471	145	0	145	0,00
GLM	01.2023	CNH 31.618	4.545	0	(30)	(30)	0,00
	01.2023	HUF 2.931.205	7.508	0	(304)	(304)	(0,01)
	01.2023	\$ 3.056	BRL 16.287	29	0	29	0,00
	01.2023	178	HUF 68.734	4	0	4	0,00
	01.2023	77	MYR 340	0	0	0	0,00
	01.2023	181	PLN 915	28	0	28	0,00
	03.2023	MXN 52.589	\$ 2.558	0	(103)	(103)	0,00
	04.2023	BRL 16.287	3.002	0	(29)	(29)	0,00
	04.2023	DOP 123.735	2.249	90	0	90	0,00
	07.2023	ILS 23.207	6.893	229	0	229	0,01
	11.2023	EGP 32.430	1.150	56	0	56	0,00
	11.2023	\$ 2.849	EGP 86.895	82	0	82	0,00
JPM	01.2023	£ 17.365	\$ 20.968	77	0	77	0,00
	01.2023	\$ 18	CNY 123	0	0	0	0,00
	01.2023	7.824	TRY 148.957	40	0	40	0,00
	03.2023	32	CNY 219	0	0	0	0,00
MBC	01.2023	€ 229.261	\$ 240.306	0	(4.477)	(4.477)	(0,13)
	01.2023	¥ 384.100	2.835	0	(78)	(78)	0,00
	01.2023	\$ 1.661	€ 1.559	3	0	3	0,00
	01.2023	1.103	¥ 145.000	0	(3)	(3)	0,00
	03.2023	17.368	PEN 66.997	85	0	85	0,00
MYI	01.2023	€ 31	\$ 33	0	0	0	0,00
	01.2023	£ 4	5	0	0	0	0,00
	01.2023	SGD 292	217	0	(1)	(1)	0,00
	01.2023	\$ 148	€ 138	0	0	0	0,00
	01.2023	359	£ 298	0	(1)	(1)	0,00
	01.2023	364	SGD 489	1	0	1	0,00
	11.2023	EGP 28.556	\$ 1.012	49	0	49	0,00
SCX	01.2023	ZMW 47.878	2.654	8	0	8	0,00
	03.2023	AED 36.512	9.941	0	0	0	0,00
	04.2023	ZAR 159.840	8.689	0	(627)	(627)	(0,02)
SOG	01.2023	15.664	883	0	(37)	(37)	0,00
TOR	01.2023	5.163	296	0	(7)	(7)	0,00
UAG	01.2023	£ 3.787	4.656	100	0	100	0,00
	01.2023	HUF 3.267.027	8.514	0	(193)	(193)	(0,01)
	01.2023	TRY 145.865	7.285	0	(416)	(416)	(0,01)
	03.2023	ZAR 62.223	3.481	0	(150)	(150)	0,00
	09.2023	46.533	2.654	0	(26)	(26)	0,00
				\$ 14.653	\$ (19.703)	\$ (5.050)	(0,14)

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilsklasse M Retail AUD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Netto- vermögens
AZD	01.2023	\$ 240	AUD 356	\$ 2	\$ 0	\$ 2	0,00
BOA	01.2023	AUD 5	\$ 4	0	0	0	0,00
CBK	01.2023	5	4	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 9	AUD 13	0	0	0	0,00
MBC	01.2023	145	215	1	0	1	0,00
MYI	01.2023	304	452	3	0	3	0,00
RBC	01.2023	51	75	1	0	1	0,00
TOR	01.2023	275	408	1	0	1	0,00
				\$ 8	\$ 0	\$ 8	0,00

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilsklasse Institutional CHF (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Netto- vermögens
BOA	01.2023	\$ 30.036	CHF 28.397	\$ 676	\$ 0	\$ 676	0,02
CBK	01.2023	52.976	50.044	1.149	0	1.149	0,03
MBC	01.2023	CHF 918	\$ 995	2	0	2	0,00
MYI	01.2023	\$ 547	CHF 517	12	0	12	0,00
SCX	01.2023	CHF 600	\$ 648	0	(1)	(1)	0,00
				\$ 1.839	\$ (1)	\$ 1.838	0,05

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Markets Bond Fund (Forts.)

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Investor EUR (Hedged) thesaurierend und E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2023	\$ 838	€ 795	\$ 10	\$ 0	\$ 10	0,00
BPS	01.2023	€ 1.112	\$ 1.187	0	(1)	(1)	0,00
	01.2023	\$ 160	€ 150	0	0	0	0,00
CBK	01.2023	€ 45.056	\$ 47.682	0	(424)	(424)	(0,01)
	01.2023	\$ 375.471	€ 360.342	9.269	0	9.269	0,28
JPM	01.2023	€ 9.677	\$ 9.306	259	0	259	0,01
MBC	01.2023	€ 16.955	\$ 17.978	1	(126)	(125)	(0,01)
	01.2023	\$ 415.977	€ 396.926	7.823	0	7.823	0,24
RYL	01.2023	€ 189.045	\$ 178.345	1.375	0	1.375	0,04
SCX	01.2023	\$ 356.790	€ 342.787	9.206	0	9.206	0,28
				\$ 27.943	\$ (551)	\$ 27.392	0,83

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend und Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2023	£ 275	\$ 336	\$ 5	\$ 0	\$ 5	0,00
	01.2023	\$ 527	£ 438	0	0	0	0,00
BPS	01.2023	£ 13	\$ 16	0	0	0	0,00
BRC	01.2023	\$ 298	£ 358	0	0	0	0,00
JPM	01.2023	\$ 21.317	£ 17.653	0	(78)	(78)	0,00
MBC	01.2023	£ 578	\$ 705	9	0	9	0,00
	01.2023	\$ 20.993	£ 17.484	80	(38)	42	0,00
MYI	01.2023	£ 486	\$ 593	8	0	8	0,00
	01.2023	\$ 466	£ 379	0	(10)	(10)	0,00
TOR	01.2023	\$ 21.272	£ 17.693	14	0	14	0,00
UAG	01.2023	£ 89	\$ 110	3	0	3	0,00
				\$ 119	\$ (126)	\$ (7)	0,00

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional SGD (Hedged) thesaurierend und E SGD (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	01.2023	\$ 18	SGD 25	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
BOA	01.2023	\$ 9.230	SGD 12.668	216	0	216	0,01
BPS	01.2023	\$ 10.500	SGD 14.387	229	0	229	0,01
BRC	01.2023	\$ 869	SGD 1.174	7	0	7	0,00
GLM	01.2023	SGD 435	\$ 318	0	(6)	(6)	(0,01)
	01.2023	\$ 160	SGD 216	1	0	1	0,00
MBC	01.2023	SGD 292	\$ 218	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 9.679	SGD 13.235	190	0	190	0,01
RBC	01.2023	\$ 39	SGD 53	0	0	0	0,00
RYL	01.2023	SGD 14	\$ 11	0	0	0	0,00
SCX	01.2023	\$ 46	SGD 62	0	0	0	0,00
UAG	01.2023	SGD 104	\$ 75	0	(2)	(2)	0,00
	01.2023	\$ 471	SGD 639	6	0	6	0,00
				\$ 649	\$ (8)	\$ 641	0,02

Summe Freiverkehrsfinauzderivate

\$ 23.986 0,73

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
EINLAGENZERTIFIKATE			
BanColombia S.A.			
2,860 % fällig am 25.02.2024	COP 8.150.000	\$ 1.568	0,05
12,021 % fällig am 04.08.2023	3.260.000	659	0,02
Summe Einlagenzertifikate		\$ 2.227	0,07
Summe Anlagen		\$ 3.351.611	101,38
Sonstige Aktiva und Passiva		\$ (45.632)	(1,38)
Nettovermögen		\$ 3.305.979	100,00

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

- * Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt
- ^ Das Wertpapier ist in Verzug.
- (a) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.
- (b) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.
- (c) Nullkuponwertpapier.

- (d) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.
- (e) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.
- (f) Mit dem Fonds verbunden.
- (g) Bedingt wandelbares Wertpapier.
- (h) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2021: 1,30 %):

Emittentenbeschreibung	Kaufdatum	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
Constellation Oil Services Holding S.A. – Exp. 10.06.2071	10.06.2022	\$ 0	\$ 0	0,00
Constellation Oil Services Holding S.A. 'B'	10.06.2022	460	460	0,01
Development Bank of Southern Africa 8,600 % fällig am 21.10.2024	07.10.2021	31.381	27.043	0,82
JPMorgan Structured Products BV 12,000 % fällig am 04.01.2027	15.06.2021	1.317	1.793	0,05
JPMorgan Structured Products BV 14,000 % fällig am 09.12.2031	01.06.2021	366	429	0,01
		\$ 33.524	\$ 29.725	0,89

- (i) Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von 84.485 USD (31. Dezember 2021: 172.925 USD) und Barmittel in Höhe von 842 USD (31. Dezember 2021: 1.060 USD) wurden gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen zum 31. Dezember 2022 als Sicherheiten verpfändet.

Barmittel in Höhe von 3.002 USD (31. Dezember 2021: 408 USD) wurden gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen zum 31. Dezember 2022 als Sicherheiten erhalten.

Barmittel in Höhe von 36.243 USD (31. Dezember 2021: 21.705 USD) wurden zum 31. Dezember 2022 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Wertpapiere 0 USD (31. Dezember 2021: 6.297 USD) und Barmittel in Höhe von 11.680 USD (31. Dezember 2021: 220 USD) wurden gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. zum 31. Dezember 2022 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 1	\$ 3.210.349	\$ 57.311	\$ 3.267.661
Investmentfonds	52.797	0	0	52.797
Pensionsgeschäfte	0	9.160	0	9.160
Finanzderivate ⁽³⁾	5.730	14.061	(25)	19.766
Einlagen bei Kreditinstituten	0	0	2.227	2.227
Summen	\$ 58.528	\$ 3.233.570	\$ 59.513	\$ 3.351.611

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

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 1	\$ 4.225.306	\$ 75.060	\$ 4.300.367
Investmentfonds	460.982	0	0	460.982
Pensionsgeschäfte	0	50.323	0	50.323
Finanzderivate ⁽³⁾	3.442	8.806	(94)	12.154
Summen	\$ 464.425	\$ 4.284.435	\$ 74.966	\$ 4.823.826

- (1) Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

- (2) Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

- (3) Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kreditbetrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensionsgeschäften	% des Nettovermögens
BPS	4,370 %	14.11.2022	17.01.2023	\$ (29.656)	\$ (29.828)	(0,90)
	4,460	14.11.2022	17.01.2023	(6.790)	(6.831)	(0,21)
BRC	0,750	17.05.2022	TBD ⁽¹⁾	(3.008)	(2.992)	(0,09)
	0,750	25.05.2022	TBD ⁽¹⁾	(1.002)	(997)	(0,03)
	0,750	27.05.2022	TBD ⁽¹⁾	(2.024)	(2.008)	(0,06)
	0,750	06.07.2022	TBD ⁽¹⁾	(1.009)	(1.005)	(0,03)
	3,800	03.08.2022	TBD ⁽¹⁾	(1.510)	(1.521)	(0,04)
MBC	7,500	05.10.2022	TBD ⁽¹⁾	ZAR (125.726)	(7.500)	(0,23)
	1,000	05.08.2022	TBD ⁽¹⁾	\$ (1.628)	(1.622)	(0,05)
MEI	4,340	16.12.2022	TBD ⁽¹⁾	(9.848)	(9.867)	(0,30)
	4,590	16.12.2022	TBD ⁽¹⁾	(11.162)	(11.185)	(0,34)
Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte					\$ (75.356)	(2,28)

- (1) Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Markets Bond Fund (Forts.)

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung des Marktwerts der außerbörslich gehandelten Finanzderivate und (erhaltenen)/verpfändeten Sicherheiten nach Kontrahenten zum 31. Dezember 2022 und 31. Dezember 2021:

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2022			Zum 31. Dez. 2021		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Nettoengagement ⁽¹⁾	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Nettoengagement ⁽¹⁾
AZD	\$ 2	\$ 0	\$ 2	\$ 39	\$ 0	\$ 39
BOA	(9.485)	8.490	(995)	(4.389)	4.435	46
BPS	1.829	(690)	1.139	811	(580)	231
BRC	(897)	860	(37)	(1.313)	1.341	28
CBK	20.215	(19.290)	925	664	(791)	(127)
CLY	(454)	0	(454)	k. A.	k. A.	k. A.
DUB	126	(230)	(104)	259	(50)	209
FBF	(33)	0	(33)	86	0	86
GLM	46	(120)	(74)	1.889	(1.650)	239
GST	(1.298)	1.330	32	(491)	521	30
HUS	58	(150)	(92)	876	(970)	(94)
IND	0	270	270	k. A.	k. A.	k. A.
JPM	1.107	(1.310)	(203)	793	(820)	(27)
MBC	3.472	(2.910)	562	k. A.	k. A.	k. A.
MYC	(27)	(60)	(87)	276	(63)	213
MYI	70	(160)	(90)	75	220	295
RBC	1	0	1	5.609	(4.480)	1.129
RYL	1.375	(1.300)	75	k. A.	k. A.	k. A.
SCX	8.586	(8.150)	436	4.274	(2.660)	1.614
SOG	(37)	0	(37)	k. A.	k. A.	k. A.
TOR	8	(20)	(12)	5.980	(3.740)	2.240
UAG	(678)	730	52	1.042	(760)	282

⁽¹⁾ Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenen/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2022:

	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	83,54	77,77
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	15,12	13,32
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,17	0,12
Investmentfonds	1,60	9,78
Pensionsgeschäfte	0,28	1,07
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,01	0,09
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,14)	(0,19)
Freiverkehrsfinanzderivate	0,73	0,35
Einlagenzertifikate	0,07	k. A.
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(2,28)	(3,53)

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2022 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
Albanien	0,09	k. A.
Angola	0,19	1,12
Argentinien	1,46	2,17
Armenien	k. A.	0,22
Österreich	k. A.	0,05
Aserbaidschan	1,31	0,98
Bahamas	0,36	0,26
Bahrain	0,36	0,61
Weißrussland	0,02	0,04
Benin	0,18	k. A.
Brasilien	2,04	3,15
Kamerun	0,18	0,17
Kaimaninseln	3,52	3,81
Chile	2,67	2,56
China	0,32	2,34
Kolumbien	2,78	2,07
Costa Rica	0,27	0,31
Dominikanische Republik	2,69	1,93
Ecuador	1,11	1,10
Ägypten	2,10	3,67
El Salvador	0,28	0,25
Äthiopien	0,06	0,05
Georgien	0,01	k. A.
Deutschland	0,33	0,37
Ghana	0,74	1,12
Guatemala	0,68	1,13
Hongkong	0,83	0,91
Ungarn	0,96	0,24
Indien	0,30	0,84
Indonesien	4,75	5,40

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
Irland	0,73	0,45
Israel	1,74	0,53
Elfenbeinküste	0,67	1,38
Jamaika	0,08	0,07
Japan	0,50	k. A.
Jersey, Kanalinseln	0,71	k. A.
Jordanien	0,72	0,61
Kasachstan	1,37	0,95
Kenia	0,03	0,33
Libanon	0,02	k. A.
Luxemburg	0,45	1,64
Malaysia	0,33	0,60
Marshallinseln	k. A.	0,01
Mauritius	0,08	0,07
Mexiko	6,66	7,28
Mongolei	0,05	0,45
Marokko	0,51	0,89
Multinational	0,28	0,22
Namibia	0,17	0,04
Niederlande	0,61	0,77
Nigeria	1,62	2,65
Oman	1,73	1,57
Pakistan	0,34	0,45
Panama	1,59	1,42
Paraguay	0,35	0,18
Peru	1,17	1,37
Philippinen	0,42	1,07
Polen	0,38	k. A.
Katar	1,66	1,18
Rumänien	1,80	1,39
Russland	0,22	1,46
Ruanda	k. A.	0,05
Saudi-Arabien	2,32	2,77
Senegal	0,23	0,31
Serbien	0,69	0,23
Singapur	0,50	0,16
Südafrika	4,48	4,23
Spanien	0,41	k. A.
Sri Lanka	0,50	0,80
Supranational	0,21	0,29
Schweiz	0,82	k. A.
Tansania	0,50	0,53
Thailand	0,10	0,14
Trinidad und Tobago	k. A.	0,01
Tunesien	0,28	0,07
Türkei	5,16	4,68
Ukraine	0,27	2,65
Vereinigte Arabische Emirate	1,89	1,01
Großbritannien	2,07	1,00
USA	9,86	3,49
Uruguay	k. A.	0,00
Usbekistan	0,21	k. A.
Venezuela	0,40	0,22
Vietnam	0,02	0,01
Jungferinseln (Britisch)	0,64	0,62
Sambia	0,11	0,18
Kurzfristige Instrumente	9,58	1,86
Investmentfonds	1,60	9,78
Pensionsgeschäfte	0,28	1,07
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,01	0,09
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzkauf	0,00	k. A.
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf	0,00	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	(0,02)	0,00
Zinsswaps	(0,12)	(0,19)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzkauf	0,08	0,04
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf	(0,11)	(0,13)
Volatilitätsswaps	0,00	k. A.
Devisenterminkontrakte	(0,14)	(0,01)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,90	0,45
Einlagenzertifikate	0,07	k. A.
Sonstige Aktiva und Passiva	(1,38)	(2,31)
Nettovermögen	100,00	100,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Markets Bond ESG Fund

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE				STAATSEMISSIONEN				STAATSEMISSIONEN			
ARGENTINIEN				Brazil Government International Bond				Chile Government International Bond			
0,500 % fällig am 09.07.2030	\$	13.962	3,812	4,250 % fällig am 07.01.2025	\$	300	295	2,550 % fällig am 27.01.2032	\$	4.000	3,283
1,000 % fällig am 09.07.2029		7.494	2,005	4,750 % fällig am 14.01.2050	23.175	16.311	0,66	2,750 % fällig am 31.01.2027	12.900	11.886	0,48
1,500 % fällig am 09.07.2035		23.879	6,077	5,000 % fällig am 27.01.2045	5.395	4.015	0,16	3,100 % fällig am 07.05.2041	15.400	11.116	0,45
3,500 % fällig am 09.07.2041	109.829	31.493	1,26			20.621	0,83	3,100 % fällig am 22.01.2061	7.900	4.948	0,20
3,875 % fällig am 09.01.2038	11.113	3.538	0,14	Summe Brasilien		74.873	3,00	3,250 % fällig am 21.09.2071	4.800	2.973	0,12
Provincia de la Rioja								3,500 % fällig am 25.01.2050	5.600	4.059	0,16
4,750 % fällig am 24.02.2028 ^	425	204	0,01	KAIMANINSELN				3,500 % fällig am 15.04.2053	8.900	6.348	0,25
Provincia de Neuquen				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				4,340 % fällig am 07.03.2042	7.700	6.535	0,26
6,625 % fällig am 27.04.2030 ^	320	220	0,01	AAC Technologies Holdings, Inc.	6.800	5.543	0,22	Summe Chile		51.148	2,05
Summe Argentinien		47.349	1,90	2,625 % fällig am 02.06.2026					69.778	2,80	
				Alibaba Group Holding Ltd.	5.000	3.205	0,13	CHINA			
				2,700 % fällig am 09.02.2041				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
				Baidu, Inc.	3.900	3.353	0,13	Yango Justice International Ltd.			
				1,625 % fällig am 23.02.2027	3.900	3.065	0,12	7,500 % fällig am 17.02.2025 ^	3.300	121	0,01
				2,375 % fällig am 23.08.2031 (f)				7,875 % fällig am 04.09.2024 ^	2.000	73	0,00
				Bioceano Sovereign Certificate Ltd.	4.932	3.410	0,14	Summe China		194	0,01
				0,000 % fällig am 05.06.2034 (a)				KOLUMBIEN			
				CIFI Holdings Group Co. Ltd.	2.900	767	0,03	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
				4,450 % fällig am 17.08.2026 ^				Banco Davivienda S.A.			
				Country Garden Holdings Co. Ltd.	3.300	1.889	0,08	6,650 % fällig am 22.04.2031 (c)(d)	6.720	5.191	0,21
				2,700 % fällig am 12.07.2026	1.800	957	0,04	Summe Kolumbien		58.998	2,36
				3,875 % fällig am 22.10.2030				STAATSEMISSIONEN			
				Hongkong Land Finance Cayman Islands Co. Ltd.	13.000	10.205	0,41	Colombia Government International Bond			
				2,250 % fällig am 15.07.2031				2,625 % fällig am 15.03.2023	1.700	1.692	0,07
				ICD Funding Ltd.	400	371	0,01	3,000 % fällig am 30.01.2030	300	230	0,01
				3,223 % fällig am 28.04.2026				3,125 % fällig am 15.04.2031	6.400	4.773	0,19
				Interoceanica Finance Ltd.	438	360	0,01	3,875 % fällig am 25.04.2027	4.000	3.554	0,14
				0,000 % fällig am 30.11.2025 (a)	2.795	2.789	0,11	3,875 % fällig am 15.02.2061	9.700	5.423	0,22
				7,860 % fällig am 15.05.2030				4,000 % fällig am 26.02.2024	5.000	4.906	0,20
				Kaisa Group Holdings Ltd.	1.850	260	0,01	4,125 % fällig am 15.05.2051 (f)	18.300	11.014	0,44
				9,375 % fällig am 30.06.2024 ^	300	42	0,00	5,000 % fällig am 15.06.2045	1.100	753	0,03
				9,750 % fällig am 28.09.2023 ^	1.000	129	0,01	5,200 % fällig am 15.05.2049	7.700	5.273	0,21
				11,250 % fällig am 09.04.2022 ^	200	28	0,00	5,625 % fällig am 26.02.2044	1.000	738	0,03
				11,500 % fällig am 30.01.2023 ^	3.600	507	0,02	6,125 % fällig am 18.01.2041	11.400	9.106	0,36
				11,650 % fällig am 01.06.2026 ^	1.450	204	0,01	8,000 % fällig am 28.04.2033	10.000	10.043	0,40
				11,700 % fällig am 11.11.2025 ^	300	42	0,00	10,375 % fällig am 20.01.2033	1.350	1.493	0,06
				11,950 % fällig am 12.11.2023 ^				Summe Kolumbien		64.189	2,57
				Lima Metro Line Finance Ltd.	473	460	0,02	COSTA RICA			
				5,875 % fällig am 05.07.2034				STAATSEMISSIONEN			
				MAF Sukuk Ltd.	3.600	3.512	0,14	Costa Rica Government International Bond			
				4,638 % fällig am 14.05.2029				4,250 % fällig am 26.01.2023	10.080	10.056	0,40
				Powerlong Real Estate Holdings Ltd.	3.400	1.006	0,04	5,625 % fällig am 30.04.2043	18.950	15.593	0,63
				5,950 % fällig am 30.04.2025				7,158 % fällig am 12.03.2045 (f)	2.400	2.304	0,09
				QNB Finance Ltd.	300	294	0,01	Summe Costa Rica		27.953	1,12
				3,500 % fällig am 28.03.2024				ZYPERN			
				Sunac China Holdings Ltd.	1.500	329	0,01	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
				5,950 % fällig am 26.04.2024 ^	700	153	0,01	Finance PLC			
				6,500 % fällig am 10.01.2025 ^	3.500	765	0,03	2,625 % fällig am 05.09.2027	€	8.000	5,985
				7,000 % fällig am 09.07.2025 ^				Summe Zypern			0,24
				Xiaomi Best Time International Ltd.	11.900	6.922	0,28	DOMINIKANISCHE REPUBLIK			
				4,100 % fällig am 14.07.2051				STAATSEMISSIONEN			
				Zhongsheng Group Holdings Ltd.	1.000	895	0,04	Dominican Republic Central Bank Notes			
				3,000 % fällig am 13.01.2026				12,000 % fällig am 03.10.2025	DOP	97.500	1,669
				Summe Kaimaninseln		51.462	2,06	Dominican Republic Government International Bond			
				CHILE				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
				Banco Santander Chile	2.250	2.138	0,09	4,500 % fällig am 30.01.2030	\$	3.000	2,565
				2,700 % fällig am 10.01.2025				5,300 % fällig am 21.01.2041	8.800	6.823	0,27
				Corp. Nacional del Cobre de Chile	1.050	929	0,04	5,500 % fällig am 27.01.2025	2.500	2.484	0,10
				3,150 % fällig am 14.01.2030	600	563	0,02	5,500 % fällig am 22.02.2029	12.400	11.456	0,46
				3,625 % fällig am 01.08.2027	700	524	0,02	5,875 % fällig am 30.01.2060	37.800	27.865	1,12
				3,700 % fällig am 30.01.2050	200	169	0,01	5,950 % fällig am 25.01.2027	8.400	8.249	0,33
				4,375 % fällig am 05.02.2049	500	426	0,02	6,000 % fällig am 19.07.2028	1.520	1.470	0,06
				4,500 % fällig am 01.08.2047	300	274	0,01	6,000 % fällig am 22.02.2033	1.700	1.540	0,06
				4,875 % fällig am 04.11.2044				6,400 % fällig am 05.06.2049	2.500	2.031	0,08
				Empresa de los Ferrocarriles del Estado	600	377	0,02	6,500 % fällig am 15.02.2048	200	166	0,01
				3,068 % fällig am 18.08.2050	2.300	1.589	0,06	6,850 % fällig am 27.01.2045	3.100	2.703	0,11
				3,830 % fällig am 14.09.2061				6,875 % fällig am 29.01.2026	4.500	4.552	0,18
				Sociedad Química y Minera de Chile S.A.	13.700	10.102	0,40	Summe Dominikanische Republik		73.573	2,95
				3,500 % fällig am 10.09.2051	1.600	1.539	0,06				
				4,250 % fällig am 07.05.2029							
				Summe Chile		18.630	0,75				

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	
Ecuador				GUERNSEY, KANALINSELN				Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				4,700 % fällig am 06.06.2032				
Ecuador Social Bond SARL 0,000 % fällig am 30.01.2035 (a)	\$ 11.874	\$ 9.826	0,39	Globalworth Real Estate Investments Ltd. 2,950 % fällig am 29.07.2026	€ 3.500	\$ 2.975	0,12			\$ 18.100	\$17.843	0,71
												35,032 1,40
STAATSEMISSIONEN				HONGKONG				STAATSEMISSIONEN				
Ecuador Government International Bond				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Indonesia Government International Bond				
0,000 % fällig am 31.07.2030 (a)	6.616	2.597	0,10	AIA Group Ltd. 3,200 % fällig am 16.09.2040	\$ 200	143	0,01	1,100 % fällig am 12.03.2033	€ 1.700	1.333	0,05	
1,500 % fällig am 31.07.2040	7.027	2.882	0,12	Fortune Star BVI Ltd. 5,950 % fällig am 19.10.2025	4.000	3.096	0,12	1,300 % fällig am 23.03.2034	11.400	8.836	0,36	
2,500 % fällig am 31.07.2035	64.400	29.795	1,20	Huarong Finance Co. Ltd. 3,375 % fällig am 24.02.2030	3.300	2.519	0,10	4,750 % fällig am 18.07.2047	\$ 4.400	4.019	0,16	
5,500 % fällig am 31.07.2030	14.834	9.522	0,38	3,625 % fällig am 30.09.2030	2.700	2.072	0,08	5,125 % fällig am 15.01.2045	4.164	4.050	0,16	
		44.796	1,80	3,875 % fällig am 13.11.2029	900	712	0,03	5,250 % fällig am 08.01.2047	200	195	0,01	
Summe Ecuador		54.622	2,19	4,500 % fällig am 29.05.2029	1.800	1.495	0,06	7,750 % fällig am 17.01.2038	3.280	3.952	0,16	
				4,750 % fällig am 27.04.2027	800	699	0,03	8,500 % fällig am 12.10.2035	1.055	1.340	0,05	
ÄGYPTEN				Lenovo Group Ltd.				Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia				
STAATSEMISSIONEN				3,421 % fällig am 02.11.2030				3,550 % fällig am 09.06.2051				
Egypt Government International Bond 5,250 % fällig am 06.10.2025	18.100	16.298	0,65	5,824 % fällig am 24.02.2023	1.600	1.595	0,06	3,800 % fällig am 23.06.2050	3.500	2.726	0,11	
5,625 % fällig am 16.04.2030	€ 1.100	819	0,03	MTR Corp. Ltd. 1,625 % fällig am 19.08.2030	6.300	5.011	0,20					30,651 1,23
5,875 % fällig am 16.02.2031	\$ 3.800	2.656	0,11	Summe Hongkong			32,010 1,28					65,683 2,63
6,375 % fällig am 11.04.2031	€ 5.600	4.170	0,17	STAATSEMISSIONEN				IRLAND				
7,053 % fällig am 15.01.2032	\$ 6.200	4.553	0,18	Airport Authority Hong Kong 2,100 % fällig am 08.03.2026 (c)	1.800	1.643	0,06	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
7,300 % fällig am 30.09.2033	5.400	3.847	0,16	2,400 % fällig am 08.03.2028 (c)	3.600	3.150	0,13	Alfa Bank AO Via Alfa Bond Issuance PLC				
7,500 % fällig am 16.02.2061	8.400	5.216	0,21	2,500 % fällig am 12.01.2032	200	165	0,01	5,950 % fällig am 24.03.2030 (d)				
7,625 % fällig am 29.05.2032	6.000	4.461	0,18					3,900 % fällig am 26.01.2025				
7,903 % fällig am 21.02.2048	5.700	3.622	0,15					Phosagro OAO Via Phosagro Bond Funding DAC				
8,150 % fällig am 20.11.2059	3.500	2.301	0,09					3,949 % fällig am 24.04.2023				
8,500 % fällig am 31.01.2047	3.400	2.277	0,09					Summe Irland				
8,700 % fällig am 01.03.2049	2.300	1.542	0,06					Sovcombank Via SovCom Capital DAC				
8,750 % fällig am 30.09.2051	7.400	4.997	0,20					3,400 % fällig am 26.01.2025				
Summe Ägypten		56.759	2,28					Summe Israel				
				INDIEN				STAATSEMISSIONEN				
EL SALVADOR				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Israel Government International Bond				
STAATSEMISSIONEN				Hungary Government International Bond				0,150 % fällig am 31.07.2023				
El Salvador Government International Bond 6,375 % fällig am 18.01.2027	3.600	1.611	0,06	1,625 % fällig am 28.04.2032	€ 1.200	921	0,04	1,500 % fällig am 30.11.2023				
7,125 % fällig am 20.01.2050	14.900	5.899	0,24	1,750 % fällig am 05.06.2035	8.400	5.902	0,24	4,250 % fällig am 31.03.2023				
7,625 % fällig am 21.09.2034	1.100	440	0,02	2,125 % fällig am 22.09.2031	\$ 20.150	15.014	0,60	Summe Israel				
7,625 % fällig am 01.02.2041	250	99	0,00	3,125 % fällig am 21.09.2051	7.600	4.615	0,18	57,774 2,24				
7,650 % fällig am 15.06.2035	1.000	407	0,02	5,000 % fällig am 22.02.2027	€ 10.600	11.240	0,45	ELFENBEINKÜSTE				
9,500 % fällig am 15.07.2052	7.750	3.467	0,14	5,250 % fällig am 16.06.2029	\$ 11.600	11.126	0,45	KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNGEN				
Summe El Salvador		11.923	0,48	5,375 % fällig am 25.03.2024	1.200	1.201	0,05	Republik Côte d'Ivoire				
				5,500 % fällig am 16.06.2034	1.700	1.599	0,06	6,608 % fällig am 19.03.2027				
FRANKREICH				Summe Ungarn				Summe Elfenbeinküste				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				52,166 2,09				30,359 1,22				
BNP Paribas S.A. 7,750 % fällig am 16.08.2029 (c)(d)	2.600	2.574	0,10	INDIEN				31,735 1,27				
				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				JAMAICA				
GEORGIEN				Adani Renewable Energy RJ Ltd.				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				4,625 % fällig am 15.10.2039				TransJamaican Highway Ltd.				
Georgian Railway JSC 4,000 % fällig am 17.06.2028	11.000	9.735	0,39	Indian Railway Finance Corp. Ltd. 3,570 % fällig am 21.01.2032	11.400	9.810	0,39	5,750 % fällig am 10.10.2036				
				3,835 % fällig am 13.12.2027	3.500	3.254	0,13	Summe Jamaica				
DEUTSCHLAND				JSW Hydro Energy Ltd.				STAATSEMISSIONEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				4,125 % fällig am 18.05.2031				Jamaica Government International Bond				
Deutsche Bank AG 3,700 % fällig am 30.05.2024	600	583	0,02	ReNew Power Pvt Ltd. 5,875 % fällig am 05.03.2027	2.000	1.922	0,08	7,875 % fällig am 28.07.2045				
				ReNew Wind Energy AP2 4,500 % fällig am 14.07.2028	10.000	8.404	0,34	Summe Jamaica				
GHANA				Wipro IT Services LLC				Summe Jersey, Kanalinseln				
STAATSEMISSIONEN				1,500 % fällig am 23.06.2026				Jersey, Kanalinseln				
Ghana Government International Bond 0,000 % fällig am 07.04.2025 ^	1.400	467	0,02	Summe Indien	10.000	8.774	0,35	11,960 0,48				
6,375 % fällig am 11.02.2027 ^	3.000	1.163	0,05	INDONESIEN				JORDANIEN				
7,625 % fällig am 16.05.2029 ^	3.300	1.246	0,05	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				STAATSEMISSIONEN				
7,750 % fällig am 07.04.2029 ^	2.700	1.016	0,04	Bank Mandiri Persero Tbk PT				Jordan Government International Bond				
7,875 % fällig am 11.02.2035 ^	6.100	2.211	0,09	2,000 % fällig am 19.04.2026				5,750 % fällig am 31.01.2027				
8,125 % fällig am 26.03.2032 ^	12.500	4.586	0,18	3,750 % fällig am 11.04.2024				6,125 % fällig am 29.10.2026				
8,625 % fällig am 07.04.2034 ^	8.200	2.998	0,12	Pelabuhan Indonesia Persero PT				6,735 % fällig am 10.10.2047				
8,627 % fällig am 16.06.2049 ^	1.600	566	0,02	4,250 % fällig am 05.05.2025				7,300 % fällig am 28.01.2027				
8,750 % fällig am 11.03.2061 ^	33.050	11.707	0,47	5,375 % fällig am 05.05.2045				Summe Jordanien				
8,875 % fällig am 07.05.2042 ^	1.100	396	0,02					9,567 0,38				
8,950 % fällig am 26.03.2051 ^	6.700	2.407	0,10					Summe				
Summe Ghana		28.763	1,16					35,032 1,40				

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Markets Bond ESG Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
KASACHSTAN STAATSEMISSIONEN				MAROKKO STAATSEMISSIONEN				PARAGUAY STAATSEMISSIONEN			
Kazakhstan Government International Bond				Morocco Government International Bond				Paraguay Government International Bond			
2,375 % fällig am 09.11.2028	€ 3.000	\$ 2.893	0,11	4,000 % fällig am 15.12.2050	22.000	15.146	0,61	2,739 % fällig am 29.01.2033	1.900	1.532	0,06
4,875 % fällig am 14.10.2044	\$ 11.600	10.409	0,42	5,500 % fällig am 11.12.2042	4.600	3.966	0,16	3,849 % fällig am 28.06.2033	1.900	1.675	0,07
6,500 % fällig am 21.07.2045	22.200	23.194	0,93					4,700 % fällig am 27.03.2027	2.300	2.268	0,09
Summe Kasachstan		36.496	1,46	MULTINATIONAL UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				5,400 % fällig am 30.03.2050	15.200	13.155	0,53
KENIA STAATSEMISSIONEN				MAROKKO STAATSEMISSIONEN				5,600 % fällig am 13.03.2048	1.800	1.578	0,06
Kenya Government International Bond				Morocco Government International Bond				6,100 % fällig am 11.08.2044	2.500	2.415	0,10
6,300 % fällig am 23.01.2034 (f)	6.200	4.805	0,19	4,000 % fällig am 15.12.2050	22.000	15.146	0,61	Summe Paraguay		22.623	0,91
6,875 % fällig am 24.06.2024	9.400	8.678	0,35	5,500 % fällig am 11.12.2042	4.600	3.966	0,16	PERU UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Summe Kenia		13.483	0,54	Summe Marokko		19.112	0,77	Cia de Minas Buenaventura SAA	1.400	1.202	0,05
LUXEMBURG UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				MAROKKO STAATSEMISSIONEN				InRetail Consumer	3.700	3.187	0,13
Amaggi Luxembourg International SARL				Morocco Government International Bond				3,250 % fällig am 22.03.2028		4.389	0,18
5,250 % fällig am 28.01.2028	6.000	5.663	0,23	4,000 % fällig am 15.12.2050	22.000	15.146	0,61	Summe Peru		33.821	1,36
CPI Property Group S.A.				5,500 % fällig am 11.12.2042	4.600	3.966	0,16	PHILIPPINEN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
1,625 % fällig am 23.04.2027	€ 2.400	1.830	0,07	Summe Kasachstan		36.496	1,46	Globe Telecom, Inc.			
Unigel Luxembourg S.A.				Summe Kenia		13.483	0,54	4,200 % fällig am 02.08.2026 (c)	6.700	6.013	0,24
8,750 % fällig am 01.10.2026	\$ 1.400	1.395	0,06	Summe Luxemburg		8.888	0,36	PLDT, Inc.			
Summe Luxemburg		8.888	0,36	Summe Malaysia		3.266	0,13	3,450 % fällig am 23.06.2050	3.900	2.711	0,11
MALAYSIA UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Summe Mauritius		21.153	0,85	Summe Philippinen		30.956	1,24
Axiata SPV5 Labuan Ltd.				Summe Mexiko		57.549	2,31	POLEN STAATSEMISSIONEN			
3,064 % fällig am 19.08.2050	4.900	3.266	0,13	Summe Mexiko		57.549	2,31	Poland Government International Bond	9.800	10.087	0,40
Summe Malaysia		3.266	0,13	Summe Mexiko		57.549	2,31	5,500 % fällig am 16.11.2027			
MAURITIUS UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Summe Mexiko		57.549	2,31	KATAR STAATSEMISSIONEN			
Greenko Dutch BV				Summe Mexiko		57.549	2,31	Qatar Government International Bond			
3,850 % fällig am 29.03.2026	7.067	6.148	0,25	Summe Mexiko		57.549	2,31	3,250 % fällig am 02.06.2026	7.000	6.754	0,27
Greenko Solar Mauritius Ltd.				Summe Mexiko		57.549	2,31	4,400 % fällig am 16.04.2050	21.100	19.365	0,78
5,950 % fällig am 29.07.2026	6.500	5.955	0,24	Summe Mexiko		57.549	2,31	4,500 % fällig am 23.04.2028	7.000	7.057	0,28
India Green Energy Holdings				Summe Mexiko		57.549	2,31	4,817 % fällig am 14.03.2049	11.365	11.085	0,44
5,375 % fällig am 29.04.2024	9.400	9.050	0,36	Summe Mexiko		57.549	2,31				
Summe Mauritius		21.153	0,85	Summe Mexiko		57.549	2,31				
MEXIKO UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Summe Mexiko		57.549	2,31				
America Movil S.A.B. de C.V.				Summe Mexiko		57.549	2,31				
5,375 % fällig am 04.04.2032	6.500	5.876	0,24	Summe Mexiko		57.549	2,31				
Banco Mercantil del Norte S.A.				Summe Mexiko		57.549	2,31				
6,625 % fällig am 24.01.2032 (c)(d)	2.000	1.660	0,07	Summe Mexiko		57.549	2,31				
7,500 % fällig am 27.06.2029 (c)(d)	3.400	3.118	0,12	Summe Mexiko		57.549	2,31				
7,625 % fällig am 10.01.2028 (c)(d)	300	281	0,01	Summe Mexiko		57.549	2,31				
8,375 % fällig am 14.10.2030 (c)(d)	400	397	0,02	Summe Mexiko		57.549	2,31				
Corp. GEO S.A.B. de C.V.				Summe Mexiko		57.549	2,31				
8,875 % fällig am 25.09.2014 ^	500	0	0,00	Summe Mexiko		57.549	2,31				
Metalsa S.A. de C.V.				Summe Mexiko		57.549	2,31				
3,750 % fällig am 04.05.2031	10.600	8.357	0,34	Summe Mexiko		57.549	2,31				
Trust Fibra Uno				Summe Mexiko		57.549	2,31				
6,390 % fällig am 15.01.2050	2.000	1.618	0,06	Summe Mexiko		57.549	2,31				
Summe Mexiko		21.307	0,86	Summe Mexiko		57.549	2,31				
STAATSEMISSIONEN				Summe Mexiko		57.549	2,31				
Mexico Government International Bond				Summe Mexiko		57.549	2,31				
1,350 % fällig am 18.09.2027	€ 600	578	0,02	Summe Mexiko		57.549	2,31				
2,250 % fällig am 12.08.2036	9.700	7.372	0,30	Summe Mexiko		57.549	2,31				
2,659 % fällig am 24.05.2031	\$ 400	324	0,01	Summe Mexiko		57.549	2,31				
3,750 % fällig am 19.04.2071	7.200	4.500	0,18	Summe Mexiko		57.549	2,31				
3,771 % fällig am 24.05.2061	8.200	5.209	0,21	Summe Mexiko		57.549	2,31				
4,875 % fällig am 19.05.2033	3.000	2.760	0,11	Summe Mexiko		57.549	2,31				
5,750 % fällig am 12.10.2110	18.340	15.499	0,62	Summe Mexiko		57.549	2,31				
Summe Mexiko		36.242	1,45	Summe Mexiko		57.549	2,31				
Summe Mexiko		57.549	2,31	Summe Mexiko		57.549	2,31				
MONGOLEI STAATSEMISSIONEN				Summe Mexiko		57.549	2,31				
Mongolia Government International Bond				Summe Mexiko		57.549	2,31				
3,500 % fällig am 07.07.2027	15.800	12.760	0,51	Summe Mexiko		57.549	2,31				
Summe Mongolei		12.760	0,51	Summe Mexiko		57.549	2,31				
Summe Mongolei		12.760	0,51	Summe Mexiko		57.549	2,31				

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS			
5,103 % fällig am 23.04.2048	\$	1.000	1,007	0,04	SÜDKOREA			BANQUE						
Summe Katar		45.268	1,81		UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			Banque Ouest Africaine de Developpement						
					Hana Bank			2,750 % fällig am 22.01.2033	€	5.400	4,381	0,17		
					19.10.2026 (c/d)	\$	6.500	5.656	0,23	5,000 % fällig am 27.07.2027	\$	800	755	0,03
					Hanwha Life Insurance Co. Ltd.					Eastern & Southern African Trade & Development Bank				0,56
					3,379 % fällig am 04.02.2032		6.700	5.572	0,22	4,125 % fällig am 30.06.2028		16.800	13.926	
					Hyundai Capital Services, Inc.					Internationale Bank für Wiederaufbau und Entwicklung				0,25
					1,250 % fällig am 08.02.2026		8.200	7.131	0,29	5,310 % fällig am 05.02.2026	ZAR	114.000	6.218	
					KB Kookmin Card Co. Ltd.					International Finance Corp.				0,15
					1,500 % fällig am 13.05.2026		10.000	8.669	0,35	8,000 % fällig am 09.10.2023	IDR	57.500.000	3.758	
					4,000 % fällig am 09.06.2025		7.900	7.541	0,30				44.973	1,80
					Kookmin Bank					STAATSEMISSIONEN				
					2,500 % fällig am 04.11.2030 (d)		2.500	1.995	0,08	Ghana Government International Bond				
					Mirae Asset Securities Co. Ltd.					10,750 % fällig am 14.10.2030 ^	\$	200	141	0,01
					1,375 % fällig am 07.07.2024		17.600	16.386	0,66	Summe Supranational			45.114	1,81
					NongHyup Bank					SCHWEIZ				
					1,250 % fällig am 28.07.2026		13.000	11.372	0,45	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
					Shinhan Bank Co. Ltd.					Credit Suisse AG				
					4,375 % fällig am 13.04.2032 (d)		9.000	8.041	0,32	4,750 % fällig am 09.08.2024		4.100	3.917	0,16
					Shinhan Card Co. Ltd.					Credit Suisse Group AG				
					1,375 % fällig am 19.10.2025		3.000	2.653	0,11	6,373 % fällig am 15.07.2026		3.200	3.007	0,12
					1,375 % fällig am 23.06.2026		3.000	2.588	0,10	9,750 % fällig am				
					Shinhan Financial Group Co. Ltd.					23.06.2027 (c/d)		2.100	1.835	0,07
					2,875 % fällig am					UBS Group AG				
					12.05.2026 (c/d)		8.000	6.878	0,27	4,990 % fällig am 05.08.2025		4.200	4.130	0,17
					3,340 % fällig am 05.02.2030 (d)		5.100	4.675	0,19	4,988 % fällig am 05.08.2033		1.700	1.579	0,06
					SK Hynix, Inc.					Summe Schweiz			14.468	0,58
					2,375 % fällig am 19.01.2031		5.300	3.891	0,16	TANSANIA				
					Woori Card Co. Ltd.					KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNGEN				
					1,750 % fällig am 23.03.2026		6.000	5.312	0,21	The Ministry of Finance and Planning, Government of the United Republic of Tanzania				
								98.360	3,94	7,737 % fällig am 26.04.2028	€	5.800	6.107	0,24
					STAATSEMISSIONEN					TUNESIEN				
					Export-Import Bank of Korea					STAATSEMISSIONEN				
					2,125 % fällig am 18.01.2032		7.200	5.766	0,23	Banque Centrale de Tunisie Government International Bond				
					Korea Expressway Corp.					5,625 % fällig am 17.02.2024		4.300	3.625	0,15
					1,125 % fällig am 17.05.2026		4.800	4.264	0,17	5,750 % fällig am 30.01.2025 (f)	\$	1.400	975	0,04
					Korea Water Resources Corp.					6,375 % fällig am 15.07.2026	€	900	609	0,02
					3,500 % fällig am 27.04.2025		6.500	6.274	0,26	6,750 % fällig am 31.10.2023		3.701	3.330	0,13
					Summe Südkorea			114.664	4,60	Summe Tunesien			8.539	0,34
					SPANIEN					TÜRKEI				
					UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
					Banco Santander S.A.					Akbank T.A.S.				
					5,147 % fällig am 18.08.2025		9.600	9.503	0,38	6,800 % fällig am 22.06.2031 (d)	\$	6.500	5.869	0,23
					SRI LANKA					Turkish Airlines Pass-Through Trust				
					STAATSEMISSIONEN					4,200 % fällig am 15.09.2028		222	194	0,01
					Sri Lanka Government International Bond					Summe Türkei			6.063	0,24
					5,750 % fällig am 18.04.2023 ^		6.900	2.190	0,09	STAATSEMISSIONEN				
					5,875 % fällig am 25.07.2022 ^		1.236	408	0,01	Export-Credit Bank of Turkey				
					6,125 % fällig am 03.06.2025 ^		3.700	1.211	0,05	5,750 % fällig am 06.07.2026		11.000	10.038	0,40
					6,200 % fällig am 11.05.2027 ^		7.100	2.266	0,09	8,250 % fällig am 24.01.2024		1.500	1.523	0,06
					6,750 % fällig am 18.04.2028 ^		6.800	2.178	0,09	Turkey Government International Bond				
					6,825 % fällig am 18.07.2026 ^		3.800	1.217	0,05	4,250 % fällig am 13.03.2025		1.000	937	0,04
					6,850 % fällig am 14.03.2024 ^		900	287	0,01	4,875 % fällig am 16.04.2043		8.200	5.360	0,21
					6,850 % fällig am 03.11.2025 ^		3.000	968	0,04	5,125 % fällig am 17.02.2028		2.500	2.172	0,09
					7,550 % fällig am 28.03.2030 ^		17.400	5.552	0,22	5,750 % fällig am 11.05.2047		24.700	16.920	0,68
					7,850 % fällig am 14.03.2029 ^		1.600	512	0,02	5,875 % fällig am 26.06.2031		2.400	1.976	0,08
					Summe Sri Lanka			16.789	0,67	5,950 % fällig am 15.01.2031		2.000	1.661	0,07
					SUPRANATIONAL					6,000 % fällig am 25.03.2027		300	275	0,01
					UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					6,000 % fällig am 14.01.2041		600	437	0,02
					African Export-Import Bank					6,375 % fällig am 14.10.2025		2.000	1.924	0,08
					2,634 % fällig am 17.05.2026		5.500	4.936	0,20	6,875 % fällig am 17.03.2036		3.130	2.630	0,10
					Asian Development Bank					Summe Türkei			51.916	2,08
					4,700 % fällig am 12.03.2024	MXN	89.800	4.240	0,17					
					6,550 % fällig am 26.01.2025	ZAR	118.000	6.759	0,27					
					Summe Südafrika									
								73.559	2,95					
								89.513	3,59					

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
ISRAELI TREASURY BILLS							
Electricite de France S.A. 5,000 % fällig am 20.01.2023	\$ 15.900	\$ 15.857	0,63	0,531 % fällig am 08.02.2023 (a)(b)	ILS 116.500	\$ 32.897	1,34
Fiserv, Inc. 4,780 % fällig am 23.01.2023	5.500	5.483	0,22	1,718 % fällig am 03.05.2023 (a)(b)	9.800	2.745	0,11
4,820 % fällig am 01.02.2023	2.400	2.390	0,10	1,727 % fällig am 05.07.2023 (a)(b)	46.100	12.823	0,51
Humana, Inc. 4,850 % fällig am 10.01.2023	1.500	1.498	0,06	1,734 % fällig am 05.07.2023 (a)(b)	59.900	16.661	0,67
Mondelez International, Inc. 4,670 % fällig am 11.01.2023	600	599	0,02	1,755 % fällig am 05.07.2023 (a)(b)	60.300	16.773	0,67
Oracle Corp. 4,760 % fällig am 27.01.2023	3.000	2.989	0,12	1,783 % fällig am 03.05.2023 (a)(b)	47.800	13.388	0,54
4,800 % fällig am 26.01.2023	2.200	2.192	0,09	1,828 % fällig am 02.08.2023 (a)(b)	58.800	16.312	0,65
Walgreens Boots Alliance, Inc. 4,900 % fällig am 11.01.2023	9.400	9.386	0,38	1,837 % fällig am 02.08.2023 (a)(b)	76.800	21.306	0,86
4,950 % fällig am 18.01.2023	9.300	9.277	0,37				
		50.564	2,03			132.905	5,35
				Summe kurzfristige Instrumente		209.646	8,43
HUNGARY TREASURY BILLS							
18,250 % fällig am 03.01.2023 (a)(b)	HUF 9.822.000	26.177	1,05	Summe Übertragbare Wertpapiere		\$ 2.422.256	97,17

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kapital- betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions- geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft ⁽¹⁾	% des Nettovermögens
FICC	1,900 %	30.12.2022	03.01.2023	\$ 9.261	U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 29.06.2023	\$ (9.446)	\$ 9.261	\$ 9.262	0,37
NOM	4,320	30.12.2022	03.01.2023	35.400	U.S. Treasury Bonds 3,000 % fällig am 15.11.2044	(36.124)	35.400	35.417	1,42
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (45.570)	\$ 44.661	\$ 44.679	1,79

⁽¹⁾ Umfasst aufgelaufene Zinsen.**AN EINEM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*, außer Anzahl der Kontrakte)**

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
Euro-Bobl March Futures	Short	03.2023	415	\$ 1.503	0,06	
Euro-Bund 10-Year Bond March Futures	Short	03.2023	302	2.754	0,11	
Euro-Buxl 30-Year Bond March Futures	Short	03.2023	17	464	0,02	
Euro-Schatz March Futures	Long	03.2023	416	(621)	(0,03)	
Japan Government 10-Year Bond March Futures	Short	03.2023	58	1.173	0,05	
U.S. Treasury 5-Year Note March Futures	Short	03.2023	916	8	0,00	
U.S. Treasury 10-Year Note March Futures	Long	03.2023	3.407	(3.470)	(0,14)	
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond March Futures	Long	03.2023	278	(759)	(0,03)	
				\$ 1.052	0,04	
Summe der an einem gereglten Markt gehandelten Finanzderivate					\$ 1.052	0,04

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZKAUF⁽¹⁾

Referenzinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽³⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Standard Chartered PLC	(1,000) %	20.12.2027	€ 7.600	\$ (101)	0,00

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽²⁾

Referenzinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽³⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AT&T, Inc.	1,000 %	20.06.2023	\$ 200	\$ 0	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2024	300	1	0,00
				\$ 1	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Markets Bond ESG Fund (Forts.)

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,000 %	21.09.2024	\$ 63.400	\$ 1.617	0,07
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2024	68.300	(1.139)	(0,05)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,415	04.01.2027	BRL 78.000	(406)	(0,02)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,453	04.01.2027	44.100	(222)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,620	04.01.2027	17.700	(75)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,828	02.01.2025	68.400	(178)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,220	02.01.2025	160.300	(420)	(0,02)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	13,015	04.01.2027	81.200	(176)	(0,01)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	13,190	02.01.2025	28.100	(41)	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	13,215	02.01.2025	28.200	(43)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	13,400	02.01.2025	66.100	(135)	(0,01)
Erhalt ⁽⁴⁾	1-Year BRL-CDI	13,400	02.01.2025	93.200	193	0,01
Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,750	15.03.2028	CNY 259.722	17	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,750	15.12.2031	\$ 1.800	(316)	(0,01)
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	5,950	30.11.2024	ZAR 346.600	677	0,03
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,820	28.12.2027	CLP 2.459.300	3	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	6,700	28.12.2025	8.436.600	7	0,00
Erhalt ⁽⁴⁾	6-Month CLP-CHILIBOR	6,700	30.12.2025	1.909.000	1	0,00
Erhalt ⁽⁴⁾	6-Month CLP-CHILIBOR	6,757	03.01.2026	8.155.300	(17)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	1,750	15.03.2033	€ 13.200	345	0,01
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	5,470	21.04.2025	MXN 32.600	187	0,01
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	5,520	24.04.2025	31.000	178	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,615	23.04.2025	128.300	749	0,03
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	6,100	26.02.2025	126.600	(777)	(0,03)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	6,100	28.02.2025	66.100	(409)	(0,02)
					\$ (380)	(0,02)
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					\$ (480)	(0,02)

- ⁽¹⁾ Agiert der Teilfonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definieren, dann erhält der Teilfonds entweder (i) vom Sicherungsgeber einen Betrag in Höhe des Nennwerts des Swaps und liefert die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er erhält einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.
- ⁽²⁾ Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definieren, dann zahlt der Teilfonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.
- ⁽³⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definieren.
- ⁽⁴⁾ Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

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

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

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZKAUF⁽¹⁾

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽³⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettovermögens
BOA	Oman Government International Bond	(1,000) %	20.12.2027	\$ 2.200	\$ 72	\$ 11	\$ 83	0,00
	Turkey Government International Bond	(1,000)	20.12.2026	4.300	714	(166)	548	0,02
BPS	Oman Government International Bond	(1,000)	20.12.2027	700	23	4	27	0,00
BRC	Oman Government International Bond	(1,000)	20.12.2027	3.400	91	37	128	0,01
CBK	China Government International Bond	(1,000)	20.06.2024	15.000	(167)	22	(145)	(0,01)
	Turkey Government International Bond	(1,000)	20.12.2026	2.800	466	(110)	356	0,02
GST	China Government International Bond	(1,000)	20.06.2024	15.000	(167)	22	(145)	(0,01)
	South Korea Government International Bond	(1,000)	20.06.2027	53.000	(1.849)	782	(1.067)	(0,04)
MYC	Turkey Government International Bond	(1,000)	20.12.2026	2.500	423	(104)	319	0,01
					\$ (394)	\$ 498	\$ 104	0,00

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽²⁾

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽³⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettovermögens
BOA	Brazil Government International Bond	1,000 %	20.06.2031	\$ 1.200	\$ (181)	\$ 11	\$ (170)	(0,01)
	Chile Government International Bond	1,000	20.06.2024	200	1	0	1	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2024	18.100	13	116	129	0,01
	Montenegro Government International Bond	1,000	20.06.2023	€ 800	(62)	51	(11)	0,00
	Peru Government International Bond	1,000	20.06.2023	\$ 5.000	63	(46)	17	0,00
	Peru Government International Bond	1,000	20.06.2026	6.400	26	(5)	21	0,00
	Peru Government International Bond	1,000	20.12.2031	11.900	(502)	(124)	(626)	(0,02)
	South Africa Government International Bond	1,000	20.06.2024	9.400	(90)	72	(18)	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2025	1.200	(66)	43	(23)	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.06.2027	100	(20)	6	(14)	0,00

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽³⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettovermögens	
BPS	Brazil Government International Bond	1,000 %	20.12.2026	\$ 10.400	\$ (639)	\$ 253	\$ (386)	(0,01)	
	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2027	8.200	(589)	62	(527)	(0,02)	
	Chile Government International Bond	1,000	20.12.2023	900	2	3	5	0,00	
	Chile Government International Bond	1,000	20.06.2024	3.300	9	16	25	0,00	
	Chile Government International Bond	1,000	20.12.2024	4.000	5	31	36	0,00	
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2023	4.200	(2)	(3)	(5)	0,00	
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2023	500	0	3	3	0,00	
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2024	2.100	(5)	20	15	0,00	
	Peru Government International Bond	1,000	20.06.2026	6.100	54	(34)	20	0,00	
	Poland Government International Bond	1,000	20.12.2023	700	2	1	3	0,00	
	Poland Government International Bond	1,000	20.12.2027	1.300	(9)	(1)	(10)	0,00	
	Romania Government International Bond	1,000	20.12.2023	1.400	(6)	4	(2)	0,00	
	Romania Government International Bond	1,000	20.12.2027	700	(51)	(3)	(54)	0,00	
	Turkey Government International Bond	1,000	20.06.2027	3.800	(751)	205	(546)	(0,02)	
	BRC	Argentina Government International Bond	5,000	20.12.2023	800	(96)	(3)	(99)	0,00
		Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2030	1.400	(194)	9	(185)	(0,01)
		Chile Government International Bond	1,000	20.06.2024	5.800	18	26	44	0,00
		Chile Government International Bond	1,000	20.12.2026	2.500	14	(1)	13	0,00
		Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2023	1.000	0	1	1	0,00
		Hungary Government International Bond	1,000	20.12.2023	4.000	(29)	34	5	0,00
Peru Government International Bond		1,000	20.12.2025	17.500	360	(255)	105	0,00	
Poland Government International Bond		1,000	20.12.2027	1.700	(34)	21	(13)	0,00	
QNB Finance Ltd.		1,000	20.06.2023	900	7	(4)	3	0,00	
Romania Government International Bond		1,000	20.12.2023	800	(6)	5	(1)	0,00	
Colombia Government International Bond		1,000	20.12.2023	4.200	(1)	(4)	(5)	0,00	
Colombia Government International Bond		1,000	20.06.2024	300	(3)	1	(2)	0,00	
Colombia Government International Bond		1,000	20.12.2024	800	3	(10)	(7)	0,00	
Panama Government International Bond		1,000	20.06.2024	2.300	4	13	17	0,00	
CBK	Panama Government International Bond	1,000	20.12.2024	4.300	0	36	36	0,00	
	Peru Government International Bond	1,000	20.06.2026	2.100	18	(11)	7	0,00	
	Qatar Government International Bond	1,000	20.12.2026	5.000	140	(29)	111	0,01	
	South Africa Government International Bond	1,000	20.06.2024	13.800	(148)	122	(26)	0,00	
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2026	10.400	(638)	235	(403)	(0,02)	
	Turkey Government International Bond	1,000	20.12.2023	200	(10)	5	(5)	0,00	
	Romania Government International Bond	1,000	20.12.2023	600	(2)	1	(1)	0,00	
	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2026	200	(11)	6	(5)	0,00	
	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2031	1.500	(227)	15	(212)	(0,01)	
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2024	14.000	(34)	(97)	(131)	(0,01)	
DUB	Indonesia Government International Bond	1,000	20.12.2027	11.200	(217)	221	4	0,00	
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2023	900	1	4	5	0,00	
	Peru Government International Bond	1,000	20.06.2026	13.700	99	(53)	46	0,00	
	Poland Government International Bond	1,000	20.12.2023	1.500	5	1	6	0,00	
	South Africa Government International Bond	1,000	20.06.2024	1.000	(10)	8	(2)	0,00	
	Turkey Government International Bond	1,000	20.06.2027	4.300	(840)	222	(618)	(0,02)	
	HUS	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2024	100	(1)	2	1	0,00
		Hungary Government International Bond	1,000	20.06.2027	5.700	(290)	93	(197)	(0,01)
	JPM	Indonesia Government International Bond	1,000	20.12.2024	7.400	60	25	85	0,00
		South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2023	2.500	(40)	44	4	0,00
Turkey Government International Bond		1,000	20.12.2023	700	(37)	20	(17)	0,00	
MYC	Argentina Government International Bond	5,000	20.12.2023	1.500	(289)	103	(186)	(0,01)	
	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2027	2.800	(173)	30	(143)	(0,01)	
	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2030	2.900	(405)	22	(383)	(0,01)	
	Chile Government International Bond	1,000	20.12.2024	2.400	6	16	22	0,00	
	Chile Government International Bond	1,000	20.06.2026	15.000	208	(102)	106	0,01	
	Chile Government International Bond	1,000	20.12.2026	16.300	112	(29)	83	0,00	
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2023	3.800	0	(4)	(4)	0,00	
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2024	4.800	19	15	34	0,00	
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2027	200	(7)	4	(3)	0,00	
	Peru Government International Bond	1,000	20.06.2026	12.100	65	(25)	40	0,00	
	Peru Government International Bond	1,000	20.12.2026	20.000	80	(66)	14	0,00	
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2026	4.600	(206)	28	(178)	(0,01)	
	Turkey Government International Bond	1,000	20.06.2027	1.800	(356)	97	(259)	(0,01)	
	MYI	Peru Government International Bond	1,000	20.06.2026	1.300	11	(7)	4	0,00
						\$ (5.872)	\$ 1.466	\$ (4.406)	(0,18)

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

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

⁽³⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definieren.

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Markets Bond ESG Fund (Forts.)

VOLATILITÄTSSWAPS

Kontrahent	Zahlung/Erhalt Volatilität	Referenzeinheit	Volatilität Ausübungskurs	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettovermögens
GLM	Zahlung	USD versus JPY 1-Year ATM Realized Volatility ⁽¹⁾	12,025 %	20.06.2023	\$ 418	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00

⁽¹⁾ Varianz-Swap

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2023	HUF	1.501.443	\$ 3.833	\$ 0	\$ (168)	(0,01)
	01.2023	ZAR	17.887	1.006	0	(44)	0,00
	03.2023		82.110	4.650	0	(148)	(0,01)
	07.2023	ILS	34.300	9.926	77	0	0,00
BPS	01.2023	HUF	5.008.453	13.092	0	(256)	(0,01)
	01.2023	\$	1.095	€ 1.027	2	0	0,00
	01.2023		148	ILS 506	0	(4)	0,00
	01.2023	ZAR	2.338	\$ 135	0	(2)	0,00
	03.2023	COP	2.377.182	492	8	0	0,00
	03.2023	PEN	27.846	7.162	0	(92)	0,00
	03.2023	\$	11.131	MXN 222.195	115	(1)	0,01
	05.2023	ILS	9.682	\$ 3.003	239	0	0,01
	11.2023		25.816	7.485	24	(6)	0,00
BRC	01.2023	€	318	340	1	0	0,00
	01.2023	\$	1.805	€ 1.698	8	0	0,00
	09.2023	ZAR	253.669	\$ 14.363	0	(245)	(0,01)
CBK	01.2023	€	1.867	1.962	0	(32)	0,00
	01.2023	\$	99	BRL 522	0	(1)	0,00
	01.2023		2.490	€ 2.347	16	0	0,00
	01.2023	ZAR	60.553	\$ 3.456	0	(96)	0,00
	02.2023	ILS	115.874	33.708	820	0	0,03
	02.2023	PEN	23.290	5.807	0	(276)	(0,01)
	02.2023	\$	2.358	PEN 9.406	101	0	0,00
	03.2023	COP	5.821.009	\$ 1.208	24	0	0,00
	03.2023	ILS	31.516	9.238	261	0	0,01
	03.2023	MXN	227.984	11.621	83	0	0,00
	03.2023	\$	215	MXN 4.444	10	0	0,00
	05.2023	ILS	47.207	\$ 14.745	1.269	0	0,05
	05.2023	PEN	4.396	1.112	0	(29)	0,00
	07.2023	ILS	183.353	56.947	4.376	0	0,18
	08.2023		133.218	41.282	3.025	0	0,12
	11.2023		55.124	16.527	582	0	0,02
	11.2023	\$	1.610	EGP 51.961	143	0	0,01
DUB	07.2023	ILS	24.133	\$ 6.892	0	(37)	0,00
	11.2023	EGP	146.354	5.151	216	0	0,01
GLM	01.2023	BRL	522	100	2	0	0,00
	01.2023	CNH	354	51	0	0	0,00
	01.2023	HUF	841	2	0	0	0,00
	01.2023	\$	134	HUF 51.836	3	0	0,00
	01.2023		54	MYR 239	0	0	0,00
	01.2023		105	PLN 530	16	0	0,00
	02.2023		100	BRL 522	0	(2)	0,00
	04.2023	DOP	94.104	\$ 1.711	68	0	0,00
	05.2023	\$	11.140	PEN 44.326	361	0	0,01
	05.2023		45	ZAR 753	0	(1)	0,00
	11.2023	EGP	25.380	\$ 900	44	0	0,00
	11.2023	\$	5.231	EGP 158.950	129	0	0,01
JPM	01.2023	£	11.424	\$ 13.795	51	0	0,00
	01.2023	HUF	3.331.008	8.496	0	(381)	(0,01)
	01.2023	\$	13	CNY 87	0	0	0,00
	01.2023		6.533	TRY 124.379	33	0	0,00
	03.2023		23	CNY 156	0	0	0,00
MBC	01.2023	€	188.331	\$ 197.379	0	(3.704)	(0,15)
	01.2023	¥	148.200	1.094	0	(30)	0,00
	01.2023	\$	1.594	€ 1.496	3	0	0,00
	02.2023	MXN	77	\$ 4	0	0	0,00
	05.2023	\$	51	CNH 343	0	(1)	0,00
MYI	01.2023	€	4.422	\$ 4.717	0	(2)	0,00
	01.2023	£	7	9	0	0	0,00
	01.2023	\$	35	€ 32	0	0	0,00
	01.2023		2.148	£ 1.781	0	(4)	0,00
	02.2023	ZAR	2.377	\$ 130	0	(9)	0,00
	05.2023		753	42	0	(2)	0,00
	11.2023	EGP	40.209	1.425	69	0	0,00
RBC	03.2023	\$	19	MXN 384	0	0	0,00
	04.2023	MXN	90.650	\$ 4.373	0	(189)	(0,01)
SCX	01.2023	\$	54	£ 44	0	0	0,00
	01.2023	ZMW	21.720	\$ 1.204	3	0	0,00
	03.2023	AED	25.350	6.902	0	0	0,00
	04.2023	ZAR	198.324	10.781	0	(778)	(0,03)
SOG	01.2023		8.492	479	0	(20)	0,00
UAG	01.2023	£	3.097	3.808	82	0	0,00

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
	01.2023	TRY 123.492	\$ 6.167	\$ 0	\$ (352)	\$ (352)	(0,01)
	03.2023	ZAR 33.735	1.887	0	(82)	(82)	0,00
	09.2023	83.188	4.745	0	(46)	(46)	0,00
	11.2023	ILS 7.970	2.305	0	(1)	(1)	0,00
				\$ 12.264	\$ (7.041)	\$ 5.223	0,21

ABGESICHERTE DEVISENTERMIKONTRAKTE

Zum 31. Dezember 2022 standen fur die Anteilsklasse Institutional CHF (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
BOA	01.2023	\$ 18.830	CHF 17.802	\$ 424	\$ 0	\$ 424	0,02
BRC	01.2023	3.710	3.439	9	0	9	0,00
CBK	01.2023	33.144	31.311	721	0	721	0,03
MYI	01.2023	383	362	8	0	8	0,00
SCX	01.2023	455	422	1	0	1	0,00
				\$ 1.163	\$ 0	\$ 1.163	0,05

Zum 31. Dezember 2022 standen fur die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschuttend und E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
BOA	01.2023	€ 1.065	\$ 1.123	\$ 0	\$ (14)	\$ (14)	0,00
BPS	01.2023	780	832	0	(1)	(1)	0,00
	01.2023	\$ 611	€ 572	0	0	0	0,00
CBK	01.2023	€ 3.997	\$ 4.246	0	(21)	(21)	0,00
	01.2023	\$ 413.441	€ 397.738	11.227	0	11.227	0,46
JPM	01.2023	€ 7.952	\$ 8.269	0	(223)	(223)	(0,01)
MBC	01.2023	17.247	18.364	0	(51)	(51)	(0,01)
	01.2023	\$ 465.019	€ 443.666	8.686	0	8.686	0,35
SCX	01.2023	405.516	389.601	10.463	0	10.463	0,42
				\$ 30.376	\$ (310)	\$ 30.066	1,21

Zum 31. Dezember 2022 standen fur die Anteilsklasse Institutional GBP (Hedged) ausschuttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
BOA	01.2023	£ 24	\$ 30	\$ 1	\$ 0	\$ 1	0,00
	01.2023	\$ 68.167	£ 56.611	0	(59)	(59)	0,00
BPS	01.2023	£ 125	\$ 151	1	0	1	0,00
	01.2023	\$ 115	£ 95	0	0	0	0,00
BRC	01.2023	£ 1.525	\$ 1.837	2	0	2	0,00
	01.2023	\$ 24	£ 20	0	0	0	0,00
MBC	01.2023	£ 134	\$ 163	2	0	2	0,00
	01.2023	\$ 73.238	£ 61.010	281	(119)	162	0,01
MYI	01.2023	1.985	1.615	0	(42)	(42)	0,00
UAG	01.2023	£ 113	\$ 139	4	0	4	0,00
	01.2023	\$ 54.244	£ 45.149	76	(2)	74	0,00
				\$ 367	\$ (222)	\$ 145	0,01

Zum 31. Dezember 2022 standen fur die Anteilsklasse Investor NOK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
BRC	01.2023	\$ 156	NOK 1.551	\$ 2	\$ 0	\$ 2	0,00
CBK	01.2023	173	1.715	1	0	1	0,00
MBC	01.2023	30	290	0	0	0	0,00
SCX	01.2023	168	1.662	1	0	1	0,00
				\$ 4	\$ 0	\$ 4	0,00

Zum 31. Dezember 2022 standen fur die Anteilsklassen Investor SEK (Hedged) thesaurierend und Administrative SEK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
BOA	01.2023	SEK 275	\$ 27	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	01.2023	\$ 63	SEK 643	0	(1)	(1)	0,00
BRC	01.2023	728	7.620	4	0	4	0,00
CBK	01.2023	SEK 270	\$ 26	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 219	SEK 2.279	0	0	0	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Markets Bond ESG Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
MBC	01.2023	SEK	65	\$	6	\$	0,00
	01.2023	\$	167	SEK	1.747	\$	0,00
MYI	01.2023	SEK	51	\$	5	\$	0,00
	01.2023	\$	123	SEK	1.289	\$	0,00
SCX	01.2023		16		162		0,00
UAG	01.2023	SEK	196	\$	19	\$	0,00
	01.2023	\$	1.423	SEK	14.926	\$	0,00
						\$	0,00
				\$	16	\$	(1)
						\$	15
						\$	0,00
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						\$	32.314
							1,30

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖGENS
EINLAGENZERTIFIKATE			
BanColombia S.A. 2,860 % fällig am 25.02.2024 12,021 % fällig am 04.08.2023	COP	6.070.000 2.428.000	\$
			1.168 491
			0,05 0,02
Summe Einlagenzertifikate		\$	1.659
			0,07
Summe Anlagen		\$	2.501.462
			100,35
Sonstige Aktiva und Passiva		\$	(8.987)
			(0,35)
Nettovermögen		\$	2.492.475
			100,00

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

- * Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt
- ^ Das Wertpapier ist in Verzug.
- (a) Nullkuponwertpapier.
- (b) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.
- (c) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.
- (d) Bedingt wandelbares Wertpapier.
- (e) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2021: 0,99 %):

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeits- datum	Kauf- datum	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
Development Bank of Southern Africa	8,600 %	21.10.2024	07.10.2021	\$ 17.010	\$ 14.659	0,59
JPMorgan Structured Products BV	12,000	04.01.2027	15.06.2021	737	1.003	0,04
JPMorgan Structured Products BV	14,000	09.12.2031	01.06.2021	210	246	0,01
				\$ 17.957	\$ 15.908	0,64

(f) Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von 38.910 USD (31. Dezember 2021: 177.076 USD) und Barmittel in Höhe von 300 USD (31. Dezember 2021: 1.550 USD) wurden gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen zum 31. Dezember 2022 als Sicherheiten verpfändet.

Barmittel in Höhe von 807 USD (31. Dezember 2021: 1.001 USD) wurden gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen zum 31. Dezember 2022 als Sicherheiten erhalten.

Barmittel in Höhe von 18.655 USD (31. Dezember 2021: 7.968 USD) wurden zum 31. Dezember 2022 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von 0 USD (31. Dezember 2021: 2.623 USD) und Barmittel in Höhe von 6.470 USD (31. Dezember 2021: 2.820 USD) wurden gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. zum 31. Dezember 2022 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$	\$	\$	\$
Pensionsgeschäfte	0	2.396.551	25.705	2.422.256
Einlagen bei Kreditinstituten	0	44.661	0	44.661
Finanzderivate ⁽³⁾	0	0	1.659	1.659
	5.273	27.624	(11)	32.886
Summen	\$	\$	\$	\$
	5.273	2.468.836	27.353	2.501.462

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

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 2.686.487	\$ 17.783	\$ 2.704.270
Pensionsgeschäfte	0	51.143	0	51.143
Finanzderivate ⁽³⁾	2.326	8.628	(46)	10.908
Summen	\$ 2.326	\$ 2.746.258	\$ 17.737	\$ 2.766.321

⁽¹⁾ Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

⁽²⁾ Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

⁽³⁾ Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions- geschäften		% des Nettovermögens
					\$	(%)	
BPS	2,000 %	21.12.2022	TBD ⁽¹⁾	€ (18.289)	\$ (19.510)	(0,78)	
BRC	2,050	21.12.2022	TBD ⁽¹⁾	(1.417)	(1.513)	(0,06)	
	1,000	27.09.2022	TBD ⁽¹⁾	\$ (1.513)	(1.512)	(0,06)	
	3,500	25.11.2022	TBD ⁽¹⁾	(2.162)	(2.169)	(0,09)	
	3,750	04.08.2022	TBD ⁽¹⁾	(1.715)	(1.726)	(0,07)	
	3,800	03.08.2022	TBD ⁽¹⁾	(755)	(761)	(0,03)	
MEI	3,250	13.10.2022	11.10.2024	(4.434)	(4.460)	(0,18)	
NOM	2,500	16.12.2022	TBD ⁽¹⁾	(2.117)	(2.119)	(0,09)	
	4,300	16.12.2022	TBD ⁽¹⁾	(5.061)	(5.070)	(0,20)	
Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte					\$ (38.840)	(1,56)	

⁽¹⁾ Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung des Marktwerts der außerbörslich gehandelten Finanzderivate und (erhaltenen)/verpfändeten Sicherheiten nach Kontrahenten zum 31. Dezember 2022 und 31. Dezember 2021:

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2022			Zum 31. Dez. 2021		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾
BOA	\$ 5	\$ 0	\$ 5	\$ (455)	\$ 583	\$ 128
BPS	(1.369)	2.060	691	(777)	1.040	263
BRC	(218)	320	102	(253)	295	42
CBK	22.572	(21.703)	869	(551)	361	(190)
DUB	(250)	270	20	(482)	570	88
FBF	(5)	0	(5)	k. A.	k. A.	k. A.
GLM	619	(580)	39	913	(620)	293
GST	(2.119)	2.110	(9)	(1.354)	1.384	30
HUS	1	0	1	8	0	8
IND	k. A.	k. A.	k. A.	215	(80)	135
JPM	(645)	680	35	(859)	1.030	171
MBC	5.068	(4.320)	748	k. A.	k. A.	k. A.
MYC	(538)	760	222	53	180	233
MYI	23	0	23	120	0	120
RBC	(189)	0	(189)	4.489	(3.590)	899
RYL	k. A.	k. A.	k. A.	50	0	50
SCX	9.690	(9.190)	500	3.219	(2.070)	1.149
SOG	(20)	0	(20)	k. A.	k. A.	k. A.
SSB	k. A.	k. A.	k. A.	202	(90)	112
TOR	k. A.	k. A.	k. A.	4.714	(3.020)	1.694
UAG	(311)	270	(41)	523	(160)	363

⁽¹⁾ Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2022:

	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	84,95	82,78
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	12,05	19,80
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,17	0,02
Pensionsgeschäfte	1,79	1,94
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,04	0,09
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,02)	(0,05)
Freiverkehrsfinanzderivate	1,30	0,37
Einlagenzertifikate	0,07	k. A.
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(1,56)	(6,34)

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Markets Bond ESG Fund (Forts.)

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2022 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
Argentinien	1,90	2,15
Armenien	0,27	0,30
Österreich	k. A.	0,01
Aserbaidschan	k. A.	0,10
Bahamas	0,33	0,12
Bahrain	0,93	1,04
Benin	0,36	0,48
Bermuda	0,13	0,16
Brasilien	3,00	4,18
Kaimaninseln	2,06	3,26
Chile	2,80	2,38
China	0,01	0,23
Kolumbien	2,57	2,32
Costa Rica	1,12	1,04
Zypern	0,24	k. A.
Dominikanische Republik	2,95	3,00
Ecuador	2,19	2,10
Ägypten	2,28	4,38
El Salvador	0,48	0,58
Frankreich	0,10	k. A.
Georgien	0,39	0,42
Deutschland	0,02	0,02
Ghana	1,16	2,24
Guernsey, Kanalinseln	0,12	0,16
Hongkong	1,28	1,32
Ungarn	2,09	1,04
Indien	1,69	2,03
Indonesien	2,63	2,47
Irland	0,08	0,43
Insel Man	k. A.	0,14
Israel	2,24	0,22
Eifenbeinküste	1,27	1,61
Jamaika	0,17	0,20
Jersey, Kanalinseln	0,48	k. A.
Jordanien	0,38	0,77
Kasachstan	1,46	0,94
Kenia	0,54	0,79
Luxemburg	0,36	0,38
Malaysia	0,13	0,02
Mauritius	0,85	1,44
Mexiko	2,31	2,88
Mongolei	0,65	0,55
Marokko	0,77	1,37
Multinational	0,02	0,02
Namibia	0,09	0,09
Niederlande	0,87	1,48
Oman	3,07	3,48
Panama	2,85	2,43
Paraguay	0,91	0,85
Peru	1,36	1,48
Philippinen	1,24	1,64
Polen	0,40	k. A.
Katar	1,81	1,54
Rumänien	2,26	2,23
Russland	0,04	0,71
Ruanda	k. A.	0,09
Senegal	0,41	0,71
Serbien	0,84	0,75
Singapur	0,43	0,87
Südafrika	3,59	2,91
Südkorea	4,60	4,86
Spanien	0,38	k. A.
Sri Lanka	0,67	1,26
Supranational	1,81	1,71
Schweiz	0,58	k. A.
Tansania	0,24	0,35
Tunesien	0,34	0,11
Türkei	2,08	2,96
Ukraine	0,78	3,53
Vereinigte Arabische Emirate	1,00	1,05
Großbritannien	1,65	0,46
USA	7,06	2,29
Uruguay	1,65	2,33
Usbekistan	0,03	k. A.
Vietnam	0,04	0,04
Jungferninseln (Britisch)	0,73	0,28
Sambia	0,12	0,20
Kurzfristige Instrumente	8,43	10,62
Pensionsgeschäfte	1,79	1,94
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,04	0,09

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzkauf	0,00	k. A.
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf	0,00	k. A.
Zinsswaps	(0,02)	(0,05)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzkauf	0,00	(0,04)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf	(0,18)	(0,13)
Volatilitätsswaps	0,00	k. A.
Devisenterminkontrakte	0,21	(0,06)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	1,27	0,60
Einlagezertifikate	0,07	k. A.
Sonstige Aktiva und Passiva	(0,35)	(4,95)
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
Health & Happiness H&H International Holdings Ltd. 5,625 % fällig am 24.10.2024	\$ 800	\$ 711	0,42	Ras Laffan Liquefied Natural Gas Co. Ltd. 6,332 % fällig am 30.09.2027	\$ 658	\$ 666	0,39	IHS Holding Ltd. 5,625 % fällig am 29.11.2026	\$ 400	\$ 334	0,20
Hikma Finance USA LLC 3,250 % fällig am 09.07.2025	1.000	930	0,55	Rede D'or Finance SARL 4,500 % fällig am 22.01.2030	213	184	0,11	India Green Energy Holdings 5,375 % fällig am 29.04.2024	1.250	1.203	0,71
HTA Group Ltd. 7,000 % fällig am 18.12.2025	600	558	0,33	Reliance Industries Ltd. 2,875 % fällig am 12.01.2032	900	731	0,43	Israel Electric Corp. Ltd. 3,750 % fällig am 22.02.2032	1.200	1.055	0,62
ICL Group Ltd. 6,375 % fällig am 31.05.2038	400	394	0,23	ReNew Power Pvt Ltd. 5,875 % fällig am 05.03.2027	500	481	0,28	LLPL Capital Pte. Ltd. 6,875 % fällig am 04.02.2039	512	452	0,27
IHS Netherlands Holdco BV 8,000 % fällig am 18.09.2027	1.060	939	0,56	Rolls-Royce PLC 5,750 % fällig am 15.10.2027	£ 300	332	0,20	MSU Energy S.A. 6,875 % fällig am 01.02.2025	400	272	0,16
Industrias Penoles S.A.B. de C.V. 4,750 % fällig am 06.08.2050	800	663	0,39	Sands China Ltd. 3,350 % fällig am 08.03.2029	\$ 300	246	0,15	NGD Holdings BV 6,750 % fällig am 31.12.2026	284	132	0,08
InRetail Consumer 3,250 % fällig am 22.03.2028	1.200	1.034	0,61	4,300 % fällig am 08.01.2026	200	185	0,11	Odebrecht Drilling Norbe Ltd. (6,350 % bar und 1,000 % PIK) 7,350 % fällig am 01.12.2026 ^a)	0	0	0,00
Invepar Holdings LLC 1,000 % fällig am 31.12.2049 (h)	210	0	0,00	4,875 % fällig am 18.06.2030	450	396	0,23	Peru LNG SRL 5,375 % fällig am 22.03.2030	700	586	0,35
Inversiones CMPC S.A. 3,000 % fällig am 06.04.2031	500	419	0,25	5,625 % fällig am 08.08.2025	300	287	0,17	Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara 5,250 % fällig am 24.10.2042	300	256	0,15
JSW Steel Ltd. 5,950 % fällig am 05.04.2032	600	474	0,28	5,900 % fällig am 08.08.2028	900	844	0,50	Rio Oil Finance Trust 8,200 % fällig am 06.04.2028	1.958	1.987	1,17
Kosmos Energy Ltd. 7,125 % fällig am 04.04.2026	1.010	863	0,51	Sappi Papier Holding GmbH 7,500 % fällig am 15.06.2032	305	277	0,16	9,250 % fällig am 06.07.2024	77	78	0,04
Lenovo Group Ltd. 3,421 % fällig am 02.11.2030	200	159	0,09	Sasol Financing USA LLC 5,875 % fällig am 27.03.2024	500	490	0,29	9,750 % fällig am 06.01.2027	554	576	0,34
Leviathan Bond Ltd. 6,125 % fällig am 30.06.2025	600	588	0,35	1,700 % fällig am 27.09.2028	1.700	1.547	0,92	S.A. Global Sukuk Ltd. 2,694 % fällig am 17.06.2031	1.000	857	0,51
6,500 % fällig am 30.06.2027	800	779	0,46	Saudi Arabian Oil Co. 2,250 % fällig am 24.11.2030	2.100	1.735	1,03	Southern Gas Corridor CJSC 6,875 % fällig am 24.03.2026	900	925	0,55
LG Chem Ltd. 3,625 % fällig am 15.04.2029	1.600	1.464	0,87	4,250 % fällig am 16.04.2039	1.500	1.346	0,80	Star Energy Geothermal Wayang Windu Ltd. 6,750 % fällig am 24.04.2033	811	768	0,45
Medco Oak Tree Pte. Ltd. 7,375 % fällig am 14.05.2026	700	668	0,40	Seplat Energy PLC 7,750 % fällig am 01.04.2026	400	322	0,19	Thaioil Treasury Center Co. Ltd. 3,750 % fällig am 18.06.2050	700	436	0,26
Melco Resorts Finance Ltd. 4,875 % fällig am 06.06.2025	600	552	0,33	Severstal OAO Via Steel Capital S.A. 3,150 % fällig am 16.09.2024 ^	800	121	0,07				
5,375 % fällig am 04.12.2029	400	322	0,19	SK Hynix, Inc. 2,375 % fällig am 19.01.2031	800	587	0,35				
5,750 % fällig am 21.07.2028	400	335	0,20	SMC Global Power Holdings Corp. 5,450 % fällig am 09.12.2026 (e)	200	134	0,08				
Metalsa S.A. de C.V. 3,750 % fällig am 04.05.2031	600	473	0,28	Stillwater Mining Co. 4,000 % fällig am 16.11.2026	1.400	1.238	0,73				
Metinvest BV 5,625 % fällig am 17.06.2025	€ 850	503	0,30	Studio City Finance Ltd. 6,500 % fällig am 15.01.2028	900	700	0,41				
8,500 % fällig am 23.04.2026	\$ 200	107	0,06	Suzano Austria GmbH 3,750 % fällig am 15.01.2031	300	252	0,15	US-REGIERUNGSBEHÖRDEN			
MGM China Holdings Ltd. 5,375 % fällig am 15.05.2024	800	773	0,46	7,000 % fällig am 16.03.2047	400	400	0,24	Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fällig am 01.02.2053	1.300	1.281	0,76
MTN Mauritius Investments Ltd. 4,755 % fällig am 11.11.2024	365	356	0,21	Tengzicheroil Finance Co. International Ltd. 3,250 % fällig am 15.08.2030	700	502	0,30	US-SCHATZOBIGATIONEN			
Nakilat, Inc. 6,067 % fällig am 31.12.2033	368	380	0,23	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV 3,750 % fällig am 09.05.2027	€ 1.600	1.484	0,88	U.S. Treasury Bonds 3,000 % fällig am 15.05.2045	8.000	6.598	3,90
Novolipetsk Steel Via Steel Funding DAC 1,450 % fällig am 02.06.2026	€ 500	360	0,21	Tullow Oil PLC 10,250 % fällig am 15.05.2026	\$ 377	303	0,18	NON-AGENCY-MBS			
OAS Restructuring BVI Ltd. 5,000 % fällig am 31.03.2035 (h)	BRL 475	4	0,00	Turkish Airlines Pass-Through Trust 4,200 % fällig am 15.09.2028	609	534	0,32	Canada Square Funding PLC 3,735 % fällig am 17.01.2059	£ 95	110	0,06
OCP S.A. 5,125 % fällig am 23.06.2051	\$ 1.400	1.068	0,63	Unigel Luxembourg S.A. 8,750 % fällig am 01.10.2026	900	896	0,53	Chevy Chase Funding LLC Mortgage-Backed Certificates 4,619 % fällig am 25.10.2035	\$ 456	414	0,24
6,875 % fällig am 25.04.2044	300	285	0,17	Vale Overseas Ltd. 3,750 % fällig am 08.07.2030	400	351	0,21	Citigroup Mortgage Loan Trust 3,790 % fällig am 25.08.2036	287	251	0,15
Odebrecht Holdco Finance Ltd. 0,000 % fällig am 10.09.2058 (c)	3.424	4	0,00	6,875 % fällig am 21.11.2036	700	740	0,44	Countrywide Alternative Loan Trust 4,993 % fällig am 20.12.2035	50	43	0,03
Odebrecht Oil & Gas Finance Ltd. 0,000 % fällig am 30.01.2023 (c)(e)	1.416	3	0,00	Vale S.A. 0,000 % (e)	BRL 6.700	474	0,28	Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust 3,726 % fällig am 25.11.2037	32	29	0,02
Periama Holdings LLC 5,950 % fällig am 19.04.2026	300	281	0,17	Wynn Macau Ltd. 4,875 % fällig am 01.10.2024	\$ 500	473	0,28	Polaris PLC 4,682 % fällig am 27.05.2057	£ 50	60	0,04
Pertamina Persero PT 5,625 % fällig am 20.05.2043	800	737	0,44	5,500 % fällig am 15.01.2026	500	459	0,27	RMAC PLC 4,206 % fällig am 12.06.2046	104	125	0,07
Petroleos Mexicanos 6,500 % fällig am 02.06.2041	500	327	0,19	Xiaomi Best Time International Ltd. 2,875 % fällig am 14.07.2031	900	654	0,39	Rochester Financing PLC 4,126 % fällig am 18.12.2044	144	167	0,10
6,750 % fällig am 21.09.2047	500	320	0,19	YPF S.A. 6,950 % fällig am 21.07.2027	500	355	0,21	Tower Bridge Funding PLC 4,151 % fällig am 20.12.2063	92	108	0,06
Petron Corp. 5,950 % fällig am 19.04.2026 (e)	300	258	0,15	Yunda Holding Investment Ltd. 2,250 % fällig am 19.08.2025	1.000	885	0,52				
Petronas Capital Ltd. 3,404 % fällig am 28.04.2061	500	347	0,21	Zhongsheng Group Holdings Ltd. 3,000 % fällig am 13.01.2026	700	627	0,37	FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE			
Petrorio Luxembourg Trading SARL 6,125 % fällig am 09.06.2026	500	476	0,28			64.275	38,05	Citigroup Mortgage Loan Trust 7,250 % fällig am 25.05.2036	\$ 373	195	0,11
Prosus NV 3,061 % fällig am 13.07.2031	1.500	1.160	0,69	VERSORGUNGSUNTERNEHMEN				Countrywide Asset-Backed Certificates Trust 4,609 % fällig am 25.09.2037 ^	39	40	0,02
3,257 % fällig am 19.01.2027	200	179	0,11	Cikarang Listrindo Tbk PT 4,950 % fällig am 14.09.2026	500	468	0,28	Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust 4,579 % fällig am 25.04.2037	142	94	0,06
4,027 % fällig am 03.08.2050	300	188	0,11	Empresa Electrica Cochrane SpA 5,500 % fällig am 14.05.2027	199	184	0,11	JPMorgan Mortgage Acquisition Corp. 5,364 % fällig am 25.12.2035	1.100	984	0,58
4,987 % fällig am 19.01.2052	600	426	0,25	Greenko Power Ltd. 4,300 % fällig am 13.12.2028	287	241	0,14				
				Greenko Solar Mauritius Ltd. 5,550 % fällig am 29.01.2025	1.000	944	0,56				
				5,950 % fällig am 29.07.2026	300	275	0,16				

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Markets Corporate Bond Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
NovaStar Mortgage Funding Trust 4,589 % fällig am 25.09.2037	\$ 118	\$ 114	0,07	STAMMAKTIE				JAPAN TREASURY BILLS			
		1.427	0,84	ENERGIE				(0,163) % fällig am 16.01.2023 (c)(d)	¥ 430.000	\$ 3.259	1,93
				Constellation Oil Services Holding S.A. 'B' (b)(h)	361.648	\$ 39	0,03	Summe kurzfristige Instrumente		5.693	3,37
				Frontera Energy Corp. (b)	50.258	458	0,27	Summe Übertragbare Wertpapiere		\$ 143.387	84,86
						497	0,30				
STAATSEMISSIONEN				FINANZWERTE				AKTIEN			
Argentina Government International Bond 0,500 % fällig am 09.07.2030	18	4	0,00	Hipotecaria Su Casita S.A. (b)	332.624	0	0,00	INVESTMENTFONDS			
1,500 % fällig am 09.07.2035	11	3	0,00	BAUSTOFFE				ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN			
Chile Government International Bond 4,340 % fällig am 07.03.2042	900	764	0,45	Petra Diamonds Ltd. (b)	331.402	376	0,22	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (f)	1.615.635	16.082	9,51
Colombia Government International Bond 4,500 % fällig am 28.01.2026	1.000	943	0,56	OPTIONSSCHEINE				PIMCO Specialty Funds Ireland p.l.c. - PIMCO China Bond Fund (f)	25.272	337	0,20
Export-Credit Bank of Turkey 8,250 % fällig am 24.01.2024	900	914	0,54	OAS S.A. - Exp. 21.01.2039 (h)	175.616	0	0,00			16.419	9,71
Israel Government International Bond 0,150 % fällig am 31.07.2023	ILS 2.700	750	0,44								
1,500 % fällig am 30.11.2023	6.000	1.669	0,99	KURZFRISTIGE INSTRUMENTE							
Oman Government International Bond 6,250 % fällig am 25.01.2031	\$ 400	404	0,24	HUNGARY TREASURY BILLS							
Romania Government International Bond 4,625 % fällig am 03.04.2049	€ 500	387	0,23	18,250 % fällig am 03.01.2023 (c)(d)	HUF 642.000	1.711	1,01	BÖRSENGEHANDELTE FONDS			
Ukraine Government International Bond 4,375 % fällig am 27.01.2032 ^	\$ 300	60	0,04	ISRAEL TREASURY BILLS				PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (f)	1.000	99	0,06
7,750 % fällig am 01.09.2026 ^	\$ 300	65	0,04	1,734 % fällig am 05.07.2023 (c)(d)	ILS 2.600	723	0,43	Summe Investmentfonds		\$ 16.518	9,77
		5.963	3,53								

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft ⁽¹⁾	% des Nettovermögens
BPS	4,310 %	30.12.2022	03.01.2023	\$ 6.100	U.S. Treasury Notes 0,625 % fällig am 15.05.2030	\$ (6.235)	\$ 6.100	\$ 6.103	3,61
FICC	1,900	30.12.2022	03.01.2023	2.286	U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 08.06.2023	(2.332)	2.286	2.286	1,35
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (8.567)	\$ 8.386	\$ 8.389	4,96

⁽¹⁾ Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Euro-Bund 10-Year Bond March Futures	Short	03.2023	21	\$ 192	0,11
U.S. Treasury 2-Year Note March Futures	Long	03.2023	78	(1)	0,00
U.S. Treasury 5-Year Note March Futures	Long	03.2023	59	(3)	0,00
U.S. Treasury 10-Year Note March Futures	Long	03.2023	59	(15)	(0,01)
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond March Futures	Short	03.2023	25	(8)	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond March Futures	Short	03.2023	7	4	0,00
				\$ 169	0,10
Summe der an einem gereglten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ 169	0,10

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Jaguar Land Rover Automotive PLC	5,000 %	20.06.2026	€ 100	\$ 19	(0,01)

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.EM-37 5-Year Index	1,000 %	20.06.2027	\$ 490	\$ 19	0,01
CDX.EM-38 5-Year Index	1,000	20.12.2027	3.800	95	0,06

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.HY-39 5-Year Index	5,000 %	20.12.2027	\$ 1.000	\$ 40	0,03
CDX.IG-39 5-Year Index	1,000	20.12.2027	5.400	21	0,01
iTraxx Asia Ex-Japan 38 5-Year Index	1,000	20.12.2027	3.800	103	0,06
iTraxx Crossover 38 5-Year Index	5,000	20.12.2027	€ 1.100	52	0,03
iTraxx Europe Main 38 5-Year Index	1,000	20.12.2027	1.200	6	0,00
				\$ 336	0,20

ZINSSWAPS

Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,000 %	21.09.2024	\$ 12.500	\$ 304	0,18
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,750	21.06.2047	1.700	214	0,13
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	7,205	22.04.2027	ZAR 7.200	13	0,01
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	7,210	22.04.2027	35.600	(9)	(0,01)
					\$ 522	0,31
					\$ 839	0,50

Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate

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

⁽²⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definieren.

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

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

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽²⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BRC	America Movil S.A.B. de C.V.	1,000 %	20.12.2025	\$ 1.200	\$ (30)	\$ 37	\$ 7	0,00
	ONB Finance Ltd.	1,000	20.06.2023	400	3	(2)	1	0,00
CBK	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2026	50	0	0	0	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2026	900	(42)	7	(35)	(0,02)
MYC	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2027	400	(14)	9	(5)	0,00
					\$ (83)	\$ 51	\$ (32)	(0,02)

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

⁽²⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definieren.

VOLATILITÄTSSWAPS

Kontrahent	Zahlung/Erhalt Volatilität	Referenzeinheit	Volatilität Ausübungskurs	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
GLM	Zahlung	USD versus JPY 1-Year ATM Realized Volatility ⁽¹⁾	12,025 %	20.06.2023	\$ 28	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00

⁽¹⁾ Varianz-Swap

DEWISENTERMININKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens	
AZD	01.2023	¥	210.000	\$ 1.453	\$ (141)	\$ (141)	(0,08)	
BOA	03.2023	\$	87	ZAR 1.529	3	3	0,00	
BPS	01.2023	HUF	294.456	\$ 772	(13)	(13)	(0,01)	
	01.2023	\$	95	€ 89	0	0	0,00	
	01.2023		6	HUF 2.218	0	0	0,00	
	02.2023	ZAR	7.388	\$ 412	(21)	(21)	(0,01)	
	11.2023	ILS	3.988	1.152	(2)	(2)	0,00	
BRC	01.2023	CNH	3.978	571	(5)	(5)	0,00	
	01.2023	HUF	78.225	204	(5)	(5)	0,00	
CBK	01.2023	BRL	1.464	279	2	2	0,00	
	07.2023	ILS	5.208	1.570	75	75	0,05	
GLM	01.2023	CNH	4.129	594	0	(4)	(4)	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Markets Corporate Bond Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	01.2023	\$ 275	BRL 1.464	\$ 3	\$ 0	\$ 3	0,00
	01.2023	21	HKD 161	0	0	0	0,00
	04.2023	BRL 1.464	\$ 270	0	(3)	(3)	0,00
	05.2023	ZAR 2.683	161	5	0	5	0,00
JPM	01.2023	£ 1.447	1.747	6	0	6	0,00
	01.2023	\$ 477	CNY 3.319	4	0	4	0,00
	01.2023	26	ILS 90	0	(1)	(1)	0,00
	03.2023	856	CNY 5.924	5	0	5	0,00
MBC	01.2023	€ 5.506	\$ 5.770	0	(108)	(108)	(0,06)
	01.2023	¥ 220.000	1.522	0	(147)	(147)	(0,09)
	01.2023	\$ 126	€ 118	0	0	0	0,00
	01.2023	86	HKD 669	0	0	0	0,00
	05.2023	CNH 2.555	\$ 381	8	0	8	0,00
MYI	01.2023	€ 47	51	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 5	€ 5	0	0	0	0,00
SCX	04.2023	ZAR 8.444	\$ 459	0	(33)	(33)	(0,02)
UAG	01.2023	HUF 267.248	697	0	(16)	(16)	(0,01)
	01.2023	ZAR 7.403	413	0	(21)	(21)	(0,01)
	09.2023	\$ 96	ZAR 1.685	1	0	1	0,00
	11.2023	ILS 1.993	\$ 576	0	0	0	0,00
				\$ 112	\$ (520)	\$ (408)	(0,24)

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilsklasse E CHF (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2023	\$ 3.956	CHF 3.741	\$ 89	\$ 0	\$ 89	0,05
CBK	01.2023	6.740	6.367	147	0	147	0,09
MYI	01.2023	CHF 95	\$ 100	0	(3)	(3)	0,00
				\$ 236	\$ (3)	\$ 233	0,14

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend und E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	01.2023	€ 28	\$ 30	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	01.2023	\$ 9	€ 9	0	0	0	0,00
CBK	01.2023	34.771	33.532	1.032	0	1.032	0,61
MBC	01.2023	€ 110	\$ 117	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 49.596	€ 47.290	895	0	895	0,53
MYI	01.2023	6.378	6.048	79	0	79	0,04
SCX	01.2023	39.305	37.763	1.014	0	1.014	0,60
				\$ 3.020	\$ 0	\$ 3.020	1,78
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						\$ 2.813	1,66
Summe Anlagen						\$ 172.112	101,85
Sonstige Aktiva und Passiva						\$ (3.126)	(1,85)
Nettovermögen						\$ 168.986	100,00

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

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

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.

(b) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.

(c) Nullkuponwertpapier.

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

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

(f) Mit dem Fonds verbunden.

(g) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(h) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2021: 0,66 %):

Emittentenbeschreibung	Kauf- datum	Kosten	Markt- wert	% des Nettvermögens
Constellation Oil Services Holding S.A. 'B'	10.06.2022	\$ 39	\$ 39	0,03
Development Bank of Southern Africa 8,600 % fällig am 21.10.2024	07.10.2021	1.498	1.290	0,76
Invepar Holdings LLC 1,000 % fällig am 31.12.2049	16.11.2018	0	0	0,00
OAS Restructuring BVI Ltd. 5,000 % fällig am 31.03.2035	16.11.2018	14	4	0,00
OAS S.A. – Exp. 21.01.2039	16.11.2018	5	0	0,00
		\$ 1.556	\$ 1.333	0,79

Barmittel in Höhe von 1.839 USD (31. Dezember 2021: 1.115 USD) wurden zum 31. Dezember 2022 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 458	\$ 140.620	\$ 2.309	\$ 143.387
Investmentfonds	16.419	99	0	16.518
Pensionsgeschäfte	0	8.386	0	8.386
Finanzderivate ⁽³⁾	191	3.630	0	3.821
Summen	\$ 17.068	\$ 152.735	\$ 2.309	\$ 172.112

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

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 741	\$ 192.610	\$ 4.310	\$ 197.661
Investmentfonds	10.650	0	0	10.650
Pensionsgeschäfte	0	487	0	487
Finanzderivate ⁽³⁾	0	1.245	0	1.245
Summen	\$ 11.391	\$ 194.342	\$ 4.310	\$ 210.043

⁽¹⁾ Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

⁽²⁾ Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

⁽³⁾ Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung des Marktwerts der außerbörslich gehandelten Finanzderivate und (erhaltenen)/verpfändeten Sicherheiten nach Kontrahenten zum 31. Dezember 2022 und 31. Dezember 2021:

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2022			Zum 31. Dez. 2021		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾
AZD	\$ (141)	\$ 0	\$ (141)	\$ k. A.	\$ k. A.	\$ k. A.
BOA	92	(40)	52	9	0	9
BPS	(36)	0	(36)	73	0	73
BRC	(2)	0	(2)	31	0	31
CBK	1.221	(1.150)	71	(40)	0	(40)
DBL	k. A.	k. A.	k. A.	3	0	3
DUB	k. A.	k. A.	k. A.	1	0	1
GLM	1	0	1	112	0	112
GST	k. A.	k. A.	k. A.	14	0	14
HUS	k. A.	k. A.	k. A.	(28)	0	(28)
JPM	14	0	14	5	0	5
MBC	648	(550)	98	k. A.	k. A.	k. A.
MYC	(5)	0	(5)	(19)	0	(19)
MYI	76	0	76	30	(60)	(30)
RBC	k. A.	k. A.	k. A.	455	(300)	155
SCX	981	(940)	41	420	(340)	80
SSB	k. A.	k. A.	k. A.	(2)	0	(2)
TOR	k. A.	k. A.	k. A.	500	(390)	110
UAG	(36)	0	(36)	73	0	73

⁽¹⁾ Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2022:

	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	67,07	73,77
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	17,79	19,08
Investmentfonds	9,77	5,00
Pensionsgeschäfte	4,96	0,23
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,10	0,00
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,50	(0,19)
Freiverkehrsinanzderivate	1,66	0,77

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2022 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
Kreditbeteiligungen und -abtretungen	1,15	1,06
Unternehmensanleihen und Wechsel	70,02	81,26
US-Regierungsbehörden	0,76	k. A.
US-Schatzobligationen	3,90	4,84
Non-Agency-MBS	0,77	0,51
Forderungsbisicherte Wertpapiere	0,84	0,80
Staatsemissionen	3,53	4,03
Stammaktien	0,52	0,35
Optionsscheine	0,00	0,00
Kurzfristige Instrumente	3,37	k. A.
Investmentfonds	9,77	5,00
Pensionsgeschäfte	4,96	0,23
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,10	0,00
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf	(0,01)	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,20	(0,01)
Zinsswaps	0,31	(0,18)
Freiverkehrsinanzderivate		
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaptions auf Kreditindizes	k. A.	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzkauf	k. A.	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf	(0,02)	0,00
Zinsswaps	k. A.	0,00
Volatilitätsswaps	0,00	k. A.
Devisenterminkontrakte	(0,24)	0,03
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	1,92	0,74
Sonstige Aktiva und Passiva	(1,85)	1,34
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS		
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE													
ARGENTINIEN													
STAATSEMISSIONEN													
Argentina Government International Bond				Dominican Republic Central Bank Notes				Petroleos Mexicanos					
0,500 % fällig am 09.07.2030	\$	3.296	0,42	12,000 % fällig am 03.10.2025	DOP	84.300	\$ 1.443	0,70	6,375 % fällig am 23.01.2045	\$	1.800	\$ 1.119	0,54
1,500 % fällig am 09.07.2035		673	0,07						6,500 % fällig am 02.06.2041		4.000	2.613	1,27
				Dominican Republic Government International Bond					Trust Fibra Uno		400	344	0,17
				8,900 % fällig am 15.02.2023		95.100	1.686	0,82	6,390 % fällig am 15.01.2050		2.500	2.022	0,99
Summe Argentinien		1.010	0,49	Summe Dominikanische Republik		3.129	1,52				6.729	3,28	
BAHAMAS													
STAATSEMISSIONEN													
Bahamas Government International Bond				GHANA				STAATSEMISSIONEN					
5,750 % fällig am 16.01.2024		200	0,09	Ghana Government International Bond				Mexico Government International Bond					
6,000 % fällig am 21.11.2028		300	0,11	8,625 % fällig am 07.04.2034 ^	\$	2.100	768	0,37	7,750 % fällig am 13.11.2042	MXN	16.000	717	0,35
9,000 % fällig am 16.06.2029		400	0,17	8,627 % fällig am 16.06.2049 ^		200	71	0,04	8,000 % fällig am 07.11.2047		14.000	641	0,31
Summe Bahamas		769	0,37	8,750 % fällig am 11.03.2061 ^		400	141	0,07	8,500 % fällig am 18.11.2038		16.000	778	0,38
				Summe Ghana		980	0,48					2.136	1,04
								Summe Mexiko			8.865	4,32	
WEISSRUSSLAND													
STAATSEMISSIONEN													
Belarus Government International Bond				IRLAND				FÖRDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE					
6,200 % fällig am 28.02.2030 ^		200	0,03	Black Diamond CLO DAC	€	482	503	0,24	Mong Duong Finance Holdings BV				
6,378 % fällig am 24.02.2031 ^		300	0,05	Cairn CLO DAC					5,125 % fällig am 07.05.2029		2.800	2.334	1,14
Summe Belarus		170	0,08	2,158 % fällig am 15.10.2031		800	836	0,41	Prosus NV		1.300	790	0,38
				Carlyle Euro CLO DAC		1.399	1.457	0,71	Republic of Angola Via Avenir BV		1.080	1.064	0,52
				2,078 % fällig am 15.01.2031		1.300	1.345	0,66	9,687 % fällig am 07.12.2023		246	248	0,12
				Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd.					12,639 % fällig am 01.07.2023			4.436	2,16
				2,548 % fällig am 15.11.2031		500	518	0,25	Summe Niederlande				
				Harvest CLO DAC									
				2,775 % fällig am 26.06.2030			6.069	2,96	PERU				
				Oak Hill European Credit Partners DAC					UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
				2,196 % fällig am 20.10.2031					Banco de Credito del Peru S.A.	PEN	2.600	637	0,31
Summe Brasilien		5.435	2,65	Summe Irland		6.449	3,14		4,650 % fällig am 17.09.2024				
									Petroleos del Peru S.A.		1.500	983	0,48
				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					5,625 % fällig am 19.06.2047			1.620	0,79
				Alfa Bank AO Via Alfa Bond Issuance PLC		900	57	0,03	Summe Peru			6.524	3,18
				5,950 % fällig am 15.04.2030									
				^ (e)					STAATSEMISSIONEN				
				Sovcombank Via SovCom Capital DAC		400	24	0,01	Peru Government International Bond				
				8,000 % fällig am 07.04.2030			81	0,04	5,940 % fällig am 12.02.2029	PEN	700	168	0,08
				Summe Kaimaninseln		1.434	0,70		6,350 % fällig am 12.08.2028		2.600	649	0,32
									6,950 % fällig am 12.08.2031		200	50	0,02
				NON-AGENCY-MBS					8,200 % fällig am 12.08.2026		14.700	4.037	1,97
				European Loan Conduit DAC	€	293	299	0,14	Summe Peru				
				2,803 % fällig am 17.02.2030			6.449	3,14					
				Summe Irland		6.449	3,14		POLEN				
									STAATSEMISSIONEN				
				ISRAEL				STAATSEMISSIONEN					
				Israel Government International Bond	ILS	20.800	5.779	2,82	Poland Government International Bond	PLN	12.700	2.382	1,16
				0,150 % fällig am 31.07.2023					2,750 % fällig am 25.04.2028				
				ELFENBEINKÜSTE				RUSSLAND					
				KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNGEN				STAATSEMISSIONEN					
				Republik Côte d'Ivoire	€	900	917	0,45	Russia Government International Bond	€	100	31	0,02
				6,608 % fällig am 19.03.2027					5,100 % fällig am 28.03.2035 ^	\$	200	66	0,03
				Summe Jersey, Kanalinseln		2.646	1,29		Summe Russland			97	0,05
				JERSEY, KANALINSELN				SERBIEN					
				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				STAATSEMISSIONEN					
				Corsair International Ltd.		1.700	1.801	0,88	Serbia Government International Bond	RSD	13.800	104	0,05
				5,473 % fällig am 28.01.2027		800	845	0,41	4,500 % fällig am 20.08.2032				
				5,823 % fällig am 28.01.2029					SÜDAFRIKA				
				Summe Jersey, Kanalinseln		2.646	1,29		STAATSEMISSIONEN				
									South Africa Government International Bond	ZAR	75.100	3.936	1,92
				LUXEMBURG				STAATSEMISSIONEN					
				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				STAATSEMISSIONEN					
				FEL Energy SARL	\$	2.587	2.218	1,08	10,500 % fällig am 21.12.2026		102.900	6.394	3,12
				5,750 % fällig am 01.12.2040					Summe Südafrika			10.330	5,04
				Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.		1.600	215	0,11					
				5,250 % fällig am 23.05.2023					TUNESIEN				
				^ (e)					STAATSEMISSIONEN				
				Summe Luxemburg		2.433	1,19		Banque Centrale de Tunisie Government International Bond	€	200	180	0,09
									6,750 % fällig am 31.10.2023				
				MEXIKO				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
				Metalsa S.A. de C.V.		800	631	0,31					
				3,750 % fällig am 04.05.2031									

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 138,500 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond February 2023 Futures ⁽¹⁾	Short	01.2023	9	\$ (46)	(0,02)
U.S. Treasury 2-Year Note March Futures	Long	03.2023	115	(1)	0,00
U.S. Treasury 5-Year Note March Futures	Long	03.2023	341	(46)	(0,02)
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond March Futures	Short	03.2023	13	(4)	0,00
				\$ 697	0,34
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ 697	0,34

⁽¹⁾ Future-Style-Option.

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.HY-39 5-Year Index	5,000 %	20.12.2027	\$ 5.500	\$ 80	0,04
CDX.IG-39 5-Year Index	1,000	20.12.2027	21.600	87	0,04
				\$ 167	0,08

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
Zahlung	1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS	1,250 %	15.09.2031	SGD	1.000	\$ (29)	(0,01)
Erhalt	1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS	1,250	15.09.2031		1.000	113	0,05
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,562	14.02.2024	\$	22.300	865	0,42
Zahlung	1-Year BRL-CDI	5,580	02.01.2025	BRL	10.000	(256)	(0,12)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	6,220	02.01.2025		4.600	(91)	(0,04)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	6,675	02.01.2023		14.500	94	0,05
Erhalt	1-Year BRL-CDI	6,745	02.01.2025		10.500	156	0,08
Zahlung	1-Year BRL-CDI	6,950	04.01.2027		8.300	(204)	(0,10)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	8,570	04.01.2027		11.900	254	0,12
Zahlung	1-Year BRL-CDI	8,615	02.01.2025		6.000	(48)	(0,02)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,120	04.01.2027		2.500	(34)	(0,02)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,206	04.01.2027		9.400	(123)	(0,06)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,446	04.01.2027		28.200	(326)	(0,16)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,665	02.01.2024		5.800	(39)	(0,02)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,755	02.01.2024		22.000	(142)	(0,07)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	10,800	02.01.2024		51.900	325	0,16
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,833	02.01.2024		31.800	(198)	(0,10)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,995	02.01.2024		15.300	(87)	(0,04)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,055	04.01.2027		22.200	(191)	(0,09)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,065	02.01.2024		10.600	(57)	(0,03)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,148	02.01.2024		2.600	(13)	(0,01)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,170	04.01.2027		24.800	189	0,09
Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,920	02.01.2024		99.100	348	0,17
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,005	02.01.2025		22.100	(57)	(0,03)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,210	02.01.2025		15.500	(30)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,290	02.01.2024		54.800	(211)	(0,10)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,940	04.01.2027		27.000	51	0,03
Erhalt	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,500	16.03.2027	CNY	35.200	44	0,02
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	2,690	24.07.2024	COP	7.257.000	208	0,10
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	2,740	24.07.2024		7.084.900	(202)	(0,10)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	3,100	26.11.2025		2.651.000	106	0,05
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	4,060	26.11.2025		14.071.000	490	0,24
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	4,110	23.03.2026		4.493.200	(150)	(0,07)
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	4,651	26.11.2025		2.624.800	(83)	(0,04)
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	5,050	16.07.2026		34.330.400	(1.185)	(0,59)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	6,130	26.10.2026		25.320.800	721	0,35
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	6,885	31.01.2025		24.609.000	425	0,21
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	7,080	02.02.2027		1.622.900	37	0,02
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	7,090	28.04.2028		1.750.200	43	0,02
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	7,130	31.01.2027		8.865.000	197	0,10
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	7,130	28.04.2028		618.500	15	0,01
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	7,140	28.04.2028		1.855.800	43	0,02
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,320	31.03.2027		2.908.000	(39)	(0,02)
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,560	30.03.2027		4.424.200	(51)	(0,02)
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,686	30.03.2027		26.334.600	(283)	(0,14)
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	9,140	28.04.2028		3.977.000	(30)	(0,01)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	11,640	21.10.2025		11.114.000	(55)	(0,03)
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	11,930	10.11.2025		5.929.100	38	0,02
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	12,000	26.11.2025		427.000	(3)	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund (Forts.)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum		Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	12,060 %	09.11.2025	COP	4.198.000	\$ 30	0,01
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,750	16.06.2031	\$	2.500	383	0,19
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,000	16.12.2025		7.900	(968)	(0,47)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,250	17.06.2025		400	(41)	(0,02)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,250	17.06.2030		3.070	(622)	(0,30)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,250	16.12.2050		1.500	624	0,30
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,250	16.06.2051		11.300	2.520	1,23
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,500	21.06.2024		7.100	(261)	(0,13)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,500	18.12.2024		270	19	0,01
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,500	18.12.2029		4.100	503	0,25
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,750	15.12.2031		2.700	481	0,23
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	2,250	21.12.2046		1.800	(409)	(0,20)
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	5,757	14.04.2026	ZAR	96.300	(363)	(0,18)
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	6,665	09.01.2023		20.100	(1)	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,500	17.10.2027		63.600	72	0,04
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	0,905	24.11.2023	CLP	1.293.300	128	0,06
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	0,975	03.04.2023		110.000	(6)	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	1,070	07.04.2023		675.000	(39)	(0,02)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	1,070	10.12.2023		1.218.000	(114)	(0,06)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	1,080	10.12.2023		1.218.000	(114)	(0,06)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	1,090	10.12.2023		2.828.000	(265)	(0,13)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	1,183	27.03.2023		357.900	(19)	(0,01)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	1,190	19.03.2023		970.000	(54)	(0,03)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	1,200	27.03.2023		103.400	(6)	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	1,345	11.06.2025		1.350.000	212	0,10
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	1,900	01.03.2023		565.000	28	0,01
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	1,947	23.11.2027		999.000	205	0,10
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	1,950	05.05.2026		1.239.600	(215)	(0,10)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	1,965	24.11.2027		851.000	173	0,08
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	2,020	30.04.2026		1.300.000	(226)	(0,11)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	2,110	01.03.2023		1.030.000	51	0,03
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	2,120	01.03.2023		1.290.000	64	0,03
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	2,183	04.12.2027		2.661.000	(506)	(0,25)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	2,360	22.01.2025		1.099.200	(175)	(0,09)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	2,640	01.03.2026		795.000	132	0,06
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	3,530	06.07.2026		1.995.000	290	0,14
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	4,000	06.07.2028		1.019.000	136	0,07
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,130	01.03.2025		1.820.000	139	0,07
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,180	01.10.2028		790.000	36	0,02
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,240	01.09.2030		1.286.000	45	0,02
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,260	01.03.2026		620.000	41	0,02
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,370	01.10.2028		3.136.000	106	0,05
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,470	01.09.2030		460.000	8	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,570	01.10.2028		245.000	5	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,600	12.12.2027		1.803.000	26	0,01
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,635	12.12.2027		3.695.000	46	0,02
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,720	28.01.2025		4.012.000	271	0,13
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,754	28.01.2025		3.238.000	211	0,10
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,760	28.01.2025		1.933.000	126	0,06
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,915	01.02.2025		3.534.300	213	0,10
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,020	02.03.2029		190.000	2	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,270	02.03.2027		415.700	(3)	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,360	25.05.2027		24.600	1	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,386	24.05.2027		1.861.000	24	0,01
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	6,500	12.12.2025		2.564.000	24	0,01
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,530	28.01.2023		5.882.000	(210)	(0,10)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,540	28.01.2023		5.621.000	(200)	(0,10)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,560	28.01.2023		14.885.000	(526)	(0,26)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	6,567	12.12.2025		1.464.000	10	0,01
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	6,570	22.12.2025		1.277.000	7	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	6,590	22.12.2025		3.565.000	17	0,01
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,590	21.03.2027		4.540.300	(28)	(0,01)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	7,000	27.09.2032		1.785.800	249	0,12
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	7,690	10.05.2025		7.125.500	(45)	(0,02)
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	0,670	28.01.2023	CZK	328.600	464	0,23
Zahlung ⁽⁹⁾	6-Month CZK-PRIBOR	1,025	29.07.2030		35.800	(199)	(0,10)
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	1,224	28.01.2031		68.900	(790)	(0,39)
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	1,441	28.01.2023		164.100	(174)	(0,08)
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	1,575	26.03.2026		28.100	(153)	(0,07)
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	1,725	22.07.2026		23.800	(154)	(0,07)
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	1,815	28.01.2031		34.200	327	0,16
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	2,000	19.06.2024		26.100	(78)	(0,04)
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	2,255	15.01.2023		122.200	83	0,04
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	3,490	18.01.2032		10.600	45	0,02
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	3,680	03.03.2027		78.400	147	0,07
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	4,164	14.03.2027		73.600	107	0,05
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	4,220	14.03.2027		73.500	98	0,05
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	4,300	18.03.2027		143.400	(138)	(0,07)
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	4,310	15.03.2027		19.100	22	0,01
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	4,320	15.03.2027		7.200	8	0,00
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	4,560	14.07.2032		111.300	258	0,13

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum		Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	5,606 %	28.06.2027	CZK	54.800	94	0,05
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,550	15.12.2040	€	300	146	0,07
Erhalt ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	1,500	15.03.2028		1.500	71	0,04
Erhalt ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	1,750	15.03.2033		2.000	57	0,03
Zahlung	6-Month HUF-BBR	1,500	19.06.2024	HUF	1.427.600	(646)	(0,31)
Erhalt	6-Month HUF-BBR	1,760	21.01.2030		380.000	437	0,21
Zahlung	6-Month HUF-BBR	1,958	19.03.2026		398.600	(293)	(0,14)
Erhalt	6-Month HUF-BBR	5,500	04.03.2027		2.382.600	1.125	0,55
Zahlung	6-Month HUF-BBR	6,280	18.03.2027		2.363.300	(869)	(0,42)
Erhalt	6-Month HUF-BBR	13,600	12.12.2024		1.418.700	24	0,01
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	0,250	28.01.2023	PLN	57.900	(461)	(0,22)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	0,770	28.01.2023		28.900	195	0,10
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	1,110	12.01.2031		9.800	743	0,36
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	1,165	28.01.2031		4.400	(178)	(0,09)
Erhalt ⁽³⁾	6-Month PLN-WIBOR	1,215	29.07.2030		10.300	384	0,19
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	1,855	28.01.2031		6.000	(380)	(0,18)
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	1,933	17.01.2025		11.800	(338)	(0,16)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	3,035	09.12.2026		42.000	1.077	0,53
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	4,075	07.03.2027		28.700	398	0,19
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	4,830	18.03.2027		28.300	(143)	(0,07)
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	4,895	17.03.2027		15.000	(102)	(0,05)
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	4,920	17.03.2027		15.000	(98)	(0,05)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	6,300	25.04.2028		11.900	45	0,02
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	6,670	28.06.2027		14.400	167	0,08
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	6,725	27.06.2027		20.700	(252)	(0,12)
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	6,843	28.06.2027		1.500	20	0,01
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	7,310	30.06.2027		11.000	(197)	(0,10)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,080	16.06.2025	MXN	16.400	(85)	(0,04)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,700	12.09.2030		35.400	(309)	(0,15)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	5,770	09.10.2030		150.700	1.297	0,63
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,850	19.08.2030		12.100	(100)	(0,05)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,875	16.08.2030		16.800	(137)	(0,07)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,880	16.08.2030		8.700	(71)	(0,03)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,920	16.08.2030		9.100	(73)	(0,04)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	6,240	10.07.2026		156.300	(603)	(0,29)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	6,383	30.08.2040		23.200	259	0,13
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	6,480	28.05.2040		16.700	(61)	(0,03)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	6,495	17.07.2026		140.500	562	0,27
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	6,505	17.07.2026		102.100	406	0,20
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	6,520	03.08.2040		5.700	60	0,03
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	6,520	06.08.2040		8.100	85	0,04
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	6,533	03.08.2040		10.900	114	0,06
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	6,580	01.01.2025		29.700	(95)	(0,05)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	6,580	03.08.2040		6.000	61	0,03
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	6,830	27.12.2029		19.900	(102)	(0,05)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	6,845	02.07.2026		118.100	312	0,15
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,570	19.11.2026		145.200	(480)	(0,23)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,675	04.06.2029		65.100	(177)	(0,09)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,465	16.08.2027		167.300	130	0,06
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,480	24.03.2027		121.900	(125)	(0,06)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,700	05.11.2027		8.700	(3)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,743	05.11.2027		37.900	(8)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,760	05.11.2027		25.400	(5)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,773	05.11.2027		37.600	(6)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	9,045	04.11.2027		17.200	7	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	9,053	04.11.2027		18.900	8	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	9,117	04.11.2027		47.100	25	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	9,165	05.11.2026		25.600	9	0,00
						\$ 4.581	2,23
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate						\$ 4.748	2,31

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

⁽²⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definieren.

⁽³⁾ Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund (Forts.)

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

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

OPTIONSKAUF

DEISENOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Put – OTC EUR versus CZK	CZK 23,830	01.11.2023	802	\$ 84	\$ 152	0,07
GLM	Put – OTC EUR versus HUF	HUF 385,000	01.11.2023	203	27	29	0,01
	Put – OTC EUR versus PLN	PLN 4,560	01.11.2023	806	89	123	0,06
JPM	Call – OTC AUD versus USD	\$ 0,735	04.05.2023	909	55	91	0,04
	Put – OTC EUR versus HUF	HUF 385,000	01.11.2023	403	38	57	0,03
MBC	Put – OTC USD versus MXN	MXN 18,310	04.05.2023	550	55	40	0,02
MYI	Put – OTC USD versus BRL	BRL 4,450	04.05.2023	535	53	16	0,01
	Put – OTC USD versus ZAR	ZAR 15,925	04.05.2023	535	54	96	0,05
					\$ 455	\$ 604	0,29

VERKAUFSOPTIONEN

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
GLM	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,067 %	09.06.2023	800	\$ (10)	\$ (2)	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	3,140	09.06.2023	800	(11)	(26)	(0,01)
							\$ (21)	\$ (28)	(0,01)

⁽¹⁾ Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHÜTZKAUF⁽¹⁾

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag ⁽²⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Brazil Government International Bond	(1,000) %	20.12.2024	\$ 1.800	\$ 27	\$ (22)	\$ 5	0,00
BRC	Brazil Government International Bond	(1,000)	20.12.2024	1.000	16	(13)	3	0,00
CBK	Mexico Government International Bond	(1,000)	20.12.2024	100	(1)	0	(1)	0,00
GST	Mexico Government International Bond	(1,000)	20.12.2024	2.000	(23)	9	(14)	(0,01)
HUS	Mexico Government International Bond	(1,000)	20.12.2024	1.100	(13)	5	(8)	0,00
JPM	Brazil Government International Bond	(1,000)	20.12.2024	3.200	63	(53)	10	0,01
					\$ 69	\$ (74)	\$ (5)	0,00

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHÜTZVERKAUF⁽²⁾

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag ⁽³⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Montenegro Government International Bond	1,000 %	20.06.2023	€ 500	\$ (39)	\$ 32	\$ (7)	0,00
BPS	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2023	\$ 200	0	0	0	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.12.2024	4.800	(458)	171	(287)	(0,14)
BRC	Argentina Government International Bond	5,000	20.12.2023	4.400	(673)	127	(546)	(0,27)
JPM	Nigeria Government International Bond	1,000	20.06.2023	600	(14)	5	(9)	(0,01)
					\$ (1.184)	\$ 335	\$ (849)	(0,42)

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

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

⁽³⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definieren.

CROSS-CURRENCY SWAPS

Kontrahent	Erhalt	Zahlung	Fälligkeits-datum	Nennbetrag erhaltener Währung	Nennbetrag gelieferter Währung	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
GLM	Variabler Zinssatz entspricht 6-Month USD-LIBOR zzgl. 0,282 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 6-Month ARS-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	07.06.2027	\$ 100	ARS 4.488	\$ 0	\$ 93	\$ 93	0,04

ZINSSWAPS

Kontrahent	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettovermögens
BOA	Zahlung	3-Month MYR-KLIBOR	3,750 %	15.06.2027	MYR 21.600	\$ (38)	\$ 41	\$ 3	0,00
BPS	Zahlung	3-Month MYR-KLIBOR	2,670	16.06.2026	10.600	0	(84)	(84)	(0,04)
	Zahlung	6-Month THB-THBFX	1,890	18.09.2029	THB 52.800	0	(44)	(44)	(0,02)
CBK	Zahlung	6-Month THB-THBFX	1,050	18.03.2027	73.000	0	(97)	(97)	(0,05)
GST	Zahlung	3-Month THB-THORON Compounded-OIS	2,500	21.09.2027	553.000	(209)	426	217	0,11
JPM	Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	3,020	06.06.2024	CLP 770.000	0	(72)	(72)	(0,04)
MYC	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,000	15.12.2026	MYR 13.400	3	81	84	0,04
MYI	Zahlung	3-Month MYR-KLIBOR	3,340	18.09.2029	3.500	0	(27)	(27)	(0,01)
SCX	Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,430	06.03.2025	CNY 25.600	0	1	1	0,00
	Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	3,020	04.02.2025	26.000	0	28	28	0,01
	Zahlung	3-Month MYR-KLIBOR	2,750	15.09.2026	MYR 3.700	11	(40)	(29)	(0,01)
	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,230	23.08.2024	6.500	0	11	11	0,01
	Erhalt	3-Month THB-THORON Compounded-OIS	2,000	21.09.2027	THB 370.000	16	83	99	0,05
	Erhalt	6-Month THB-THBFX	1,209	15.01.2025	199.300	0	70	70	0,03
UAG	Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,920	15.01.2025	CNY 43.900	0	78	78	0,04
						\$ (217)	\$ 455	\$ 238	0,12

VOLATILITÄTSSWAPS

Kontrahent	Zahlung/Erhalt Volatilität	Referenzzeitpunkt	Volatilität Ausübungskurs	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettovermögens
GLM	Zahlung	USD versus JPY 1-Year ATM Realized Volatility ⁽¹⁾	12,025 %	20.06.2023	\$ 34	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00

⁽¹⁾ Varianz-Swap

DEVISENTERMINKONTRÄKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	01.2023	THB 39.834	\$ 1.149	\$ 0	\$ (3)	\$ (3)	0,00
BOA	01.2023	CNH 44.408	6.882	455	0	455	0,22
	01.2023	HUF 2.234.407	5.703	0	(252)	(252)	(0,12)
	01.2023	¥ 2.512.000	17.615	0	(1.435)	(1.435)	(0,70)
	01.2023	MYR 18.800	4.238	0	(30)	(30)	(0,01)
	01.2023	PLN 269	61	0	0	0	0,00
	01.2023	RON 22	4	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 13.583	MYR 60.245	93	0	93	0,05
	01.2023	41	PLN 181	0	0	0	0,00
	02.2023	CAD 1.570	\$ 1.154	0	(5)	(5)	0,00
	02.2023	€ 3.017	3.206	0	(23)	(23)	(0,01)
	02.2023	£ 2.167	2.557	0	(53)	(53)	(0,03)
	02.2023	¥ 1.523.800	10.450	0	(1.158)	(1.158)	(0,56)
	02.2023	\$ 6.875	CNH 44.408	0	(432)	(432)	(0,21)
	02.2023	368	EGP 8.142	0	(59)	(59)	(0,03)
	02.2023	6.078	€ 5.735	60	0	60	0,03
	02.2023	238	¥ 31.200	0	(1)	(1)	0,00
	02.2023	888	NOK 8.816	8	0	8	0,00
	03.2023	ZAR 403	\$ 23	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	INR 368.549	4.581	191	0	191	0,09
	07.2023	\$ 4.572	INR 368.549	0	(182)	(182)	(0,09)
BPS	01.2023	BRL 11.960	\$ 2.200	0	(65)	(65)	(0,03)
	01.2023	HUF 1.673.567	4.332	0	(128)	(128)	(0,06)
	01.2023	MYR 27.351	6.177	0	(32)	(32)	(0,02)
	01.2023	\$ 6.791	CNH 44.408	0	(365)	(365)	(0,18)
	01.2023	135	ILS 463	0	(4)	(4)	0,00
	01.2023	6.179	MYR 27.351	75	0	75	0,04
	01.2023	12	THB 401	0	0	0	0,00
	02.2023	€ 16.971	\$ 17.598	0	(567)	(567)	(0,28)
	02.2023	ILS 10.949	3.254	147	0	147	0,07
	03.2023	CLP 4.690.457	4.857	0	(589)	(589)	(0,29)
	03.2023	COP 31.852.643	6.384	7	(105)	(98)	(0,05)
	03.2023	MXN 128.503	6.376	0	(128)	(128)	(0,06)
	03.2023	PEN 4.439	1.149	0	(7)	(7)	0,00
	03.2023	TWD 664	22	0	0	0	0,00
	03.2023	\$ 4.530	MXN 88.892	0	(31)	(31)	(0,02)
	03.2023	13	TWD 404	0	0	0	0,00
	04.2023	131	ZAR 2.355	6	0	6	0,00
BRC	01.2023	CZK 5.574	\$ 236	0	(10)	(10)	(0,01)
	01.2023	HUF 18.908	43	0	(8)	(8)	0,00
	01.2023	MYR 30.673	6.777	0	(239)	(239)	(0,12)
	01.2023	PEN 17.378	4.479	0	(68)	(68)	(0,03)
	01.2023	PLN 276	55	0	(8)	(8)	0,00
	01.2023	\$ 233	CNH 1.627	2	0	2	0,00
	01.2023	5.603	MYR 26.375	430	0	430	0,21

Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	01.2023	\$ 98	PHP 5.452	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	01.2023	135	PLN 601	2	0	2	0,00
	01.2023	3.605	SGD 4.855	16	0	16	0,01
	02.2023	£ 3.303	\$ 4.070	92	0	92	0,04
CBK	01.2023	CLP 7.787.302	8.754	0	(380)	(380)	(0,19)
	01.2023	HUF 2.308.811	5.787	0	(349)	(349)	(0,17)
	01.2023	PEN 6.800	1.693	0	(86)	(86)	(0,04)
	01.2023	PLN 2.167	468	0	(25)	(25)	(0,01)
	01.2023	\$ 8.170	CLP 7.784.676	961	0	961	0,47
	01.2023	205	PLN 976	18	0	18	0,01
	02.2023	AUD 55	\$ 37	0	(1)	(1)	0,00
	02.2023	EGP 8.142	323	14	0	14	0,01
	02.2023	PEN 5.360	1.359	0	(41)	(41)	(0,02)
	02.2023	\$ 7.285	BRL 39.315	121	0	121	0,06
	02.2023	8.754	CLP 7.830.195	386	0	386	0,19
	02.2023	4.745	£ 3.857	0	(100)	(100)	(0,05)
	02.2023	ZAR 7.435	\$ 427	0	(8)	(8)	0,00
	03.2023	COP 479.490	100	2	0	2	0,00
	03.2023	MXN 30.534	1.520	0	(28)	(28)	(0,01)
	03.2023	PEN 7.977	2.034	0	(45)	(45)	(0,02)
	03.2023	\$ 13.778	MXN 270.304	0	(98)	(98)	(0,05)
	03.2023	94	PEN 377	4	0	4	0,00
	03.2023	209	UYU 8.254	0	(5)	(5)	0,00
	04.2023	PEN 45.366	\$ 11.322	0	(473)	(473)	(0,23)
	05.2023	ILS 8.527	2.518	84	0	84	0,04
	05.2023	MXN 238	12	0	0	0	0,00
	05.2023	PEN 3.123	790	0	(20)	(20)	(0,01)
	07.2023	ILS 20.381	5.868	15	0	15	0,01
CLY	01.2023	HUF 346.900	882	0	(43)	(43)	(0,02)
	01.2023	MYR 14.044	2.991	0	(221)	(221)	(0,11)
	11.2023	€ 443	HUF 205.188	25	0	25	0,01
DUB	01.2023	DKK 19.473	\$ 2.745	0	(51)	(51)	(0,03)
	01.2023	TRY 46.814	2.288	0	(194)	(194)	(0,09)
	01.2023	\$ 5.420	HUF 2.450.731	1.094	0	1.094	0,53
	03.2023	COP 23.306.933	\$ 4.681	0	(61)	(61)	(0,03)
	03.2023	\$ 2.250	COP 10.393.012	0	(135)	(135)	(0,07)
GLM	01.2023	COP 57.664.556	\$ 11.895	17	0	17	0,01
	01.2023	HUF 600	2	0	0	0	0,00
	01.2023	¥ 1.642.000	11.996	0	(457)	(457)	(0,22)
	01.2023	MYR 9.660	2.086	0	(124)	(124)	(0,06)
	01.2023	PLN 22.862	4.533	0	(676)	(676)	(0,33)
	01.2023	\$ 2.244	BRL 11.960	21	0	21	0,01
	01.2023	243	CNH 1.689	2	0	2	0,00
	01.2023	2.240	CZK 55.425	208	0	208	0,10
	01.2023	3.809	MYR 17.831	269	0	269	0,13
	01.2023	4.346	PEN 17.481	228	0	228	0,11
	01.2023	197	PLN 917	12	0	12	0,01
	01.2023	5.282	THB 184.090	41	0	41	0,02
	02.2023	COP 35.665.213	\$ 7.047	0	(242)	(242)	(0,12)
	02.2023	DOP 76.373	1.382	33	0	33	0,02
	02.2023	\$ 3.415	COP 15.556.605	0	(236)	(236)	(0,12)
	03.2023	COP 5.844.557	\$ 1.212	22	0	22	0,01
	03.2023	MXN 168.733	8.284	0	(256)	(256)	(0,12)
	03.2023	\$ 1.632	CLP 1.486.898	97	0	97	0,05
	03.2023	12.946	COP 63.509.113	0	(23)	(23)	(0,01)
	04.2023	BRL 11.960	\$ 2.205	0	(21)	(21)	(0,01)
	04.2023	DOP 81.364	1.479	59	0	59	0,03
	05.2023	\$ 14.053	PEN 55.953	465	0	465	0,23
IND	06.2024	815	TWD 20.969	0	(94)	(94)	(0,05)
JPM	01.2023	HUF 42	\$ 0	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 2.905	CNY 20.218	23	0	23	0,01
	01.2023	2.330	TRY 44.334	20	0	20	0,01
	02.2023	NOK 11.325	\$ 1.144	0	(7)	(7)	0,00
	02.2023	\$ 393	TWD 11.945	0	(3)	(3)	0,00
	03.2023	5.217	CNY 36.092	30	0	30	0,01
	03.2023	6.098	IDR 95.446.772	72	0	72	0,04
	06.2023	1.504	VND 36.096.000	2	0	2	0,00
MBC	11.2023	HUF 205.375	€ 443	0	(25)	(25)	(0,01)
	01.2023	DKK 17.664	\$ 2.495	0	(41)	(41)	(0,02)
	01.2023	\$ 55	PLN 279	9	0	9	0,00
	02.2023	¥ 26.800	\$ 193	0	(11)	(11)	(0,01)
	02.2023	MXN 1.833	89	0	(4)	(4)	0,00
	02.2023	\$ 1.093	CAD 1.449	0	(24)	(24)	(0,01)
	02.2023	6.503	ZAR 117.923	404	0	404	0,20
	03.2023	MXN 39.648	\$ 1.973	0	(40)	(40)	(0,02)
	03.2023	\$ 3.000	COP 13.689.104	0	(214)	(214)	(0,10)
	03.2023	3.701	IDR 57.931.255	44	0	44	0,02
	03.2023	22	ZAR 403	1	0	1	0,00
MYI	05.2023	CNH 8.536	\$ 1.272	26	0	26	0,01
	01.2023	MYR 17.741	3.761	0	(297)	(297)	(0,14)
	01.2023	PLN 1.120	237	0	(18)	(18)	(0,01)
	01.2023	\$ 2.139	CZK 52.988	201	0	201	0,10

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermogens
	01.2023	\$ 8	€ 7	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	01.2023	6.036	MYR 27.912	349	0	349	0,17
	01.2023	74	PLN 368	10	0	10	0,00
	02.2023	MXN 1.393	\$ 71	0	0	0	0,00
	02.2023	\$ 724	TWD 22.084	0	(3)	(3)	0,00
	02.2023	ZAR 218.748	\$ 12.450	0	(361)	(361)	(0,18)
	03.2023	MXN 43.665	2.207	0	(3)	(3)	0,00
	03.2023	\$ 5.205	IDR 81.624.118	72	0	72	0,04
	04.2023	302	ZAR 5.255	4	0	4	0,00
	04.2023	ZAR 32.445	\$ 1.748	0	(143)	(143)	(0,07)
RBC	01.2023	PLN 271	59	0	(3)	(3)	0,00
	02.2023	\$ 1.347	NOK 13.442	20	0	20	0,01
	03.2023	5.857	MXN 117.135	78	0	78	0,04
	04.2023	MXN 47.739	\$ 2.303	0	(99)	(99)	(0,05)
SCX	01.2023	KRW 10.309	8	0	0	0	0,00
	01.2023	MYR 23.452	5.302	0	(38)	(38)	(0,02)
	01.2023	\$ 3.185	MYR 14.094	38	0	38	0,02
	01.2023	ZMW 686	\$ 38	0	0	0	0,00
	02.2023	TWD 54.385	1.768	0	(10)	(10)	(0,01)
	02.2023	\$ 239	€ 231	8	0	8	0,00
	04.2023	106	ZAR 1.843	2	0	2	0,00
SOG	01.2023	RON 222	\$ 44	0	(4)	(4)	0,00
	01.2023	SGD 4.633	3.421	0	(34)	(34)	(0,02)
	04.2023	\$ 116	ZAR 2.016	2	0	2	0,00
SSB	01.2023	11.248	COP 57.664.556	630	0	630	0,31
TOR	02.2023	2.422	ZAR 43.933	151	0	151	0,07
UAG	01.2023	CZK 104.341	\$ 4.466	0	(142)	(142)	(0,07)
	01.2023	HUF 1	0	0	0	0	0,00
	01.2023	TRY 107.611	5.293	0	(405)	(405)	(0,20)
	01.2023	\$ 2.028	CZK 51.588	250	0	250	0,12
	01.2023	35	HUF 13.687	2	0	2	0,00
	02.2023	CNH 44.408	\$ 6.907	464	0	464	0,23
				\$ 8.694	\$ (12.410)	\$ (3.716)	(1,81)

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 31. Dezember 2022 standen fur die Anteilsklassen Institutional EUR (Partially Hedged) thesaurierend und E EUR (Partially Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermogens
AZD	01.2023	€ 5.815	\$ 6.195	\$ 0	\$ (14)	\$ (14)	(0,01)
BOA	01.2023	MXN 65	3	0	0	0	0,00
BPS	01.2023	CNY 4.023	579	0	(3)	(3)	0,00
CBK	01.2023	2.597	372	0	(4)	(4)	0,00
	01.2023	€ 2.221	2.364	0	(7)	(7)	(0,01)
	01.2023	IDR 5.117.447	325	0	(7)	(7)	0,00
	01.2023	THB 5.609	161	0	(1)	(1)	0,00
	01.2023	\$ 33	CNY 235	1	0	1	0,00
	01.2023	147	€ 138	1	0	1	0,00
	01.2023	3	MXN 65	0	0	0	0,00
	02.2023	MXN 65	\$ 3	0	0	0	0,00
GLM	01.2023	BRL 470	85	0	(3)	(3)	0,00
	01.2023	\$ 89	BRL 470	0	0	0	0,00
	01.2023	434	RON 2.052	8	0	8	0,00
	02.2023	BRL 470	\$ 88	0	0	0	0,00
JPM	01.2023	\$ 391	TRY 8.043	36	0	36	0,02
MBC	01.2023	€ 42	\$ 45	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 36.896	€ 35.174	659	0	659	0,32
	01.2023	229	£ 188	0	(3)	(3)	0,00
SCX	01.2023	TRY 805	\$ 43	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 3.528	CNY 25.186	118	0	118	0,06
	01.2023	24.134	€ 23.187	623	0	623	0,30
SOG	01.2023	3.812	PLN 17.262	122	0	122	0,06
UAG	01.2023	€ 6.711	\$ 7.164	0	(1)	(1)	0,00
	01.2023	IDR 3.956	0	0	0	0	0,00
	01.2023	PLN 4.458	1.009	0	(7)	(7)	0,00
	01.2023	RON 448	97	0	0	0	0,00
	01.2023	TRY 955	51	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 718	THB 25.281	12	0	12	0,01
				\$ 1.580	\$ (50)	\$ 1.530	0,75

Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund (Forts.)

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilsklasse Institutional GBP (Partially Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2023	\$ 33	£ 27	\$ 0	\$ (1)	\$ (1)	0,00
	02.2023	5	TRY 86	0	0	0	0,00
CBK	01.2023	IDR 50.271	\$ 3	0	0	0	0,00
	01.2023	0	CNY 2	0	0	0	0,00
GLM	01.2023	34	PLN 156	1	0	1	0,00
JPM	01.2023	298	£ 246	0	(1)	(1)	0,00
MBC	01.2023	30	€ 29	1	0	1	0,00
	01.2023	6	£ 5	0	0	0	0,00
MYI	01.2023	1	TRY 11	0	0	0	0,00
SCX	01.2023	31	CNY 221	1	0	1	0,00
TOR	01.2023	185	£ 154	0	0	0	0,00
UAG	01.2023	IDR 46	\$ 0	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 6	THB 224	0	0	0	0,00
				\$ 3	\$ (2)	\$ 1	0,00
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						\$ (2.132)	(1,04)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
EINLAGENZERTIFIKATE			
BanColombia S.A.			
2,860 % fällig am 25.02.2024	COP 500.000	\$ 96	0,05
12,021 % fällig am 04.08.2023	200.000	41	0,02
Summe Einlagenzertifikate		\$ 137	0,07
Summe Anlagen		\$ 200.553	97,77
Sonstige Aktiva und Passiva		\$ 4.578	2,23
Nettovermögen		\$ 205.131	100,00

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

- * Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt
- ^ Das Wertpapier ist in Verzug.
- (a) Nullkuponwertpapier.
- (b) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.
- (c) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.
- (d) Mit dem Fonds verbunden.
- (e) Bedingt wandelbares Wertpapier.

Barmittel in Höhe von 4.974 USD (31. Dezember 2021: 4.853 USD) wurden zum 31. Dezember 2022 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von 0 USD (31. Dezember 2021: 1.314 USD) und Barmittel in Höhe von 5.521 USD (31. Dezember 2021: 400 USD) wurden gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. zum 31. Dezember 2022 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 180.287	\$ 1.313	\$ 181.600
Investmentfonds	14.173	624	0	14.797
Pensionsgeschäfte	0	706	0	706
Finanzderivate ⁽³⁾	126	3.194	(7)	3.313
Einlagen bei Kreditinstituten	0	0	137	137
Summen	\$ 14.299	\$ 184.811	\$ 1.443	\$ 200.553

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

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 260.774	\$ 4.484	\$ 265.258
Investmentfonds	15.188	0	0	15.188
Pensionsgeschäfte	0	688	0	688
Finanzderivate ⁽³⁾	212	4.425	(27)	4.610
Summen	\$ 15.400	\$ 265.887	\$ 4.457	\$ 285.744

- (1) Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.
- (2) Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.
- (3) Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung des Marktwerts der außerbörslich gehandelten Finanzderivate und (erhaltenen)/verpfändeten Sicherheiten nach Kontrahenten zum 31. Dezember 2022 und 31. Dezember 2021:

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2022			Zum 31. Dez. 2021		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾
AZD	\$ (17)	\$ 0	\$ (17)	k. A.	k. A.	k. A.
BOA	(2.672)	2.460	(212)	1.621	(1.870)	(249)
BPS	(2.204)	1.480	(724)	622	(370)	252
BRC	(334)	510	176	(337)	645	308
BSS	k. A.	k. A.	k. A.	61	0	61
CBK	(169)	10	(159)	(3)	0	(3)
CLY	(239)	0	(239)	k. A.	k. A.	k. A.
DUB	653	(650)	3	15	0	15
GLM	(338)	440	102	1.060	(830)	230
GST	203	(260)	(57)	(31)	0	(31)
HUS	(8)	0	(8)	188	(280)	(92)
IND	(94)	340	246	5	0	5
JPM	224	0	224	899	(960)	(61)
MBC	847	(804)	43	k. A.	k. A.	k. A.
MYC	84	0	84	(207)	260	53
MYI	(104)	281	177	872	(810)	62
RBC	(4)	0	(4)	712	(370)	342
SCX	922	(790)	132	676	(340)	336
SOG	86	0	86	k. A.	k. A.	k. A.
SSB	630	(630)	0	k. A.	k. A.	k. A.
TOR	151	0	151	k. A.	k. A.	k. A.
UAG	251	(420)	(169)	(607)	809	202

- (1) Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2022:

	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	54,96	60,12
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	32,75	30,48
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,83	0,71
Investmentfonds	7,21	5,23
Pensionsgeschäfte	0,34	0,24
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,34	0,07
Zentral abgerechnete Finanzderivate	2,31	(0,39)
Freiverkehrsinanzderivate	(1,04)	1,91
Einlagenzertifikate	0,07	k. A.

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2022 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
Argentinien	0,49	0,51
Australien	k. A.	0,60
Österreich	k. A.	0,33
Bahamas	0,37	0,47
Weißrussland	0,08	0,14
Bermuda	k. A.	0,42
Brasilien	2,65	3,36
Kaimaninseln	0,70	1,63
Chile	k. A.	4,27
China	0,02	0,09
Kolumbien	k. A.	0,85
Kongo	0,27	k. A.
Costa Rica	k. A.	0,09
Dänemark	2,08	2,09
Dominikanische Republik	1,52	1,04
Ecuador	k. A.	1,14
Ägypten	k. A.	1,40
Frankreich	k. A.	0,35
Deutschland	k. A.	0,61
Ghana	0,48	0,42
Guatemala	k. A.	0,15
Hongkong	k. A.	0,53
Indien	k. A.	0,91
Irland	3,14	3,38
Israel	2,82	1,30

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
Italien	k. A.	0,55
Elfenbeinküste	0,45	0,93
Japan	k. A.	0,19
Jersey, Kanalinseln	1,29	k. A.
Jordanien	k. A.	0,87
Kasachstan	k. A.	0,38
Luxemburg	1,19	3,20
Mauritius	k. A.	0,18
Mexiko	4,32	4,17
Marokko	k. A.	0,28
Niederlande	2,16	1,53
Nigeria	k. A.	0,71
Norwegen	k. A.	0,19
Oman	k. A.	0,55
Pakistan	k. A.	0,21
Paraguay	k. A.	0,16
Peru	3,18	3,76
Polen	1,16	k. A.
Rumänien	k. A.	1,92
Russland	0,05	k. A.
Saudi-Arabien	k. A.	0,67
Serbien	0,05	0,69
Singapur	k. A.	4,24
Südafrika	5,04	5,31
Sri Lanka	k. A.	0,19
Schweden	k. A.	0,21
Schweiz	k. A.	0,37
Thailand	k. A.	1,00
Tunesien	0,09	k. A.
Türkei	0,91	1,30
Ukraine	k. A.	1,20
Vereinigte Arabische Emirate	0,26	1,65
Großbritannien	1,36	2,26
USA	20,18	13,26
Usbekistan	0,62	k. A.
Jungferinseln (Britisch)	1,24	0,90
Sambia	k. A.	0,67
Kurzfristige Instrumente	30,37	11,53
Investmentfonds	7,21	5,23
Pensionsgeschäfte	0,34	0,24
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,34	0,07
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf	k. A.	0,01
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,08	0,00
Zinsswaps	2,23	(0,40)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Devisenoptionen	0,29	0,09
Verkaufsoptionen		
Devisenoptionen	k. A.	(0,04)
Zinsswapoptionen	(0,01)	k. A.
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzkauf	0,00	0,01
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf	(0,42)	(0,35)
Cross-Currency Swaps	0,04	0,03
Zinsswaps	0,12	0,02
Volatilitätsswaps	0,00	0,02
Devisenterminkontrakte	(1,81)	1,39
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,75	0,74
Einlagenzertifikate	0,07	k. A.
Sonstige Aktiva und Passiva	2,23	1,63
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS			
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE				DÄNEMARK				MAURITIUS						
ARGENTINIEN				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL						
STAATSEMISSIONEN				Jyske Realkredit A/S				Greenko Solar Mauritius Ltd.						
Argentina Government International Bond				1,500 % fällig am 01.10.2053	DKK	237	\$ 26	0,12	5,950 % fällig am 29.07.2026	\$	200	\$ 183	0,87	
0,500 % fällig am 09.07.2030	\$	99	\$ 23	0,11	Nordea Kredit Realkreditaktieselskab				MEXIKO					
1,500 % fällig am 09.07.2035		105	24	0,11	1,000 % fällig am 01.10.2050				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
Summe Argentinien		47	0,22	1,500 % fällig am 01.10.2053				Urbi Desarrollos Urbanos S.A.B. de C.V.						
ASERBAIDISCHAN				Nykkredit Realkredit A/S				8,790 % fällig am 09.12.2014 ^						
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				1,000 % fällig am 01.10.2050				5,000				0	0,00	
SOCAR Turkey Enerji AS Via Steas Funding DAC		200	195	0,93	1,000 % fällig am 01.10.2053				STAATSEMISSIONEN					
7,230 % fällig am 17.03.2026				1,500 % fällig am 01.10.2053				Mexico Government International Bond						
Summe Brasilien		589	2,81	Realkredit Danmark A/S				7,500 % fällig am 03.06.2027						
BRASILIEN				1,000 % fällig am 01.10.2050				4,700				227	1,08	
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				1,000 % fällig am 01.10.2053				1,300				62	0,30	
Odebrecht Oil & Gas Finance Ltd.		23	0	0,00	1,500 % fällig am 01.10.2053				500				25	0,12
0,000 % fällig am 30.01.2023				Summe Dänemark				480				26	0,12	
(b)(e)				395				340				1,62		
Oi S.A.		50	43	0,20	DOMINIKANISCHE REPUBLIK				Summe Mexiko					
0,000 % fällig am 25.02.2035	BRL			STAATSEMISSIONEN				340				1,62		
Swiss Insured Brazil Power Finance SARL		2,638	441	2,11	Dominican Republic Central Bank Notes				NIEDERLANDE					
9,850 % fällig am 16.07.2032				12,000 % fällig am 03.10.2025				DOP				3,800	65	0,31
Vale S.A.		1,490	105	0,50	UNGARN				STAATSEMISSIONEN					
0,000 % (e)				Hungarian Development Bank				0,375 % fällig am 09.06.2026						
Summe Brasilien		589	2,81	Hungary Government International Bond				5,000 % fällig am 22.02.2027						
KAIMANINSELN				Summe Ungarn				194				0,93		
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				INDONESIEN				STAATSEMISSIONEN						
Interoceanica Finance Ltd.		18	15	0,07	Indonesia Government International Bond				6,375 % fällig am 15.08.2028					
0,000 % fällig am 30.11.2025 (b)	\$			IDR				15,000				1	0,00	
Odebrecht Drilling Norbe Ltd. (6,350 % bar und 1,000 % PIK)		52	29	0,14	IRLAND				FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE					
7,350 % fällig am 01.12.2026 ^a)				Black Diamond CLO DAC				2,316 % fällig am 20.01.2032						
Summe Kaimaninseln		44	0,21	Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd.				2,548 % fällig am 15.11.2031						
CHILE				Summe Irland				318				1,52		
STAATSEMISSIONEN				ISRAEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL						
Bonos de la Tesorería de la Republica en Pesos		7	0,03	Leviathan Bond Ltd.				6,125 % fällig am 30.06.2025						
6,000 % fällig am 01.01.2043	CLP	5,000		\$				100				98	0,47	
CHINA				ISRAEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL						
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				STAATSEMISSIONEN				ISRAEL						
Flourish Century		200	22	0,11	Israel Government International Bond				0,150 % fällig am 31.07.2023					
6,600 % fällig am 04.02.2049 ^h)	\$			1,500 % fällig am 30.11.2023				500				139	0,66	
KOLUMBIEN				Summe Israel				300				85	0,41	
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Alfa Bank AO Via Alfa Bond Issuance PLC				4,250 % fällig am 31.03.2023						
Empresas Publicas de Medellin ESP		540,000	100	0,48	RUB				33,000				13	0,06
7,625 % fällig am 10.09.2024	COP	489,000	76	0,36	Summe Irland				318				1,52	
8,375 % fällig am 08.11.2027				ISRAEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL						
Summe Kolumbien		176	0,84	Leviathan Bond Ltd.				6,125 % fällig am 30.06.2025						
STAATSEMISSIONEN				Summe Israel				318				1,52		
Colombian TES		197,100	23	0,11	ISRAEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
6,250 % fällig am 09.07.2036				Leviathan Bond Ltd.				6,125 % fällig am 30.06.2025						
9,250 % fällig am 28.05.2042		730,000	109	0,52	\$				100				98	0,47
Financiera de Desarrollo Territorial S.A. Findeter		12,000	2	0,01	STAATSEMISSIONEN				ISRAEL					
7,875 % fällig am 12.08.2024				Israel Government International Bond				0,150 % fällig am 31.07.2023						
Republic of Colombia		252,300	45	0,22	1,500 % fällig am 30.11.2023				500				139	0,66
1,000 % fällig am 26.11.2025		238,100	42	0,20	4,250 % fällig am 31.03.2023				300				85	0,41
1,000 % fällig am 26.08.2026		102,000	16	0,08	Summe Israel				335				1,60	
1,000 % fällig am 03.11.2027		25,000	3	0,01	Summe Israel				433				2,07	
1,000 % fällig am 09.07.2036				Summe Kolumbien				416				1,99		
Summe Kolumbien		416	1,99	JERSEY, KANALINSELN				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL						
TSCHECHISCHE REPUBLIK				Corsair International Ltd.				5,473 % fällig am 28.01.2027						
STAATSEMISSIONEN				€				100				106	0,51	
Czech Republic Government International Bond		4,600	177	0,85	LUXEMBURG				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
2,500 % fällig am 25.08.2028	CZK			Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.				5,250 % fällig am 23.05.2023 ^g)						
Summe Tschechien		4,600	177	0,85	\$				200				27	0,13

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS				
USA				USA				HUNGARY TREASURY BILLS							
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				Bear Stearns Structured Products, Inc. Trust				18,250 % fällig am							
Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust				5,219 % fällig am 26.12.2046 ^	\$ 14	\$ 10	0,05	03.01.2023 (b)(c)	HUF	242.000	\$ 645	3,08			
5,094 % fällig am 25.01.2035	\$ 34	\$ 33	0,16	Citigroup Mortgage Loan Trust				ISRAEL TREASURY BILLS							
Citigroup Mortgage Loan Trust				3,871 % fällig am 25.09.2037 ^	84	72	0,34	0,455 % fällig am							
4,449 % fällig am 25.07.2045	7	5	0,02	4,459 % fällig am 25.01.2037	2	2	0,01	08.02.2023 (b)(c)			ILS	2.100	593	2,83	
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust				First Horizon Mortgage Pass-Through Trust				0,860 % fällig am				1.600	448	2,14	
4,869 % fällig am 25.02.2037	50	48	0,23	3,875 % fällig am 25.08.2035	3	2	0,01	03.05.2023 (b)(c)					1.041	4,97	
5,514 % fällig am 25.11.2035	60	58	0,28	GreenPoint Mortgage Funding Trust Pass-Through Certificates				JAPAN TREASURY BILLS							
Credit-Based Asset Servicing & Securitization Trust				3,726 % fällig am 25.10.2033	1	1	0,01	(0,251) % fällig am							
4,509 % fällig am 25.11.2036	2	1	0,01	IndyMac Mortgage Loan Trust				11.01.2023 (b)(c)			¥	58.900	446	2,13	
Fieldstone Mortgage Investment Trust				3,141 % fällig am 25.11.2037	72	59	0,28	(0,235) % fällig am							
4,769 % fällig am 25.05.2036	78	54	0,26	3,837 % fällig am 25.12.2034	3	3	0,01	11.01.2023 (b)(c)							
GSAMP Trust				5,029 % fällig am 25.07.2045	28	24	0,11	(0,201) % fällig am							
4,479 % fällig am 25.01.2037	48	29	0,14	Lehman XS Trust				16.01.2023 (b)(c)							
Home Equity Asset Trust				4,769 % fällig am 25.09.2046	115	96	0,46	(0,190) % fällig am							
4,989 % fällig am 25.11.2032	4	3	0,01	Residential Accredit Loans, Inc. Trust				16.01.2023 (b)(c)							
HSI Asset Loan Obligation Trust				2,644 % fällig am 25.10.2037	47	41	0,20	16.01.2023 (b)(c)							
4,136 % fällig am 25.12.2036	2	1	0,01	Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust				(0,190) % fällig am							
Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust				6,000 % fällig am 25.10.2036	3	3	0,01	16.01.2023 (b)(c)							
4,449 % fällig am 25.05.2037	3	2	0,01	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust				Summe USA							
5,154 % fällig am 25.01.2035	23	21	0,10	3,266 % fällig am 25.02.2037 ^	7	6	0,03								
5,184 % fällig am 25.03.2034	49	47	0,22	SAMBIA				STAATSEMISSIONEN							
Morgan Stanley Dean Witter Capital, Inc. Trust				Zambia Government International Bond				12,000 % fällig am 22.03.2028			ZMW	400	14	0,07	
5,739 % fällig am 25.02.2033	16	16	0,08	15,000 % fällig am 16.02.2027	300	12	0,06	15,000 % fällig am 16.02.2027							
New Century Home Equity Loan Trust				Summe Sambia				Summe kurzfristige Instrumente							
4,749 % fällig am 25.05.2036	8	8	0,04					Summe Übertragbare Wertpapiere							
Saxon Asset Securities Trust				KURZFRISTIGE INSTRUMENTE				AKTIEN							
4,699 % fällig am 25.09.2037	12	11	0,05	COMMERCIAL PAPER				INVESTMENTFONDS							
Soundview Home Loan Trust				Crown Castle International Corp.				ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN							
4,469 % fällig am 25.06.2037	4	3	0,01	5,000 % fällig am 04.01.2023	\$ 250	250	1,19	PIMCO Select Funds plc – PIMCO							
4,559 % fällig am 25.07.2037	61	51	0,24	Dominion Resources, Inc.				US Dollar Short-Term Floating							
Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust				4,700 % fällig am 20.01.2023	250	249	1,19	NAV Fund (f)							
4,609 % fällig am 25.10.2037	141	95	0,45	Electricite de France S.A.				PIMCO Specialty Funds Ireland p.l.c.							
WaMu Asset-Backed Certificates WaMu Trust				5,000 % fällig am 20.01.2023	250	249	1,19	- PIMCO China Bond Fund (f)							
4,629 % fällig am 25.05.2037	51	42	0,20	Energy Transfer Partners LP				Summe Investmentfonds							
Washington Mutual Asset-Backed Certificates Trust				5,080 % fällig am 05.01.2023	250	250	1,19	BÖRSENGEHANDELTE FONDS							
3,816 % fällig am 25.10.2036	4	1	0,01	Entergy Corp.				PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar							
				4,700 % fällig am 12.01.2023	250	250	1,19	Short Maturity UCITS ETF (f)							
				Fiserv, Inc.				Summe kurzfristige Instrumente							
				4,780 % fällig am 23.01.2023	250	249	1,19	Summe Übertragbare Wertpapiere							
				Hitachi America Capital Ltd.				INVESTMENTFONDS							
				4,700 % fällig am 04.01.2023	250	250	1,19	ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN							
				Walgreens Boots Alliance, Inc.				PIMCO Select Funds plc – PIMCO							
				4,950 % fällig am 18.01.2023	250	249	1,19	US Dollar Short-Term Floating							
				Summe USA				NAV Fund (f)							
								PIMCO Specialty Funds Ireland p.l.c.							
								- PIMCO China Bond Fund (f)							
								Summe Investmentfonds							
								BÖRSENGEHANDELTE FONDS							
								PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar							
								Short Maturity UCITS ETF (f)							
								Summe kurzfristige Instrumente							
								Summe Übertragbare Wertpapiere							
								INVESTMENTFONDS							
								ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN							
								PIMCO Select Funds plc – PIMCO							
								US Dollar Short-Term Floating							
								NAV Fund (f)							
								PIMCO Specialty Funds Ireland p.l.c.							
								- PIMCO China Bond Fund (f)							
								Summe Investmentfonds							
								BÖRSENGEHANDELTE FONDS							
								PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar							
								Short Maturity UCITS ETF (f)							
								Summe kurzfristige Instrumente							
								Summe Übertragbare Wertpapiere							

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft ⁽¹⁾	% des Nettovermögens
SAL	4,320 %	30.12.2022	03.01.2023	\$ 2.500	U.S. Treasury Notes 0,125 % fällig am 15.10.2023	\$ (2.549)	\$ 2.500	\$ 2.501	11,95
SSB	1,900	30.12.2022	03.01.2023	266	U.S. Treasury Notes 1,875 % fällig am 30.06.2026	(271)	266	266	1,27
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (2.820)	\$ 2.766	\$ 2.767	13,22

⁽¹⁾ Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
3-Month SOFR June Futures	Short	09.2023	4	\$ 18	0,09
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ 18	0,09

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Boeing Co.	1,000 %	20.06.2023	\$ 100	\$ 0	0,00

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt/ variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750 %	15.06.2032	\$ 500	\$ 15	0,07
Zahlung	1-Year BRL-CDI	4,100	02.01.2023	BRL 4.500	(64)	(0,31)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	5,100	02.01.2024	400	9	0,04
Erhalt	1-Year BRL-CDI	5,150	02.01.2023	8.000	113	0,54
Zahlung	1-Year BRL-CDI	5,250	02.01.2023	3.500	(25)	(0,12)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	5,660	02.01.2025	3.300	(97)	(0,46)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	5,863	02.01.2023	5.000	(51)	(0,24)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	6,020	04.01.2027	1.500	55	0,28
Erhalt	1-Year BRL-CDI	6,050	02.01.2025	4.700	94	0,45
Zahlung	1-Year BRL-CDI	6,140	04.01.2027	7.300	(218)	(1,04)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	6,250	04.01.2027	700	23	0,11
Erhalt	1-Year BRL-CDI	6,520	04.01.2027	10.200	313	1,50
Erhalt	1-Year BRL-CDI	6,950	04.01.2027	800	27	0,13
Zahlung	1-Year BRL-CDI	6,960	04.01.2027	6.500	(159)	(0,75)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	7,195	02.01.2023	3.600	29	0,14
Erhalt	1-Year BRL-CDI	7,260	02.01.2023	1.400	11	0,05
Zahlung	1-Year BRL-CDI	7,310	02.01.2024	1.000	(17)	(0,08)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	7,775	02.01.2024	1.700	(25)	(0,12)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	7,800	04.01.2027	900	(15)	(0,07)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	8,325	04.01.2027	300	7	0,03
Zahlung	1-Year BRL-CDI	8,355	04.01.2027	400	(9)	(0,04)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	8,450	04.01.2027	300	(7)	(0,03)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	8,675	04.01.2027	1.700	12	0,06
Erhalt	1-Year BRL-CDI	9,600	04.01.2027	2.700	(13)	(0,06)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,206	04.01.2027	100	(1)	(0,01)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	10,240	04.01.2027	500	4	0,02
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,665	02.01.2024	100	(1)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,755	02.01.2024	300	(2)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,833	02.01.2024	500	(3)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,995	02.01.2024	100	(1)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,995	04.01.2027	300	(3)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,020	04.01.2027	200	(2)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,045	04.01.2027	300	(2)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,048	04.01.2027	400	(3)	(0,02)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,050	04.01.2027	300	(2)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,055	04.01.2027	300	(2)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,065	02.01.2024	300	(2)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,065	04.01.2027	300	(2)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,130	04.01.2027	200	(2)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,140	04.01.2027	300	(2)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,148	02.01.2024	100	(1)	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,445	02.01.2025	600	2	0,01
Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,505	02.01.2024	500	2	0,01
Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,515	02.01.2025	900	3	0,02
Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,530	02.01.2024	1.900	8	0,04
Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,535	02.01.2024	600	3	0,01
Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,540	02.01.2024	500	2	0,01
Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,543	02.01.2024	500	2	0,01
Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,708	02.01.2025	100	0	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,734	02.01.2025	400	(1)	(0,01)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,740	02.01.2025	200	1	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,750	02.01.2025	200	1	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,800	02.01.2025	400	(1)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,835	02.01.2025	400	(1)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,845	02.01.2025	1.100	(3)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,870	02.01.2025	900	(2)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,005	02.01.2025	900	(2)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,105	02.01.2025	1.000	(2)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,290	02.01.2024	600	0	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,425	02.01.2025	1.500	(2)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,740	02.01.2025	600	0	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	12,740	02.01.2025	1.500	0	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	12,765	02.01.2025	700	0	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	12,850	02.01.2025	1.900	(1)	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	13,190	02.01.2025	300	0	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	13,215	02.01.2025	200	0	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	13,400	02.01.2025	600	(1)	(0,01)
Erhalt	3-Month CNY-CNREPOFIX	1,860	07.05.2025	1.700	(1)	(0,01)
Erhalt	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,500	21.09.2027	2.040	6	0,03

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund (Forts.)

Zahlung/ Erhalt	variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens	
Erhalt	3-Month COP-IBR	Compounded-OIS	2,630 %	24.07.2024	COP	1.748.000	\$ 51	0,24
Erhalt	3-Month COP-IBR	Compounded-OIS	2,650	24.07.2024		2.178.000	63	0,30
Zahlung	3-Month COP-IBR	Compounded-OIS	2,740	24.07.2024		2.486.300	(70)	(0,33)
Zahlung	3-Month COP-IBR	Compounded-OIS	2,750	24.07.2024		2.024.100	(30)	(0,14)
Erhalt	3-Month COP-IBR	Compounded-OIS	2,995	24.11.2025		113.800	5	0,02
Zahlung	3-Month COP-IBR	Compounded-OIS	3,080	13.01.2026		922.300	(40)	(0,19)
Erhalt	3-Month COP-IBR	Compounded-OIS	3,125	15.01.2026		386.000	16	0,08
Erhalt	3-Month COP-IBR	Compounded-OIS	3,680	03.11.2027		449.500	13	0,06
Erhalt	3-Month COP-IBR	Compounded-OIS	3,975	23.06.2027		216.900	10	0,05
Erhalt	3-Month COP-IBR	Compounded-OIS	4,040	13.01.2031		1.002.000	65	0,31
Erhalt	3-Month COP-IBR	Compounded-OIS	4,155	15.01.2031		1.175.400	35	0,17
Zahlung	3-Month COP-IBR	Compounded-OIS	4,200	18.09.2030		2.296.200	(81)	(0,39)
Erhalt	3-Month COP-IBR	Compounded-OIS	4,410	03.11.2027		2.822.000	131	0,62
Zahlung	3-Month COP-IBR	Compounded-OIS	4,495	10.10.2024		244.300	(6)	(0,03)
Erhalt	3-Month COP-IBR	Compounded-OIS	4,655	11.05.2026		1.344.458	48	0,23
Erhalt	3-Month COP-IBR	Compounded-OIS	5,175	28.05.2027		1.045.600	36	0,17
Erhalt	3-Month COP-IBR	Compounded-OIS	6,630	11.01.2027		1.088.400	28	0,14
Erhalt	3-Month COP-IBR	Compounded-OIS	6,885	31.01.2025		224.000	4	0,02
Erhalt	3-Month COP-IBR	Compounded-OIS	7,080	02.02.2027		79.000	2	0,01
Erhalt	3-Month COP-IBR	Compounded-OIS	7,130	31.01.2027		81.000	2	0,01
Erhalt	3-Month COP-IBR	Compounded-OIS	7,140	01.02.2027		149.300	3	0,02
Erhalt	3-Month COP-IBR	Compounded-OIS	7,500	15.02.2025		148.000	2	0,01
Zahlung	3-Month COP-IBR	Compounded-OIS	7,585	14.02.2027		236.000	(4)	(0,02)
Erhalt	3-Month COP-IBR	Compounded-OIS	7,855	22.02.2025		286.700	4	0,02
Erhalt	3-Month COP-IBR	Compounded-OIS	7,890	08.04.2027		173.000	3	0,01
Erhalt	3-Month COP-IBR	Compounded-OIS	7,913	08.04.2027		266.200	5	0,02
Erhalt	3-Month COP-IBR	Compounded-OIS	7,940	08.04.2027		134.000	2	0,01
Erhalt	3-Month COP-IBR	Compounded-OIS	8,020	08.04.2025		440.000	6	0,03
Zahlung	3-Month COP-IBR	Compounded-OIS	8,200	11.03.2027		366.000	(5)	(0,03)
Zahlung	3-Month COP-IBR	Compounded-OIS	8,240	15.03.2027		101.600	(1)	(0,01)
Zahlung	3-Month COP-IBR	Compounded-OIS	8,320	31.03.2027		203.000	(3)	(0,01)
Zahlung	3-Month COP-IBR	Compounded-OIS	8,360	02.06.2027		358.000	(5)	(0,02)
Zahlung	3-Month COP-IBR	Compounded-OIS	8,560	30.03.2027		58.200	(1)	0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR	Compounded-OIS	8,686	30.03.2027		346.500	(4)	(0,02)
Zahlung	3-Month COP-IBR	Compounded-OIS	8,890	12.05.2029		269.000	(3)	(0,01)
Zahlung	3-Month COP-IBR	Compounded-OIS	9,050	03.11.2027		3.357.000	(29)	(0,14)
Erhalt	3-Month COP-IBR	Compounded-OIS	9,055	26.08.2026		200.000	2	0,01
Erhalt	3-Month COP-IBR	Compounded-OIS	9,177	26.11.2025		218.700	2	0,01
Erhalt	3-Month COP-IBR	Compounded-OIS	9,270	26.11.2025		243.000	2	0,01
Erhalt	3-Month COP-IBR	Compounded-OIS	9,280	26.11.2025		610.000	5	0,02
Erhalt	3-Month COP-IBR	Compounded-OIS	9,310	26.11.2025		473.000	3	0,02
Erhalt	3-Month COP-IBR	Compounded-OIS	9,430	16.06.2027		130.000	1	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR	Compounded-OIS	9,470	01.07.2025		285.000	2	0,01
Erhalt	3-Month COP-IBR	Compounded-OIS	9,840	03.11.2027		534.700	1	0,01
Zahlung	3-Month COP-IBR	Compounded-OIS	9,920	13.09.2027		752.000	(1)	(0,01)
Zahlung	3-Month COP-IBR	Compounded-OIS	9,950	04.10.2032		131.700	0	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR	Compounded-OIS	10,110	26.11.2025		852.000	2	0,01
Erhalt	3-Month COP-IBR	Compounded-OIS	10,180	03.11.2027		173.800	0	0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR	Compounded-OIS	10,420	02.12.2027		203.200	1	0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR	Compounded-OIS	10,720	18.11.2025		1.317.100	0	0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR	Compounded-OIS	10,800	02.12.2025		234.200	0	0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR	Compounded-OIS	10,820	02.12.2025		757.100	1	0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR	Compounded-OIS	10,950	19.12.2024		61.500	0	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR	Compounded-OIS	11,640	21.10.2025		817.000	(4)	(0,02)
Zahlung	3-Month COP-IBR	Compounded-OIS	11,930	10.11.2025		435.400	3	0,01
Erhalt	3-Month COP-IBR	Compounded-OIS	12,000	26.11.2025		31.000	0	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR	Compounded-OIS	12,050	26.11.2025		1.370.000	(10)	(0,05)
Zahlung	3-Month COP-IBR	Compounded-OIS	12,060	09.11.2025		308.000	2	0,01
Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR		1,750	15.12.2026	KRW	1.102.560	(63)	(0,30)
Erhalt	3-Month KRW-KORIBOR		1,750	15.12.2031		643.770	67	0,32
Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR		3,250	21.09.2027		242.040	1	0,00
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR		5,375	20.10.2026	ZAR	5.900	31	0,15
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR		5,601	09.06.2026		900	(4)	(0,02)
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR		5,680	08.06.2026		2.400	(10)	(0,05)
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR		6,067	21.12.2026		3.100	11	0,05
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR		6,410	11.02.2023		1.500	0	0,00
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR		6,635	04.02.2027		5.500	1	0,00
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR		7,205	22.04.2027		1.200	2	0,01
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR		7,210	22.04.2027		900	2	0,01
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR		8,180	05.07.2027		2.400	(1)	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR		8,500	17.10.2027		10.600	9	0,04
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR		1,290	05.11.2025	CLP	123.100	22	0,11
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR		1,582	02.02.2026		40.000	(8)	(0,04)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR		1,640	12.01.2026		293.300	63	0,30
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR		1,935	10.03.2025		288.700	46	0,22
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR		1,950	05.05.2026		318.600	(55)	(0,26)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR		2,020	30.04.2026		335.000	(58)	(0,28)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR		2,080	01.06.2030		62.000	(15)	(0,07)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR		2,110	01.06.2030		20.000	(5)	(0,02)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR		2,270	15.03.2026		682.000	(120)	(0,57)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR		2,545	05.02.2026		88.000	(14)	(0,07)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR		2,565	27.11.2030		35.000	(8)	(0,04)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR		2,585	27.11.2030		35.000	(8)	(0,04)

Zahlung/ Erhalt	variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR		2,640 %	01.03.2026	CLP 326.000	\$ 54	0,26
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR		2,680	12.01.2031	325.000	(63)	(0,40)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR		3,000	14.06.2026	436.000	55	0,26
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR		3,120	05.02.2030	29.000	(5)	(0,03)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR		3,215	14.01.2030	143.000	28	0,14
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR		3,245	15.03.2031	142.400	27	0,13
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR		3,520	14.06.2028	13.800	1	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR		3,900	14.06.2031	224.000	27	0,13
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR		4,695	01.03.2025	200.000	18	0,08
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR		4,870	15.11.2026	53.000	(2)	(0,01)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR		5,045	14.12.2026	23.300	0	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR		5,100	15.11.2031	10.000	0	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR		5,120	15.11.2031	10.000	0	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR		5,130	01.03.2025	80.000	6	0,03
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR		5,180	01.10.2028	35.000	1	0,01
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR		5,240	01.09.2030	60.000	1	0,01
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR		5,260	01.03.2026	60.000	3	0,01
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR		5,370	01.10.2028	17.900	0	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR		5,400	01.10.2028	35.000	1	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR		5,420	01.10.2028	76.000	2	0,01
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR		5,470	01.09.2030	50.000	0	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR		5,570	01.10.2028	70.000	0	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR		5,600	12.12.2027	19.000	0	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR		5,610	08.02.2027	62.000	(2)	(0,01)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR		5,635	12.12.2027	40.000	0	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR		5,725	07.02.2025	114.000	7	0,03
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR		5,770	21.11.2027	80.700	0	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR		5,890	17.03.2032	12.100	(1)	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR		5,910	21.01.2027	30.800	0	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR		5,915	01.02.2025	92.800	5	0,02
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR		5,930	17.03.2032	12.100	(1)	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR		5,940	01.03.2025	50.000	(2)	(0,01)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR		5,975	11.02.2027	58.000	(1)	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR		6,000	11.02.2027	114.000	(2)	(0,01)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR		6,010	16.02.2029	30.000	1	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR		6,020	02.03.2029	2.900	0	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR		6,030	10.02.2027	50.000	(1)	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR		6,055	10.02.2027	28.000	0	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR		6,110	01.09.2030	23.100	1	0,01
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR		6,120	08.03.2027	18.700	0	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR		6,130	16.02.2027	40.000	(1)	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR		6,195	04.03.2027	58.600	0	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR		6,195	04.04.2028	33.000	1	0,01
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR		6,250	01.10.2028	4.600	0	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR		6,255	08.04.2032	22.000	(2)	(0,01)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR		6,260	08.04.2032	21.000	(2)	(0,01)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR		6,270	02.03.2027	6.100	0	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR		6,299	08.04.2032	24.000	(2)	(0,01)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR		6,300	11.03.2027	48.000	0	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR		6,333	05.04.2027	26.000	1	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR		6,350	15.03.2027	21.000	(1)	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR		6,350	04.04.2027	27.000	1	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR		6,360	25.05.2027	46.500	1	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR		6,370	29.06.2029	39.000	2	0,01
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR		6,380	03.06.2027	116.000	2	0,01
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR		6,386	24.05.2027	103.000	2	0,01
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR		6,420	24.03.2029	16.000	1	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR		6,500	12.12.2025	29.000	0	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR		6,550	15.06.2032	16.000	2	0,01
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR		6,567	12.12.2025	12.000	0	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR		6,590	16.06.2032	49.000	5	0,03
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR		6,610	17.06.2032	40.300	5	0,03
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR		6,625	04.04.2025	86.000	2	0,01
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR		6,628	04.04.2025	126.000	3	0,02
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR		6,670	05.04.2025	83.000	2	0,01
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR		6,800	05.07.2027	46.000	1	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR		6,850	01.03.2026	80.000	0	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR		7,040	10.05.2027	25.600	(2)	(0,01)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR		7,110	15.06.2027	28.000	(2)	(0,01)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR		7,160	16.06.2027	199.000	(11)	(0,05)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR		7,160	22.06.2027	22.500	1	0,01
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR		7,160	01.10.2028	11.600	1	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR		7,195	01.10.2028	6.500	1	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR		7,214	21.09.2025	49.000	0	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR		7,220	20.07.2027	186.100	8	0,04
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR		7,270	15.09.2027	39.700	(2)	(0,01)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR		7,280	21.03.2025	217.000	(2)	(0,01)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR		7,540	13.06.2025	13.200	0	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR		7,550	13.06.2025	13.300	0	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR		7,610	29.08.2027	31.000	2	0,01
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR		7,690	10.05.2025	76.800	1	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR		7,815	04.10.2027	63.700	(6)	(0,03)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR		8,230	04.08.2025	312.400	(7)	(0,03)

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund (Forts.)

Zahlung/ Erhalt	variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
Erhalt	6-Month	CLP-CHILIBOR	8,500 %	15.07.2025	CLP	54.100	(1)	(0,01)
Erhalt	6-Month	CLP-CHILIBOR	8,890	19.07.2025		325.800	(11)	(0,05)
Zahlung	6-Month	CLP-CHILIBOR	8,740	29.08.2025		74.000	3	0,01
Zahlung	6-Month	CLP-CHILIBOR	9,135	01.03.2025		68.000	2	0,01
Zahlung	6-Month	CLP-CHILIBOR	9,270	01.03.2025		51.000	2	0,01
Zahlung	6-Month	CLP-CHILIBOR	9,300	01.03.2025		94.800	4	0,02
Erhalt	6-Month	CLP-CHILIBOR	9,350	01.03.2025		39.800	(2)	(0,01)
Erhalt	6-Month	CLP-CHILIBOR	9,370	01.03.2025		40.400	(2)	(0,01)
Erhalt	6-Month	CLP-CHILIBOR	9,820	15.09.2024		57.900	(2)	(0,01)
Zahlung	6-Month	CZK-PRIBOR	1,575	26.03.2026	CZK	700	(4)	(0,02)
Zahlung	6-Month	CZK-PRIBOR	1,872	05.08.2026		1.200	(4)	(0,02)
Erhalt	6-Month	CZK-PRIBOR	3,490	18.01.2032		4.100	18	0,08
Zahlung	6-Month	CZK-PRIBOR	3,530	27.12.2026		1.100	(3)	(0,01)
Zahlung	6-Month	CZK-PRIBOR	3,930	18.01.2027		7.700	(17)	(0,08)
Erhalt	6-Month	CZK-PRIBOR	4,164	14.03.2027		6.400	9	0,04
Erhalt	6-Month	CZK-PRIBOR	4,220	14.03.2027		6.300	8	0,04
Erhalt	6-Month	CZK-PRIBOR	4,310	15.03.2027		1.200	1	0,01
Erhalt	6-Month	CZK-PRIBOR	4,320	15.03.2027		400	0	0,00
Erhalt	6-Month	CZK-PRIBOR	4,490	25.03.2027		2.000	1	0,01
Erhalt	6-Month	CZK-PRIBOR	4,560	25.03.2027		2.000	1	0,01
Erhalt	6-Month	CZK-PRIBOR	4,700	29.03.2027		1.200	0	0,00
Zahlung	6-Month	CZK-PRIBOR	5,138	14.11.2027		1.200	0	0,00
Zahlung	6-Month	CZK-PRIBOR	5,180	14.11.2027		1.100	0	0,00
Zahlung	6-Month	CZK-PRIBOR	5,220	07.07.2027		2.500	(2)	(0,01)
Zahlung	6-Month	CZK-PRIBOR	5,340	07.07.2027		2.500	(1)	0,00
Zahlung	6-Month	CZK-PRIBOR	5,606	28.06.2027		1.300	2	0,01
Erhalt ⁽⁹⁾	6-Month	EUR-EURIBOR	1,750	15.03.2033	€	500	14	0,07
Erhalt	6-Month	HUF-BBR	13,600	12.12.2024	HUF	5.100	0	0,00
Erhalt	6-Month	PLN-WIBOR	0,980	09.06.2030	PLN	300	20	0,10
Erhalt	6-Month	PLN-WIBOR	2,950	13.12.2026		1.500	39	0,19
Erhalt	6-Month	PLN-WIBOR	4,075	07.03.2027		800	12	0,06
Zahlung	6-Month	PLN-WIBOR	4,135	08.02.2027		500	(7)	(0,04)
Erhalt	6-Month	PLN-WIBOR	4,320	09.03.2027		150	2	0,01
Erhalt	6-Month	PLN-WIBOR	4,350	09.03.2027		150	2	0,01
Erhalt	6-Month	PLN-WIBOR	4,885	22.03.2027		200	1	0,01
Erhalt	6-Month	PLN-WIBOR	5,175	24.03.2027		600	2	0,01
Erhalt	6-Month	PLN-WIBOR	5,285	25.03.2027		300	1	0,00
Erhalt	6-Month	PLN-WIBOR	5,290	25.03.2027		300	1	0,00
Erhalt	6-Month	PLN-WIBOR	5,340	28.03.2027		100	0	0,00
Erhalt	6-Month	PLN-WIBOR	5,470	08.04.2027		600	1	0,00
Erhalt	6-Month	PLN-WIBOR	5,550	08.04.2027		400	0	0,00
Erhalt	6-Month	PLN-WIBOR	5,575	08.04.2027		400	0	0,00
Zahlung	6-Month	PLN-WIBOR	5,870	22.04.2027		300	3	0,01
Zahlung	6-Month	PLN-WIBOR	5,980	13.04.2027		500	2	0,01
Zahlung	6-Month	PLN-WIBOR	5,985	13.04.2027		500	2	0,01
Zahlung	6-Month	PLN-WIBOR	6,010	13.04.2027		400	2	0,01
Erhalt	6-Month	PLN-WIBOR	6,725	27.06.2027		700	(9)	(0,04)
Zahlung	6-Month	PLN-WIBOR	6,745	05.07.2027		600	2	0,01
Zahlung	6-Month	PLN-WIBOR	6,755	10.05.2027		600	7	0,03
Erhalt	6-Month	PLN-WIBOR	6,830	19.08.2024		3.000	4	0,02
Zahlung	6-Month	PLN-WIBOR	6,843	28.06.2027		300	4	0,02
Zahlung	6-Month	PLN-WIBOR	6,940	09.06.2027		800	11	0,05
Zahlung	6-Month	PLN-WIBOR	7,310	30.06.2027		500	7	0,03
Erhalt	6-Month	PLN-WIBOR	7,310	30.06.2027		300	(5)	(0,03)
Zahlung	6-Month	PLN-WIBOR	7,725	23.06.2027		600	13	0,06
Erhalt	28-Day	MXN-TIE	4,145	13.02.2023	MXN	49.000	27	0,13
Zahlung	28-Day	MXN-TIE	4,290	16.02.2023		10.900	(6)	(0,03)
Zahlung	28-Day	MXN-TIE	4,300	16.02.2023		16.700	(9)	(0,04)
Zahlung	28-Day	MXN-TIE	4,340	12.02.2024		34.000	(125)	(0,59)
Erhalt	28-Day	MXN-TIE	4,540	21.02.2024		3.300	12	0,06
Zahlung	28-Day	MXN-TIE	4,680	16.03.2023		19.000	(14)	(0,07)
Zahlung	28-Day	MXN-TIE	4,730	06.02.2026		3.600	(22)	(0,11)
Erhalt	28-Day	MXN-TIE	4,830	22.07.2025		1.400	8	0,04
Erhalt	28-Day	MXN-TIE	4,840	19.02.2025		2.700	13	0,06
Erhalt	28-Day	MXN-TIE	4,850	19.02.2025		3.700	18	0,09
Zahlung	28-Day	MXN-TIE	4,880	07.11.2025		11.900	(69)	(0,33)
Erhalt	28-Day	MXN-TIE	4,900	22.03.2023		8.300	6	0,03
Erhalt	28-Day	MXN-TIE	4,920	10.04.2023		5.800	6	0,03
Erhalt	28-Day	MXN-TIE	4,943	12.02.2026		2.300	14	0,06
Erhalt	28-Day	MXN-TIE	4,950	12.02.2026		3.500	21	0,10
Erhalt	28-Day	MXN-TIE	5,120	29.09.2025		8.200	17	0,08
Erhalt	28-Day	MXN-TIE	5,282	29.03.2023		19.600	17	0,08
Erhalt	28-Day	MXN-TIE	5,325	09.06.2023		14.300	19	0,09
Erhalt	28-Day	MXN-TIE	5,520	21.03.2024		21.000	65	0,31
Zahlung	28-Day	MXN-TIE	5,605	26.03.2024		500	(2)	(0,01)
Zahlung	28-Day	MXN-TIE	5,650	22.03.2024		11.000	(33)	(0,16)
Zahlung	28-Day	MXN-TIE	5,800	06.04.2026		5.000	(24)	(0,12)
Erhalt	28-Day	MXN-TIE	5,893	05.06.2025		9.200	38	0,18
Erhalt	28-Day	MXN-TIE	6,360	22.03.2023		12.300	21	0,10
Zahlung	28-Day	MXN-TIE	6,380	19.08.2026		6.700	(28)	(0,13)
Erhalt	28-Day	MXN-TIE	6,398	16.07.2026		4.100	17	0,08
Erhalt	28-Day	MXN-TIE	6,415	16.07.2026		1.600	7	0,03
Erhalt	28-Day	MXN-TIE	6,463	18.05.2040		800	9	0,04

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	6,670 %	19.06.2026	MXN 400	\$ 1	0,01
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	6,720	19.06.2026	300	1	0,01
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	6,845	02.07.2026	900	3	0,01
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	7,070	27.08.2031	2.100	11	0,05
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	7,100	13.06.2031	3.900	23	0,11
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,110	28.11.2023	8.900	(16)	(0,07)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,165	02.10.2026	700	(2)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,180	02.10.2026	1.600	(5)	(0,02)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	7,240	16.12.2026	2.800	8	0,04
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,250	05.10.2026	390	(1)	(0,01)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	7,250	16.12.2026	3.300	10	0,05
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,270	23.11.2023	31.500	(53)	(0,25)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,285	12.10.2026	600	(2)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,418	27.10.2031	1.400	(6)	(0,03)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,450	16.10.2026	300	(1)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	7,510	04.02.2027	2.900	7	0,03
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,525	26.09.2031	1.100	(4)	(0,02)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,533	07.01.2027	2.000	(5)	(0,02)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	7,643	18.11.2031	2.300	8	0,04
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,650	29.09.2031	290	(1)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,690	16.10.2031	1.500	(5)	(0,02)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	7,790	09.02.2024	12.800	22	0,10
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	7,800	13.11.2031	1.800	5	0,03
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,900	19.02.2032	1.200	(3)	(0,02)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,950	20.02.2032	2.000	(5)	(0,02)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,050	24.02.2032	1.800	(4)	(0,02)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,414	14.12.2027	1.800	2	0,01
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,431	24.05.2027	2.900	2	0,01
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,465	16.08.2027	400	0	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,515	17.12.2027	100	0	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,700	05.11.2027	200	0	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,740	30.08.2027	900	0	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,743	05.11.2027	900	0	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,750	05.04.2024	3.100	3	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,750	30.08.2027	1.800	0	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,760	05.11.2027	600	0	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,773	05.11.2027	900	0	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,975	03.06.2027	7.100	10	0,05
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	9,045	04.11.2027	300	0	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	9,053	04.11.2027	300	0	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	9,060	18.06.2027	1.400	0	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	9,070	04.06.2026	600	0	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	9,090	08.07.2027	1.000	0	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	9,117	04.11.2027	800	0	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	9,165	05.11.2026	400	0	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	9,335	02.08.2023	3.900	2	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	9,500	03.07.2023	24.100	(10)	(0,05)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	9,525	22.09.2027	2.000	3	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	9,580	30.06.2023	10.200	(4)	(0,02)
					\$ 417	1,99
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					\$ 417	1,99

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definieren.

(3) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

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

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

OPTIONSKAUF

DEVIENOPTIENEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
BOA	Put – OTC EUR versus CZK	CZK 23,830	01.11.2023	38	\$ 4	\$ 7	0,03
GLM	Put – OTC EUR versus HUF	HUF 385,000	01.11.2023	9	1	1	0,01
	Put – OTC EUR versus PLN	PLN 4,560	01.11.2023	38	4	6	0,03
JPM	Call – OTC AUD versus USD	\$ 0,735	04.05.2023	42	3	4	0,02
	Put – OTC EUR versus HUF	HUF 385,000	01.11.2023	19	2	3	0,01
MBC	Put – OTC USD versus MXN	MXN 18,310	04.05.2023	25	2	2	0,01
MYI	Put – OTC USD versus BRL	BRL 4,450	04.05.2023	25	2	1	0,00
	Put – OTC USD versus ZAR	ZAR 15,925	04.05.2023	25	3	4	0,02
					\$ 21	\$ 28	0,13

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund (Forts.)

VERKAUFSoPTIONEN

DEVIsoPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
MYI	Call – OTC USD versus MXN	MXN 20,500	28.02.2023	207	\$ (2)	\$ (1)	0,00

⁽¹⁾ Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag ⁽²⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BRC	QNB Finance Ltd.	1,000 %	20.06.2023	\$ 100	\$ 1	\$ (1)	\$ 0	0,00

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

⁽²⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definieren.

CROSS-CURRENCY SWAPS

Kontrahent	Erhalt	Zahlung	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag erhaltener Währung	Nenn-betrag gelieferter Währung	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
GLM	Variabler Zinssatz entspricht 6-Month USD-LIBOR zzgl. 0,333 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 6-Month ARS-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	30.05.2024	\$ 170	ARS 7.557	\$ (1)	\$ 157	\$ 156	0,74
	Variabler Zinssatz entspricht 6-Month USD-LIBOR zzgl. 0,282 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 6-Month ARS-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	07.06.2027	60	2.693	0	56	56	0,27
						\$ (1)	\$ 213	\$ 212	1,01

ZINSSWAPS

Kontrahent	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Zahlung	3-Month MYR-KLIBOR	4,250 %	21.09.2032	MYR 320	\$ (2)	\$ 4	\$ 2	0,01
GLM	Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	5,170	25.01.2023	COP 55.400	0	0	0	0,00
	Zahlung	6-Month CLP-CHLIBOR	3,265	14.06.2029	CLP 11.100	0	(2)	(2)	(0,01)
	Erhalt	6-Month THB-THBFX	1,000	15.12.2026	THB 19.100	2	24	26	0,13
	Zahlung	6-Month THB-THBFX	1,500	15.12.2031	4.800	(2)	(10)	(12)	(0,06)
MYC	Zahlung	6-Month THB-THBFX	1,500	15.12.2031	5.940	(2)	(12)	(14)	(0,07)
SCX	Erhalt	3-Month THB-THORON Compounded-OIS	2,250	21.09.2027	11.930	4	(5)	(1)	0,00
						\$ 0	\$ (1)	\$ (1)	0,00

VOLATILITÄTSSWAPS

Kontrahent	Zahlung/Erhalt Volatilität	Referenzeinheit	Volatilität Ausübungskurs	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
GLM	Zahlung	USD versus JPY 1-Year ATM Realized Volatility ⁽¹⁾	12,025 %	20.06.2023	\$ 3	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00

⁽¹⁾ Varianz-Swap

DEVIsoTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens	
BOA	01.2023	CNH	\$ 3.310	\$ 34	\$ 0	\$ 34	0,16	
	01.2023	HUF	47.217	0	(5)	(5)	(0,03)	
	01.2023	¥	105.700	0	(63)	(63)	(0,30)	
	01.2023	MYR	6.740	0	(11)	(11)	(0,05)	
	01.2023	\$	747	HUF 338.002	151	151	0,72	
	01.2023		4.872	MYR 21.606	33	33	0,16	
	01.2023		43	RON 217	4	4	0,02	
	01.2023	ZAR	1.506	\$ 85	0	(4)	(4)	(0,02)
	02.2023	\$	512	CNH 3.310	0	(32)	(32)	(0,15)
	02.2023		39	EGP 863	0	(6)	(6)	(0,03)
	03.2023		30	MXN 597	0	0	0,00	

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens			
	03.2023	ZAR	1.390	\$	79	\$	0	(3)	(3)	(0,01)
	04.2023	PLN	1.113	€	221		0	(14)	(14)	(0,06)
	05.2023	€	51	CZK	1.282		2	0	2	0,01
BPS	01.2023	HUF	49.306	\$	129		0	(3)	(3)	(0,01)
	01.2023	MYR	9.810		2.216		0	(11)	(11)	(0,05)
	01.2023	PLN	132		27		0	(3)	(3)	(0,01)
	01.2023	THB	726		21		0	0	0	0,00
	01.2023	\$	7	CLP	5.715		0	0	0	0,00
	01.2023		506	CNH	3.310		0	(27)	(27)	(0,13)
	01.2023		35	CZK	888		4	0	4	0,02
	01.2023		15	€	14		0	0	0	0,00
	01.2023		279	ILS	955		0	(8)	(8)	(0,04)
	01.2023		2.216	MYR	9.810		27	0	27	0,13
	01.2023		2	THB	83		0	0	0	0,00
	01.2023		31	TRY	608		1	0	1	0,01
	02.2023	ILS	2.090	\$	621		28	0	28	0,13
	02.2023	\$	80	IDR	1.255.396		1	0	1	0,01
	03.2023	CLP	464.134	\$	481		0	(58)	(58)	(0,28)
	03.2023	COP	7.711.093		1.568		4	(6)	(2)	(0,01)
	03.2023	MXN	10.559		524		0	(10)	(10)	(0,05)
	03.2023	MYR	10.776		2.393		0	(81)	(81)	(0,39)
	03.2023	PEN	1.286		331		0	(4)	(4)	(0,02)
	03.2023	\$	309	COP	1.505.822		1	(3)	(2)	(0,01)
	03.2023		1.665	INR	138.155		0	(4)	(4)	(0,02)
	03.2023		152	MXN	2.991		0	(1)	(1)	(0,01)
	03.2023		40	TWD	1.201		0	0	0	0,00
	04.2023	CLP	5.801	\$	7		0	0	0	0,00
	05.2023	€	18	CZK	469		1	0	1	0,01
BRC	01.2023	CZK	1.245	\$	53		0	(2)	(2)	(0,01)
	01.2023	MYR	99		22		0	(1)	(1)	0,00
	01.2023	RON	108		22		0	(1)	(1)	(0,01)
	01.2023	RSD	5.965		54		0	(1)	(1)	0,00
	01.2023	\$	28	CNH	197		0	0	0	0,00
	01.2023		228	MYR	1.074		17	0	17	0,08
	01.2023		400	PHP	22.330		2	0	2	0,01
	01.2023		4	PLN	18		0	0	0	0,00
	01.2023		1.597	SGD	2.150		7	0	7	0,03
BSH	01.2023	CLP	5.693	\$	6		0	0	0	0,00
	08.2023	PEN	61		15		0	0	0	0,00
CBK	01.2023	CLP	755.059		849		0	(37)	(37)	(0,18)
	01.2023	€	245		260		0	(1)	(1)	(0,01)
	01.2023	HUF	44.497		112		0	(7)	(7)	(0,03)
	01.2023	PEN	1.707		431		0	(15)	(15)	(0,07)
	01.2023	PLN	89		19		0	(1)	(1)	0,00
	01.2023	\$	640	BRL	3.362		0	(4)	(4)	(0,02)
	01.2023		792	CLP	754.804		93	0	93	0,45
	01.2023		565	€	533		4	0	4	0,02
	01.2023		46	KRW	59.692		1	0	1	0,01
	01.2023		11	PLN	52		1	0	1	0,00
	02.2023	BRL	512	\$	95		0	(2)	(2)	(0,01)
	02.2023	EGP	858		32		0	0	0	0,00
	02.2023	\$	849	CLP	759.218		37	0	37	0,18
	02.2023		54	PEN	219		3	0	3	0,01
	03.2023	COP	400.363	\$	84		3	0	3	0,01
	03.2023	ILS	310		91		3	0	3	0,01
	03.2023	PEN	350		87		0	(4)	(4)	(0,02)
	03.2023	TWD	3.136		103		0	0	0	0,00
	03.2023	\$	57	COP	276.794		0	0	0	0,00
	03.2023		1.760	MXN	34.550		1	(12)	(11)	(0,05)
	03.2023		61	PEN	236		0	0	0	0,00
	05.2023	ILS	1.586	\$	469		16	0	16	0,08
	05.2023	PEN	221		56		0	(1)	(1)	(0,01)
	05.2023	\$	0	MXN	8		0	0	0	0,00
	05.2023		166	PEN	659		5	0	5	0,02
	11.2023	ILS	492	\$	149		7	0	7	0,03
	11.2023	\$	86	EGP	2.763		8	0	8	0,04
CLY	01.2023	HUF	626	\$	2		0	0	0	0,00
	01.2023	MYR	334		71		0	(5)	(5)	(0,02)
	03.2023	TWD	689		23		0	0	0	0,00
	11.2023	€	21	HUF	9.727		1	0	1	0,01
DUB	01.2023	DKK	1.463	\$	206		0	(4)	(4)	(0,02)
	01.2023	RON	109		22		0	(2)	(2)	(0,01)
	01.2023	\$	200	TRY	4.093		17	0	17	0,08
	02.2023	ZAR	798	\$	48		1	0	1	0,01
	03.2023	MXN	338		17		0	0	0	0,00
	07.2023	ILS	392		112		0	(1)	(1)	0,00
	11.2023	EGP	1.590		56		2	0	2	0,01
GLM	01.2023	BRL	3.513		659		0	(6)	(6)	(0,03)
	01.2023	COP	1.147.009		237		0	0	0	0,00
	01.2023	HUF	13.305		35		0	(1)	(1)	0,00
	01.2023	MYR	3.581		792		0	(28)	(28)	(0,13)
	01.2023	PLN	179		36		0	(5)	(5)	(0,02)
	01/2023	\$	28	BRL	152		1	0	1	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	01.2023	\$	CNH	17	\$ 0	\$ 0	0,00
	01.2023		COP	1.147.009	0	(1)	0,00
	01.2023		HKD	21	0	0	0,00
	01.2023		HUF	10.050	1	0	0,00
	01.2023		MYR	1.557	28	28	0,13
	01.2023		PLN	6.367	193	0	0,92
	01.2023		THB	38.129	9	9	0,04
	02.2023	COP	\$	50	0	(2)	(0,01)
	02.2023	DOP		206	5	0	0,02
	02.2023	MXN		36	0	(2)	(0,01)
	02.2023	\$	COP	1.925.393	0	(29)	(0,14)
	02.2023		DOP	12.359	0	(6)	(0,03)
	02.2023		EGP	51	0	0	0,00
	03.2023	CLP	\$	25	0	(2)	(0,01)
	03.2023	COP		984	18	0	0,08
	03.2023	MXN		398	0	(12)	(0,06)
	03.2023	\$	CLP	30.339	2	0	0,01
	03.2023		COP	6.006.246	0	(20)	(0,10)
	04.2023	DOP	\$	67	3	0	0,01
	04.2023	\$	BRL	3.513	6	0	0,03
	05.2023		PEN	2.048	17	0	0,08
	05.2023	ZAR	\$	84	2	0	0,01
	11.2023	EGP		56	2	0	0,01
	11.2023	\$	EGP	365	0	0	0,00
IND	06.2024		TWD	2.110	0	(9)	(0,05)
JPM	01.2023	HUF	\$	327	0	(16)	(0,08)
	01.2023	TRY		25	0	(1)	0,00
	01.2023	\$	CNY	4.691	5	0	0,03
	01.2023		IDR	1.056.511	1	0	0,01
	01.2023		TRY	1.636	1	0	0,00
	02.2023	EGP	\$	2	0	0	0,00
	02.2023	\$	IDR	2.168.368	3	0	0,01
	02.2023		MXN	20.747	43	0	0,21
	02.2023		TWD	2.013	0	(1)	0,00
	03.2023	IDR	\$	67	0	(1)	(0,01)
	03.2023	MXN		23	0	0	0,00
	03.2023	\$	CNY	8.374	7	0	0,03
	03.2023		IDR	2.007.483	2	0	0,01
	06.2023		VND	696.000	0	0	0,00
MBC	11.2023	HUF	€	21	0	(1)	(0,01)
	01.2023	DKK	\$	187	0	(3)	(0,01)
	01.2023	€		801	0	(14)	(0,07)
	01.2023	£		219	3	0	0,01
	01.2023	¥		21	0	(1)	0,00
	01.2023	\$	€	44	1	0	0,00
	01.2023		£	62	0	(1)	(0,01)
	01.2023		HKD	88	0	0	0,00
	01.2023		¥	2.900	0	0	0,00
	02.2023	EGP	\$	33	0	0	0,00
	02.2023	MXN		104	0	(5)	(0,02)
	02.2023	\$	EGP	1.023	3	0	0,01
	02.2023		MXN	1.126	2	0	0,01
	03.2023	MXN	\$	32	0	(1)	0,00
	03.2023	\$	COP	1.213.362	0	(19)	(0,09)
	03.2023		IDR	1.218.423	1	0	0,00
	05.2023		CNH	499	0	(2)	(0,01)
MYI	01.2023	CZK	\$	32	0	(3)	(0,01)
	01.2023	€		11	0	0	0,00
	01.2023	£		185	4	0	0,02
	01.2023	HUF		47	0	(4)	(0,02)
	01.2023	IDR		68	0	0	0,00
	01.2023	KRW		50	0	(1)	(0,01)
	01.2023	MYR		103	0	(7)	(0,03)
	01.2023	PLN		47	0	(3)	(0,02)
	01.2023	\$	£	172	0	(4)	(0,02)
	01.2023		MYR	1.861	33	0	0,16
	01.2023		PLN	25	1	0	0,00
	01.2023		ZAR	2.221	9	0	0,04
	02.2023	EGP	\$	6	0	0	0,00
	02.2023	IDR		1	0	0	0,00
	02.2023	\$	TWD	3.722	0	0	0,00
	02.2023		ZAR	5.854	23	0	0,11
	02.2023	ZAR	\$	297	0	(20)	(0,09)
	03.2023	\$	IDR	1.716.755	2	0	0,01
	03.2023		ZAR	256	1	0	0,00
	04.2023	ZAR	\$	108	0	(9)	(0,04)
	05.2023	CZK	€	7	0	(1)	0,00
RBC	01.2023	PLN	\$	5	0	0	0,00
	01.2023	\$	HUF	14.446	4	0	0,02
	03.2023	MXN	\$	205	0	(3)	(0,01)
RYL	01.2023	SGD		24	0	0	0,00
	01.2023	\$	HUF	2.684	0	0	0,00
SCX	01.2023	CLP	\$	1	0	0	0,00

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
	01.2023	MYR	5.056	\$ 1.142	\$ 0	\$ (6)	(0,03)	
	01.2023	PEN	111	28	0	(1)	(0,01)	
	01.2023	\$	2.136	KRW 2.823.052	108	0	0,51	
	01.2023		1.142	MYR 5.056	14	0	0,07	
	02.2023		145	IDR 2.281.598	3	0	0,01	
	02.2023		1.144	TWD 35.212	7	0	0,03	
	03.2023	INR	349	\$ 4	0	0	0,00	
	03.2023	MXN	486	24	0	0	0,00	
	03.2023	\$	106	IDR 1.657.385	1	0	0,00	
	04.2023	KES	1.600	\$ 12	0	(1)	0,00	
SOG	01.2023	\$	433	RON 2.199	41	0	0,20	
	01.2023	ZAR	715	\$ 40	0	(2)	(0,01)	
	03.2023	KES	1.166	9	0	0	0,00	
	05.2023	CZK	312	€ 12	0	(1)	0,00	
TOR	01.2023	¥	350.000	\$ 2.443	0	(213)	(1,02)	
	02.2023	\$	11	ZAR 188	0	0	0,00	
UAG	01.2023	CZK	534	\$ 21	0	(2)	(0,01)	
	01.2023	HUF	69.510	175	0	(11)	(0,05)	
	01.2023	RON	227	46	0	(3)	(0,01)	
	01.2023	TRY	430	21	0	(1)	(0,01)	
	01.2023	\$	612	CZK 15.559	75	0	0,36	
	01.2023		102	£ 82	0	(3)	(0,01)	
	01.2023		451	TRY 9.018	27	0	0,13	
	02.2023	CNH	3.310	\$ 515	35	0	0,17	
	02.2023	\$	213	IDR 3.386.245	6	0	0,03	
	03.2023		26	MXN 524	0	0	0,00	
	03.2023	ZAR	2.840	\$ 159	0	(7)	(0,03)	
	05.2023	CNH	499	72	0	(1)	0,00	
	05.2023	€	31	CZK 773	1	0	0,01	
					\$ 1.274	\$ (954)	\$ 320	1,53
Summe Freiverkehrsfinanzderivate							\$ 558	2,67

BESCHREIBUNG

EINLAGENZERTIFIKATE

BanColombia S.A.

2,860 % fällig am 25.02.2024

8,711 % fällig am 04.04.2023

12,021 % fällig am 04.08.2023

14,763 % fällig am 12.05.2023

Summe Einlagenzertifikate

Summe Anlagen

Sonstige Aktiva und Passiva

Nettovermögen

	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
COP	50.000	\$ 10	0,05
	165.100	34	0,16
	120.000	24	0,11
	50.200	10	0,05
Summe	\$ 78	0,37	
Summe Anlagen	\$ 21.159	101,06	
Sonstige Aktiva und Passiva	\$ (222)	(1,06)	
Nettovermögen	\$ 20.937	100,00	

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

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

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.

(b) Nullkuponwertpapier.

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

(d) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

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

(f) Mit dem Fonds verbunden.

(g) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(h) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2021: 0,85 %):

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeits- datum	Kauf- datum	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
Development Bank of Southern Africa	8,600 %	21.10.2024	07.10.2021	\$ 215	\$ 185	0,88
Flourish Century	6,600	04.02.2049	25.08.2021	197	22	0,11
				\$ 412	\$ 207	0,99

Barmittel in Höhe von 282 USD (31. Dezember 2021: 302 USD) wurden zum 31. Dezember 2022 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund (Forts.)

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 15.014	\$ 250	\$ 15.264
Investmentfonds	205	1.853	0	2.058
Pensionsgeschäfte	0	2.766	0	2.766
Finanzderivate ⁽³⁾	0	993	0	993
Einlagen bei Kreditinstituten	0	34	44	78
Summen	\$ 205	\$ 20.660	\$ 294	\$ 21.159

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

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 25.257	\$ 318	\$ 25.575
Investmentfonds	2.833	0	0	2.833
Pensionsgeschäfte	0	193	0	193
Finanzderivate ⁽³⁾	0	520	0	520
Summen	\$ 2.833	\$ 25.970	\$ 318	\$ 29.121

⁽¹⁾ Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

⁽²⁾ Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

⁽³⁾ Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung des Marktwerts der außerbörslich gehandelten Finanzderivate und (erhaltenen)/verpfändeten Sicherheiten nach Kontrahenten zum 31. Dezember 2022 und 31. Dezember 2021:

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2022			Zum 31. Dez. 2021		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾
BOA	\$ 95	\$ 0	\$ 95	\$ (83)	\$ 0	\$ (83)
BPS	(152)	0	(152)	84	0	84
BRC	21	0	21	(23)	0	(23)
BSS	k. A.	k. A.	k. A.	10	0	10
CBK	98	0	98	(122)	0	(122)
CLY	(4)	0	(4)	k. A.	k. A.	k. A.
DUB	13	0	13	30	0	30
GLM	404	(270)	134	228	(10)	218
HUS	k. A.	k. A.	k. A.	138	0	138
IND	(9)	0	(9)	128	0	128
JPM	49	0	49	32	0	32
MBC	(34)	0	(34)	k. A.	k. A.	k. A.
MYC	(14)	0	(14)	1	0	1
MYI	25	0	25	26	0	26
RBC	1	0	1	(2)	0	(2)
RYL	k. A.	k. A.	k. A.	2	0	2
SCX	124	0	124	k. A.	k. A.	k. A.
SOG	38	0	38	k. A.	k. A.	k. A.
SSB	k. A.	k. A.	k. A.	(128)	0	(128)
TOR	(213)	0	(213)	36	0	36
UAG	116	0	116	48	0	48

⁽¹⁾ Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2022:

	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	27,93	58,69
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	44,26	25,70
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,70	1,54
Investmentfonds	9,83	9,52
Pensionsgeschäfte	13,22	0,65
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,09	k. A.
Zentral abgerechnete Finanzderivate	1,99	0,39
Freiverkehrsfinanzderivate	2,67	1,36
Einlagenzertifikate	0,37	k. A.

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2022 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
Argentinien	0,22	0,21
Aserbaidschan	0,93	k. A.
Brasilien	2,81	2,69
Kaimaninseln	0,21	2,19
Chile	0,03	3,05
China	0,11	k. A.
Kolumbien	1,99	4,90
Tschechische Republik	0,85	k. A.
Dänemark	1,89	1,86
Dominikanische Republik	0,31	k. A.
Ägypten	k. A.	0,67
Frankreich	k. A.	0,11
Ungarn	0,93	0,38
Indien	k. A.	1,35
Indonesien	0,00	k. A.
Irland	1,52	2,62
Israel	2,07	11,76
Italien	k. A.	0,38
Jersey, Kanalinseln	0,51	k. A.
Luxemburg	0,13	0,70
Malaysia	k. A.	0,65
Mauritius	0,87	0,72
Mexiko	1,62	0,86
Niederlande	0,05	0,07
Nigeria	k. A.	0,17
Peru	1,60	1,30
Polen	0,37	k. A.
Katar	0,45	0,39
Serbien	k. A.	0,20
Singapur	k. A.	0,68
Südafrika	3,99	4,85
Spanien	k. A.	0,78
Ukraine	k. A.	0,79
Großbritannien	1,48	k. A.
USA	5,71	6,37
Sambia	0,13	0,92
Kurzfristige Instrumente	42,11	34,31
Investmentfonds	9,83	9,52
Pensionsgeschäfte	13,22	0,65
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,09	k. A.
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf	0,00	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	k. A.	0,01
Zinsswaps	1,99	0,38
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Devisenoptionen	0,13	0,08
Verkaufsoptionen		
Devisenoptionen	0,00	(0,01)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf	0,00	(0,01)
Cross-Currency Swaps	1,01	0,62
Zinsswaps	0,00	(0,01)
Volatilitätsswaps	0,00	0,00
Devisenterminkontrakte	1,53	0,69
Einlagenzertifikate	0,37	k. A.
Sonstige Aktiva und Passiva	(1,06)	2,15
Nettovermögen	100,00	100,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO ESG Income Fund

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE											
KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNGEN											
TerraForm Power Operating LLC 7,430 % fällig am 21.05.2029	\$	498	0,21	CNP Assurances 1,250 % fällig am 27.01.2029	€	400	0,14	Kilroy Realty LP 2,500 % fällig am 15.11.2032	\$	640	0,19
Wm Morrison Supermarkets PLC 6,552 % fällig am 04.11.2027	€	518	0,20	Cooperatieve Rabobank UA 1,004 % fällig am 24.09.2026	\$	900	0,33	2,650 % fällig am 15.11.2033	200	456	0,06
6,552 % fällig am 31.07.2028	282	266	0,11	Corporate Office Properties LP 2,000 % fällig am 15.01.2029	100	77	0,03	Kookmin Bank 2,500 % fällig am 04.11.2030 (f)	200	160	0,07
		1,248	0,52	CPI Property Group S.A. 1,750 % fällig am 14.01.2030	€	300	0,08	Lendlease Finance Ltd. 3,400 % fällig am 27.10.2027	AUD	1.100	0,27
				2,750 % fällig am 22.01.2028	£	300	0,10	Logicor Financing SARL 2,000 % fällig am 17.01.2034	€	500	0,14
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL											
BANKEN UND FINANZEN											
ABN AMRO Bank NV 2,470 % fällig am 13.12.2029	\$	400	0,14	Credit Agricole Assurances S.A. 1,500 % fällig am 06.10.2031	€	200	0,07	Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc. 2,494 % fällig am 13.10.2032	\$	400	0,13
Acef Holding S.C.A. 0,750 % fällig am 14.06.2028	€	100	0,03	Crown Castle, Inc. 3,100 % fällig am 15.11.2029	\$	550	0,20	Mizuho Financial Group, Inc. 2,201 % fällig am 10.07.2031	200	157	0,07
1,250 % fällig am 26.04.2030	300	221	0,09	CTP NV 1,250 % fällig am 21.06.2029	€	400	0,12	MPT Operating Partnership LP 3,375 % fällig am 24.04.2030	£	200	0,07
AIB Group PLC 2,875 % fällig am 30.05.2031	400	384	0,16	1,500 % fällig am 27.09.2031	400	257	0,11	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen 5,875 % fällig am 23.05.2042	\$	400	0,17
Ally Financial, Inc. 2,200 % fällig am 02.11.2028	\$	600	0,20	Deutsche Bank AG 3,035 % fällig am 28.05.2032 (h)	\$	350	0,11	Nationstar Mortgage Holdings, Inc. 5,750 % fällig am 15.11.2031	300	234	0,10
8,000 % fällig am 01.11.2031	350	362	0,15	3,742 % fällig am 07.01.2033	500	356	0,15	NE Property BV 2,000 % fällig am 20.01.2030	€	200	0,06
American Express Co. 4,050 % fällig am 03.05.2029	500	477	0,20	Digital Dutch Finco BV 0,625 % fällig am 15.07.2025	€	600	0,24	3,375 % fällig am 14.07.2032	300	278	0,12
American Tower Corp. 3,100 % fällig am 15.06.2050	200	127	0,05	1,000 % fällig am 15.01.2032	500	375	0,16	New Immo Holding S.A. 2,750 % fällig am 26.11.2026	200	182	0,08
3,800 % fällig am 15.08.2029	150	136	0,06	EQT AB 0,875 % fällig am 14.05.2031	600	445	0,19	Nexti SpA 1,625 % fällig am 30.04.2026	259	253	0,11
Asian Development Bank 6,550 % fällig am 26.01.2025	ZAR	42.000	2,406	2,375 % fällig am 06.04.2028	700	658	0,28	Nomura Holdings, Inc. 2,172 % fällig am 14.07.2028	\$	600	0,21
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. 5,875 % fällig am 24.09.2023 (e)(f)	€	400	0,17	Equinix, Inc. 2,500 % fällig am 15.05.2031	\$	50	0,02	OneMain Finance Corp. 3,500 % fällig am 15.01.2027	826	685	0,29
Banco BTG Pactual S.A. 2,750 % fällig am 11.01.2026	\$	600	0,23	3,900 % fällig am 15.04.2032	260	232	0,10	Owl Rock Capital Corp. 2,875 % fällig am 11.06.2028	200	157	0,07
Banco de Sabadell S.A. 0,875 % fällig am 16.06.2028	€	100	0,04	First American Financial Corp. 2,400 % fällig am 15.08.2031	600	440	0,18	PennyMac Financial Services, Inc. 5,750 % fällig am 15.09.2031	200	159	0,07
Banco do Brasil S.A. 4,875 % fällig am 11.01.2029	\$	400	0,16	Ford Motor Credit Co. LLC 4,687 % fällig am 09.06.2025	200	191	0,08	Radian Group, Inc. 6,625 % fällig am 15.03.2025	400	395	0,17
Banco Mercantil del Norte S.A. 6,625 % fällig am 24.01.2032 (e)(f)	200	166	0,07	5,584 % fällig am 18.03.2024	200	198	0,08	Rexford Industrial Realty LP 2,150 % fällig am 01.09.2031	100	77	0,03
BanColombia S.A. 3,000 % fällig am 29.01.2025	600	569	0,24	FS KKR Capital Corp. 3,125 % fällig am 12.10.2028	450	364	0,15	Santander Holdings USA, Inc. 5,807 % fällig am 09.09.2026	800	795	0,33
Bank Mandiri Persero Tbk PT 2,000 % fällig am 19.04.2026	200	179	0,07	Globalworth Real Estate Investments Ltd. 2,950 % fällig am 29.07.2026	€	400	0,14	Santander UK Group Holdings PLC 3,823 % fällig am 03.11.2028	200	179	0,07
Bank of America Corp. 2,687 % fällig am 22.04.2032	200	161	0,07	Goldman Sachs Group, Inc. 2,383 % fällig am 21.07.2032	\$	800	0,26	Segro Capital SARL 1,875 % fällig am 23.03.2030	€	250	0,10
6,204 % fällig am 10.11.2028	300	310	0,13	4,625 % fällig am 04.05.2032	700	640	0,27	Sirius Real Estate Ltd. 1,125 % fällig am 22.06.2026	400	334	0,14
Banque Ouestr Africaine de Developpement 2,750 % fällig am 22.01.2033	€	470	0,16	GPT Wholesale Office Fund 3,222 % fällig am 05.11.2031	AUD	400	0,14	1,750 % fällig am 24.11.2028	200	147	0,06
Barclays PLC 4,836 % fällig am 09.05.2028	\$	400	0,16	Goodman U.S. Finance Five LLC 4,625 % fällig am 15.06.2026	610	531	0,22	SLM Corp. 3,125 % fällig am 02.11.2026	\$	900	0,32
5,501 % fällig am 09.08.2028	500	485	0,20	Hanwha Life Insurance Co. Ltd. 3,379 % fällig am 04.02.2032	300	249	0,10	Societe Generale S.A. 4,750 % fällig am 26.05.2026 (e)(f)	200	170	0,07
7,250 % fällig am 15.03.2023 (e)(f)	£	200	0,10	HAT Holdings LLC 3,750 % fällig am 15.09.2030	230	169	0,07	Sofina S.A. 1,000 % fällig am 23.09.2028	€	200	0,07
7,750 % fällig am 15.09.2023 (e)(f)	\$	200	0,08	Host Hotels & Resorts LP 2,900 % fällig am 15.12.2031	100	77	0,03	Standard Chartered PLC 2,678 % fällig am 29.06.2032	\$	500	0,16
BNP Paribas S.A. 1,675 % fällig am 30.06.2027	400	349	0,15	3,375 % fällig am 15.12.2029	800	670	0,28	3,603 % fällig am 12.01.2033 (h)	200	151	0,06
2,871 % fällig am 19.04.2032	200	157	0,07	3,500 % fällig am 15.09.2030	240	199	0,08	7,750 % fällig am 02.04.2023 (e)(f)	400	398	0,17
4,625 % fällig am 25.02.2031 (e)(f)	200	155	0,06	Howard Hughes Corp. 4,375 % fällig am 01.02.2031	700	567	0,24	Starwood Property Trust, Inc. 3,625 % fällig am 15.07.2026	680	596	0,25
7,750 % fällig am 16.08.2029 (e)(f)	800	792	0,33	HSBC Holdings PLC 3,973 % fällig am 22.05.2030	200	175	0,07	4,375 % fällig am 15.01.2027	310	272	0,11
Boston Properties LP 2,550 % fällig am 01.04.2032	400	305	0,13	Hudson Pacific Properties LP 3,950 % fällig am 01.11.2027	250	213	0,09	SVB Financial Group 4,570 % fällig am 29.04.2033	370	328	0,14
BPCE S.A. 2,045 % fällig am 19.10.2027	300	259	0,11	5,950 % fällig am 15.02.2028	150	140	0,06	Svenska Handelsbanken AB 4,750 % fällig am 01.03.2031 (e)(f)	200	164	0,07
Brookfield Finance UK PLC 2,340 % fällig am 30.01.2032	550	420	0,18	Indian Railway Finance Corp. Ltd. 3,570 % fällig am 21.01.2032	950	817	0,34	UBS Group AG 4,375 % fällig am 10.02.2031 (e)(f)	200	152	0,06
CaixaBank S.A. 3,625 % fällig am 14.09.2028 (e)(f)	€	200	0,06	ING Groep NV 4,125 % fällig am 24.08.2033	€	300	0,13	UniCredit SpA 5,459 % fällig am 30.06.2035	300	244	0,10
3,750 % fällig am 07.09.2029	300	314	0,13	4,250 % fällig am 16.05.2031 (e)(f)	\$	200	0,06	VIA Outlets BV 1,750 % fällig am 15.11.2028	€	500	0,17
Castellum Helsinki Finance Holding Abp 0,875 % fällig am 17.09.2029	300	209	0,09	4,875 % fällig am 16.05.2029 (e)(f)	700	542	0,23	Vonovia SE 1,875 % fällig am 28.06.2028	200	182	0,08
CBRE Global Investors Open-Ended Fund S.C.A. SICAV-SIF Pan European Core Fund 0,900 % fällig am 12.10.2029	500	390	0,16	Internationale Bank für Wiederaufbau und Entwicklung 3,000 % fällig am 27.09.2023	10.950	10.798	4,55	2,375 % fällig am 25.03.2032	200	170	0,07
Citigroup, Inc. 2,976 % fällig am 05.11.2030	\$	200	0,07	Intesa Sanpaolo SpA 4,198 % fällig am 01.06.2032	200	147	0,06	Weyerhaeuser Co. 7,375 % fällig am 15.03.2032	\$	85	0,04
4,615 % fällig am 25.01.2026 (h)	500	489	0,21	5,017 % fällig am 26.06.2024	200	192	0,08				
Citycon Treasury BV 1,625 % fällig am 12.03.2028	€	300	0,10	6,250 % fällig am 16.05.2024 (e)(f)	€	200	0,06				

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS			
Workspace Group PLC 2,250 % fällig am 11.03.2028	£	500	\$ 449	0,19	MSCI, Inc. 3,625 % fällig am 01.09.2030	\$	400	\$ 333	0,14	Greenko Dutch BV 3,850 % fällig am 29.03.2026	\$	191	\$ 166	0,07
ZF Finance GmbH 2,000 % fällig am 06.05.2027	€	400	351	0,15	Natura Cosmeticos S.A. 4,125 % fällig am 03.05.2028	€	600	490	0,21	Greenko Power Ltd. 4,300 % fällig am 13.12.2028	€	191	161	0,07
2,250 % fällig am 03.05.2028		100	84	0,04	Nemak S.A.B. de C.V. 2,250 % fällig am 20.07.2028	€	400	341	0,14	Greenko Solar Mauritius Ltd. 5,950 % fällig am 29.07.2026	€	200	183	0,08
			52.100	21,90	Newell Brands, Inc. 4,875 % fällig am 01.06.2025	\$	200	195	0,08	Iberdrola International BV 6,750 % fällig am 15.09.2033	€	250	264	0,11
INDUSTRIEWERTE					NextEra Energy Operating Partners LP 3,875 % fällig am 15.10.2026	\$	180	165	0,07	India Green Energy Holdings 5,375 % fällig am 29.04.2024	€	250	241	0,10
AA Bond Co. Ltd. 4,875 % fällig am 31.07.2043	£	500	570	0,24	Nokia Oyj 3,125 % fällig am 15.05.2028	€	400	405	0,17	India Green Power Holdings 4,000 % fällig am 22.02.2027	€	250	214	0,09
Accor S.A. 2,375 % fällig am 29.11.2028	€	900	824	0,35	NXP BV 2,500 % fällig am 11.05.2031	\$	250	200	0,08	Leeward Renewable Energy Operations LLC 4,250 % fällig am 01.07.2029	\$	500	428	0,18
Allegion U.S. Holding Co., Inc. 3,550 % fällig am 01.10.2027	\$	200	181	0,08	5,000 % fällig am 15.01.2033	\$	1.000	947	0,40	National Grid PLC 0,250 % fällig am 01.09.2028	€	400	347	0,15
Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC 3,000 % fällig am 01.09.2029	€	600	471	0,20	Owens Corning 3,950 % fällig am 15.08.2029	€	300	273	0,11	NextEra Energy Capital Holdings, Inc. 1,900 % fällig am 15.06.2028	\$	400	342	0,14
Ball Corp. 3,125 % fällig am 15.09.2031	\$	580	467	0,20	Pearson Funding PLC 3,750 % fällig am 04.06.2030	€	100	107	0,04	2,200 % fällig am 02.12.2026	AUD	400	242	0,10
BCP Modular Services Finance PLC 4,750 % fällig am 30.11.2028	€	100	90	0,04	Prosus NV 3,061 % fällig am 13.07.2031	\$	600	464	0,20	Pattern Energy Operations LP 4,500 % fällig am 15.08.2028	\$	500	449	0,19
Boise Cascade Co. 4,875 % fällig am 01.07.2030	\$	380	333	0,14	Rexel S.A. 3,257 % fällig am 19.01.2027	\$	300	269	0,11	Southern California Edison Co. 2,500 % fällig am 01.06.2031	€	400	331	0,14
CDW LLC 3,569 % fällig am 01.12.2031	€	500	413	0,17	RELX Capital, Inc. 4,750 % fällig am 20.05.2032	€	800	771	0,32	3,650 % fällig am 01.06.2051	€	200	146	0,06
Cellnex Finance Co. S.A. 3,875 % fällig am 07.07.2041	€	200	137	0,06	ReNew Power Pvt Ltd. 5,875 % fällig am 05.03.2027	€	200	192	0,08	Star Energy Geothermal Wayang Windu Ltd. 6,750 % fällig am 24.04.2033	€	324	307	0,13
Coty, Inc. 3,875 % fällig am 15.04.2026	€	300	299	0,13	Rexel S.A. 2,125 % fällig am 15.12.2028	€	300	279	0,12	TDC Net A/S 5,056 % fällig am 31.05.2028	€	300	315	0,13
DaVita, Inc. 3,750 % fällig am 15.02.2031	\$	400	299	0,13	S&P Global, Inc. 2,700 % fällig am 01.03.2029	\$	700	618	0,26	TerraForm Power Operating LLC 5,000 % fällig am 31.01.2028	\$	230	207	0,09
Fair Isaac Corp. 4,000 % fällig am 15.06.2028	€	610	555	0,23	Schaeffler AG 3,375 % fällig am 12.10.2028	€	200	186	0,08	TransAlta Corp. 7,750 % fällig am 15.11.2029	€	400	409	0,17
Faurecia SE 2,750 % fällig am 15.02.2027	€	500	452	0,19	Sixt SE 1,750 % fällig am 09.12.2024	€	200	206	0,09	Verizon Communications, Inc. 2,850 % fällig am 03.09.2041	€	300	208	0,09
Flex Ltd. 6,000 % fällig am 15.01.2028	\$	300	300	0,13	Standard Industries, Inc. 2,250 % fällig am 21.11.2026	€	600	550	0,23	Vodafone Group PLC 5,125 % fällig am 04.06.2081	€	113	83	0,03
Ford Motor Co. 3,250 % fällig am 12.02.2032	€	80	60	0,03	Tesco Corporate Treasury Services PLC 0,375 % fällig am 27.07.2029	€	300	248	0,10				7.530	3,16
Fortune Brands Innovations, Inc. 3,250 % fällig am 15.09.2029	€	150	130	0,05	Transurban Finance Co. Pty. Ltd. 2,450 % fällig am 16.03.2031	\$	500	394	0,17	Summe Unternehmensanleihen und Wechsel			81.799	34,38
Gap, Inc. 3,625 % fällig am 01.10.2029	€	200	141	0,06	Travis Perkins PLC 3,750 % fällig am 17.02.2026	€	400	427	0,18	US-REGIERUNGSBEHÖRDEN				
3,875 % fällig am 01.10.2031	€	300	210	0,09	Verallia S.A. 1,625 % fällig am 14.05.2028	€	500	461	0,19	Fannie Mae 3,500 % fällig am 01.08.2059	€	3.355	3.082	1,30
GN Store Nord A/S 0,875 % fällig am 25.11.2024	€	400	385	0,16	1,875 % fällig am 10.11.2031	€	500	418	0,18	4,000 % fällig am 01.11.2059	€	147	140	0,06
Graphic Packaging International LLC 2,625 % fällig am 01.02.2029	€	400	375	0,16	VeriSign, Inc. 2,700 % fällig am 15.06.2031	\$	650	531	0,22	Uniform Mortgage-Backed Security 3,000 % fällig am 01.07.2052	€	497	437	0,18
HCA, Inc. 4,500 % fällig am 15.02.2027	\$	500	483	0,20	Vilmorin & Cie S.A. 1,375 % fällig am 26.03.2028	€	300	237	0,10	Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.01.2053	€	500	407	0,17
Hilton Domestic Operating Co., Inc. 3,625 % fällig am 15.02.2032	€	380	305	0,13	4,500 % fällig am 15.07.2031	€	200	185	0,08	2,500 % fällig am 01.01.2053	€	1.750	1.482	0,62
4,000 % fällig am 01.05.2031	€	200	168	0,07	Vmed O2 UK Financing PLC 4,750 % fällig am 15.07.2031	\$	600	489	0,21	4,000 % fällig am 01.01.2053	€	19.300	18.109	7,61
InterContinental Hotels Group PLC 3,375 % fällig am 08.10.2028	€	500	521	0,22	Wabtec Transportation Netherlands BV 1,250 % fällig am 03.12.2027	€	400	363	0,15	4,500 % fällig am 01.02.2053	€	5.600	5.391	2,27
JCDecaux SE 1,625 % fällig am 07.02.2030	€	300	256	0,11	Weir Group PLC 2,200 % fällig am 13.05.2026	\$	400	355	0,15	5,000 % fällig am 01.01.2053	€	23.500	23.158	9,73
JDE Peet's NV 2,250 % fällig am 24.09.2031	\$	600	455	0,19	Zenith Finco PLC 6,500 % fällig am 30.06.2027	€	200	189	0,08	6,000 % fällig am 01.01.2053	€	9.100	9.121	3,83
John Lewis PLC 6,125 % fällig am 21.01.2025	€	200	231	0,10				22.169	9,32	7.700	7.812	3,28		
Lendlease Europe Finance PLC 3,500 % fällig am 02.12.2033	€	400	309	0,13	VERSORGUNGSUNTERNEHMEN							69.139	29,05	
Lenovo Group Ltd. 3,421 % fällig am 02.11.2030	\$	400	318	0,13	AES Corp. 2,450 % fällig am 15.01.2031	\$	300	239	0,10	U.S. Treasury Inflation Protected Securities (d) 0,125 % fällig am 15.07.2024	€	50	49	0,02
Level 3 Financing, Inc. 3,750 % fällig am 15.07.2029	€	80	58	0,02	Atlantica Sustainable Infrastructure PLC 4,125 % fällig am 15.06.2028	€	200	178	0,07	0,125 % fällig am 15.10.2024	€	139	134	0,06
Liberty Utilities Finance GP 2,050 % fällig am 15.09.2030	€	300	226	0,09	Clean Renewable Power Mauritius Pte. Ltd. 4,250 % fällig am 25.03.2027	€	191	166	0,07	0,125 % fällig am 15.07.2031	€	1.379	1.219	0,51
Lindblad Expeditions LLC 6,750 % fällig am 15.02.2027	€	300	273	0,11	Clearway Energy Operating LLC 3,750 % fällig am 15.02.2031	€	630	524	0,22	0,125 % fällig am 15.01.2032	€	6.665	5.842	2,46
Marks & Spencer PLC 3,750 % fällig am 19.05.2026	€	100	105	0,04	Enel Finance America LLC 7,100 % fällig am 14.10.2027	€	800	829	0,35	0,625 % fällig am 15.01.2024	€	243	238	0,10
4,500 % fällig am 10.07.2027	€	350	363	0,15	Enel Finance International NV 1,375 % fällig am 12.07.2026	€	300	259	0,11	0,750 % fällig am 15.02.2045	€	202	164	0,07
Metalsa S.A. de C.V. 3,750 % fällig am 04.05.2031	\$	150	118	0,05	2,250 % fällig am 12.07.2031	€	400	292	0,12	1,000 % fällig am 15.02.2046	€	516	438	0,18
										1,375 % fällig am 15.02.2044	€	805	749	0,31
										U.S. Treasury Notes 2,375 % fällig am 31.03.2029	€	2.100	1.910	0,81
										3,875 % fällig am 30.09.2029	€	2.400	2.383	1,00
													13.126	5,52
										NON-AGENCY-MBS				
										1211 Avenue of the Americas Trust 4,142 % fällig am 10.08.2035	€	1.895	1.606	0,68
										225 Liberty Street Trust 4,501 % fällig am 10.02.2036	€	1.200	1.058	0,44

Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO ESG Income Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
280 Park Avenue Mortgage Trust 5,317 % fällig am 15.09.2034	\$ 2.297	\$ 2.185	0,92	Worldwide Plaza Trust 3,596 % fällig am 10.11.2036	\$ 1.795	\$ 1.248	0,52	Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust 5,389 % fällig am 25.10.2034	\$ 1.051	\$ 1.018	0,43
Banc of America Funding Trust 6,479 % fällig am 25.10.2036	65	58	0,02			30.692	12,90			14.342	6,03
Barclays Commercial Mortgage Securities Trust 0,597 % fällig am 10.08.2033 (a)	9.200	131	0,06	FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				STAATSEMISSIONEN			
4,216 % fällig am 10.08.2033	105	96	0,04	Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates				Chile Government International Bond 2,750 % fällig am 31.01.2027			
4,498 % fällig am 10.08.2035	1.600	1.481	0,62	5,439 % fällig am 25.05.2035				3,500 % fällig am 31.01.2034			
4,563 % fällig am 10.08.2033	2.190	1.886	0,79	Argent Securities Trust 4,689 % fällig am 25.06.2036				Fondo MIVIVIENDA S.A. 4,625 % fällig am 12.04.2027			
4,957 % fällig am 10.08.2035	350	297	0,13	2,034				300			
Bear Stearns ALT-A Trust 4,709 % fällig am 25.06.2046 ^	810	675	0,28	Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust 4,889 % fällig am 25.08.2036				Korea Development Bank 4,800 % fällig am 10.06.2023			
Commercial Mortgage Trust 3,832 % fällig am 10.02.2036	3.000	2.683	1,13	5,514 % fällig am 25.02.2035				1.150,00 IDR 0			
Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust 4,479 % fällig am 19.03.2037	1.349	1.086	0,46	BNC Mortgage Loan Trust 3,797 % fällig am 25.10.2036				Mexico Government International Bond 2,250 % fällig am 12.08.2036			
EMF-UK PLC 4,491 % fällig am 13.03.2046	£ 3.566	4.198	1,76	Centex Home Equity Loan Trust 5,304 % fällig am 25.10.2035				€ 870			
European Loan Conduit DAC 4,175 % fällig am 22.07.2029	897	1.050	0,44	72				600			
Independence Plaza Trust 3,763 % fällig am 10.07.2035	\$ 345	324	0,14	Countrywide Asset-Backed Certificates Trust 4,529 % fällig am 25.06.2047 ^				Romania Government International Bond 1,750 % fällig am 13.07.2030			
3,911 % fällig am 10.07.2035	1.940	1.814	0,76	4,909 % fällig am 25.12.2036 ^				600			
4,158 % fällig am 10.07.2035	132	122	0,05	First Franklin Mortgage Loan Trust 4,129 % fällig am 25.03.2036				Serbia Government International Bond 1,000 % fällig am 23.09.2028			
4,356 % fällig am 10.07.2035	1.050	956	0,40	5,139 % fällig am 25.12.2035				400			
Madison Avenue Mortgage Trust 3,366 % fällig am 15.08.2034	690	635	0,27	GSAMP Trust 4,869 % fällig am 25.06.2036				South Africa Government International Bond 10,500 % fällig am 21.12.2026			
3,484 % fällig am 15.08.2034	225	203	0,09	5,289 % fällig am 25.11.2035 ^				ZAR 8.500			
3,976 % fällig am 15.08.2034	1.900	1.703	0,72	100				528			
MortgageIT Trust 4,989 % fällig am 25.08.2035	398	372	0,16	Lehman XS Trust 4,709 % fällig am 25.02.2037				2.835			
Natixis Commercial Mortgage Securities Trust 3,790 % fällig am 15.11.2032	1.220	1.072	0,45	Long Beach Mortgage Loan Trust 4,539 % fällig am 25.11.2036				1,19			
Residential Accredit Loans, Inc. Trust 4,769 % fällig am 25.12.2036	78	66	0,03	Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust 5,064 % fällig am 25.09.2035							
Residential Funding Mortgage Securities, Inc. Trust 3,726 % fällig am 25.04.2037	44	34	0,01	Mosaic Solar Loans LLC 4,450 % fällig am 20.06.2042							
Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust 5,034 % fällig am 25.04.2035	52	50	0,02	Soundview Home Loan Trust 4,889 % fällig am 25.10.2036							
Towd Point Mortgage Funding PLC 3,596 % fällig am 20.10.2051	£ 3.000	3.524	1,48	Structured Asset Investment Loan Trust 5,364 % fällig am 25.05.2035							
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust 3,329 % fällig am 25.11.2036 ^	93	79	0,03	Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust 4,679 % fällig am 25.07.2036 ^							
				78							
				63							
				0,03							

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft ⁽¹⁾	% des Netto- vermögens
BPS	4,150 %	30.12.2022	03.01.2023	\$ 44.400	U.S. Treasury Notes 1,625 % fällig am 15.05.2031	\$ (45.259)	\$ 44.400	\$ 44.420	18,66
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (45.259)	\$ 44.400	\$ 44.420	18,66

⁽¹⁾ Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Netto- vermögens
3-Month SOFR December Futures	Short	03.2024	5	\$ 23	0,01
3-Month SOFR December Futures	Short	03.2025	3	8	0,00
3-Month SOFR December Futures	Short	03.2026	4	10	0,00
3-Month SOFR June Futures	Short	09.2024	4	13	0,01
3-Month SOFR June Futures	Short	09.2025	2	5	0,00
3-Month SOFR March Futures	Short	06.2024	4	16	0,01
3-Month SOFR March Futures	Short	06.2025	2	5	0,00
3-Month SOFR March Futures	Short	06.2026	3	8	0,00
3-Month SOFR September Futures	Short	12.2024	3	9	0,00
3-Month SOFR September Futures	Short	12.2025	3	8	0,00
Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 146,000 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond February 2023 Futures ⁽¹⁾	Short	01.2023	2	2	0,00

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 138,500 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond February 2023 Futures ⁽¹⁾	Short	01.2023	2	\$ (11)	0,00
U.S. Treasury 5-Year Note March Futures	Long	03.2023	47	(2)	0,00
U.S. Treasury 10-Year Note March Futures	Short	03.2023	119	37	0,02
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond March Futures	Short	03.2023	14	(4)	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond March Futures	Short	03.2023	10	6	0,00
				\$ 133	0,05

(1) Future-Style-Option.

VERKAUFSOPTIONEN**OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE**

Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
Call – CME Kaufoptionen mit Ausübungskurs von USD 98,000 auf 3-Month SOFR December Futures	\$ 98,000	15.12.2023	3	\$ (2)	\$ (0)	0,00
Put – CME Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von USD 96,500 auf 3-Month SOFR December Futures	96,500	15.12.2023	3	(3)	(9)	0,00
				\$ (5)	\$ (9)	0,00
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate					\$ 124	0,05

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
British Telecommunications PLC	1,000 %	20.06.2028	€ 200	\$ (6)	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20.12.2028	900	(27)	(0,01)
Tesco PLC	1,000	20.06.2028	100	(3)	0,00
				\$ (36)	(0,01)

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	2,000 %	15.03.2033	£ 1.500	\$ (36)	(0,01)
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000	15.12.2026	¥ 330.000	40	0,02
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000	16.06.2028	890.000	222	0,09
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000	15.12.2028	1.690.000	129	0,06
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,400	15.06.2032	330.000	99	0,04
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,500	15.03.2042	170.000	110	0,05
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,573	28.02.2027	\$ 300	(26)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,600	16.01.2026	2.700	64	0,03
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,618	09.02.2029	200	(22)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,620	18.04.2027	300	(26)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,650	08.02.2032	250	(36)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,730	24.02.2032	150	(21)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,765	16.03.2032	300	(41)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,770	14.02.2032	150	(20)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,783	22.04.2027	400	(32)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,788	03.05.2027	500	(41)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,817	05.04.2032	150	(20)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,872	06.04.2032	150	(19)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,888	22.03.2029	200	(19)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,928	25.03.2027	300	(22)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,000	21.12.2027	14.620	126	0,05
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,000	21.12.2029	1.870	8	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,000	21.12.2032	5.090	(110)	(0,05)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,250	17.06.2027	400	(25)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,300	17.01.2026	2.000	47	0,02
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,350	17.01.2025	3.500	51	0,02
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,370	21.06.2027	400	(23)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,430	30.09.2027	460	28	0,01
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,450	20.12.2024	6.800	102	0,04
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,450	04.10.2027	460	28	0,01
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,605	28.06.2027	400	(18)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,850	30.08.2027	1.000	(36)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,880	30.09.2027	1.300	(43)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,900	04.10.2027	1.300	(42)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,955	04.10.2027	300	(9)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,050	07.09.2027	600	(16)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,050	08.09.2029	600	(18)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,050	06.09.2032	500	(17)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,100	09.09.2029	600	(16)	(0,01)

Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO ESG Income Fund (Forts.)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,350 %	14.12.2032	\$ 100	\$ 2	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,610	12.12.2032	200	0	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,750	13.12.2027	400	1	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,500	16.06.2028	150	18	0,01
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,750	16.06.2031	100	16	0,01
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,250	15.12.2026	6.000	(684)	(0,29)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,250	16.06.2051	40	9	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,270	04.11.2023	8.800	(278)	(0,12)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,350	20.01.2027	200	21	0,01
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,360	15.02.2027	550	58	0,03
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,380	04.01.2027	500	(51)	(0,02)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,418	20.01.2027	250	(25)	(0,01)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,420	24.02.2027	400	41	0,02
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,425	18.01.2027	500	(50)	(0,02)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,443	18.01.2027	500	(49)	(0,02)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,450	17.02.2027	500	50	0,02
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,450	16.07.2031	50	9	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,500	15.12.2028	800	(114)	(0,05)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,500	12.01.2029	110	14	0,01
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,518	20.01.2029	150	(19)	(0,01)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,535	15.10.2031	200	(35)	(0,01)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,550	20.01.2027	700	(65)	(0,03)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,570	11.01.2027	200	(19)	(0,01)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,570	12.01.2027	100	(9)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,580	16.02.2027	300	(28)	(0,01)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,600	15.02.2027	2.200	(201)	(0,08)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,630	26.01.2029	150	(18)	(0,01)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,650	24.02.2027	1.300	(116)	(0,05)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,655	24.01.2032	150	(25)	(0,01)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,700	06.03.2024	500	(16)	(0,01)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,700	17.02.2027	2.100	(182)	(0,08)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,700	12.01.2029	400	(47)	(0,02)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,735	12.01.2032	150	(24)	(0,01)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,785	12.08.2051	50	16	0,01
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,815	24.01.2052	50	(15)	(0,01)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,867	26.01.2052	50	(15)	(0,01)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	2,000	18.02.2032	200	(27)	(0,01)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	2,000	15.12.2051	200	(65)	(0,03)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,000	13.05.2027	€ 700	(62)	(0,02)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,000	18.05.2027	400	(35)	(0,01)
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	1,500	15.03.2028	4.000	187	0,08
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	1,500	15.03.2053	300	11	0,01
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	1,750	15.03.2033	6.900	75	0,03
					\$ (1.446)	(0,61)
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					\$ (1.482)	(0,62)

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definieren.

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

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

OPTIONSKAUF

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
GLM	Call – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,110 %	26.07.2032	200	\$ 32	\$ 26	0,01
	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,110	26.07.2032	300	49	62	0,02
MYC	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,053	20.07.2023	2.600	16	1	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,053	20.07.2023	2.600	16	39	0,02
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,620	22.07.2024	2.600	19	9	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,620	22.07.2024	2.600	20	29	0,01
	Call – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,400	20.07.2027	200	26	19	0,01
	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,400	20.07.2027	200	26	36	0,01
							\$ 204	\$ 221	0,08

VERKAUFSOPTIONEN

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettvermögens
BOA	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,150 %	01.12.2023	400	\$ (1)	\$ 0	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	01.12.2023	400	(1)	(3)	0,00
	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,000	19.01.2023	200	(1)	0	0,00
BPS	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,500	19.01.2023	200	(1)	(3)	0,00
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,550	11.04.2023	100	0	0	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,100	11.04.2023	100	0	(2)	0,00
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,700	28.04.2023	400	(1)	0	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,250	28.04.2023	400	(1)	(6)	0,00
	Call – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,150	09.01.2023	400	(1)	0	0,00
BRC	Put – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	09.01.2023	400	(1)	(3)	0,00
	Call – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,270	23.01.2023	200	(1)	0	0,00
	Put – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,770	23.01.2023	200	(1)	(1)	0,00
	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,000	19.01.2023	200	(1)	0	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,500	19.01.2023	200	(1)	(3)	0,00
	Call – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,200	12.01.2023	300	(1)	0	0,00
CBK	Put – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,800	12.01.2023	300	(1)	(1)	0,00
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,690	02.04.2024	100	(1)	0	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,690	02.04.2024	100	(1)	(1)	0,00
DUB	Call – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,150	09.01.2023	400	(1)	0	0,00
	Put – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	09.01.2023	400	(1)	(3)	0,00
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,920	13.10.2023	300	(2)	0	0,00
GLM	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,920	13.10.2023	300	(2)	(4)	0,00
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,790	08.04.2024	200	(2)	(1)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,790	08.04.2024	200	(2)	(2)	0,00
GLM	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,765	25.07.2023	1,100	(7)	0	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,765	25.07.2023	1,100	(7)	(20)	(0,01)
	Call – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,468	25.07.2023	200	(5)	(1)	0,00
	Put – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,468	25.07.2023	200	(5)	(10)	(0,01)
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,920	13.10.2023	200	(1)	0	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,920	13.10.2023	200	(1)	(3)	0,00
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,018	20.10.2023	200	(1)	0	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,018	20.10.2023	200	(1)	(3)	0,00
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,140	23.10.2023	200	(1)	0	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,140	23.10.2023	200	(1)	(2)	0,00
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,190	23.10.2023	200	(1)	0	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,190	23.10.2023	200	(1)	(2)	0,00
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,225	23.10.2023	200	(1)	0	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,225	23.10.2023	200	(1)	(2)	0,00
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,973	25.10.2023	200	(1)	0	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,973	25.10.2023	200	(1)	(3)	0,00
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,841	27.10.2023	200	(1)	0	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,841	27.10.2023	200	(1)	(3)	0,00
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,088	03.11.2023	200	(2)	0	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,088	03.11.2023	200	(2)	(2)	0,00
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,910	10.11.2023	200	(1)	0	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,910	10.11.2023	200	(1)	(3)	0,00
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,250	17.11.2023	400	(2)	0	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	17.11.2023	400	(2)	(3)	0,00
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,150	20.11.2023	400	(1)	0	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	20.11.2023	400	(1)	(3)	0,00
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,250	07.12.2023	400	(1)	0	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	07.12.2023	400	(1)	(3)	0,00
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,697	02.04.2024	500	(4)	(1)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,697	02.04.2024	500	(4)	(6)	0,00
Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,721	08.04.2024	200	(2)	(1)	0,00	
Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,721	08.04.2024	200	(2)	(2)	0,00	
Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,550	05.04.2023	400	(1)	0	0,00	
Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,100	05.04.2023	400	(1)	(6)	(0,01)	
Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,550	11.04.2023	700	(1)	0	0,00	
Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,100	11.04.2023	700	(1)	(11)	(0,01)	
Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,700	26.04.2023	400	(1)	0	0,00	
Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,250	26.04.2023	400	(1)	(6)	0,00	
Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,550	15.05.2023	500	(1)	0	0,00	
Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,100	15.05.2023	500	(1)	(8)	(0,01)	
Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,547	07.03.2023	400	(9)	(1)	0,00	
Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,547	07.03.2023	400	(9)	(25)	(0,01)	
Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,067	09.06.2023	600	(7)	(2)	0,00	
Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	3,140	09.06.2023	600	(8)	(20)	(0,01)	
Call – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,230	23.01.2023	600	(2)	0	0,00	
Put – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,730	23.01.2023	600	(2)	(4)	0,00	
Call – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,200	12.01.2023	300	(1)	0	0,00	
Put – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,800	12.01.2023	300	(1)	(1)	0,00	
Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,052	20.07.2023	1,100	(7)	(1)	0,00	
Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,052	20.07.2023	1,100	(7)	(17)	(0,01)	
Call – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,675	20.07.2023	200	(5)	(1)	0,00	
Put – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,675	20.07.2023	200	(5)	(9)	(0,01)	
Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,993	11.10.2023	200	(1)	0	0,00	
Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,993	11.10.2023	200	(1)	(3)	0,00	
Call – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,537	20.07.2023	100	(7)	(2)	0,00	
Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,537	20.07.2023	100	(7)	(14)	(0,01)	
							\$ (177)	\$ (237)	(0,10)

Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO ESG Income Fund (Forts.)

ZINSCAPS

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
MYC	Call – OTC 1-Year Interest Rate Floor ⁽²⁾	1-Year USD-LIBOR	0,030 %	24.07.2024	2.600	\$ (19)	\$ (41)	(0,02)
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Floor ⁽²⁾	1-Year USD-LIBOR	0,030	24.07.2024	2.600	(19)	(4)	0,00
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Floor ⁽²⁾	1-Year USD-LIBOR	0,026	23.07.2025	2.600	(23)	(32)	(0,01)
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Floor ⁽²⁾	1-Year USD-LIBOR	0,026	23.07.2025	2.600	(23)	(12)	(0,01)
						\$ (84)	\$ (89)	(0,04)

⁽²⁾ Das zugrunde liegende Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.01.2053	\$ 101,891	05.01.2023	300	\$ (1)	\$ 0	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.02.2053	100,000	06.02.2023	100	(1)	(1)	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.02.2053	102,000	06.02.2023	100	(1)	0	0,00
JPM	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.03.2053	97,000	06.03.2023	100	(1)	(1)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.03.2053	97,156	06.03.2023	100	(1)	(2)	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.03.2053	99,000	06.03.2023	100	(1)	0	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.03.2053	99,156	06.03.2023	100	(1)	0	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fällig am 01.03.2053	98,766	06.03.2023	100	(1)	(1)	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fällig am 01.03.2053	100,766	06.03.2023	100	(1)	0	0,00
SAL	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fällig am 01.03.2053	97,578	06.03.2023	100	(1)	(1)	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fällig am 01.03.2053	99,578	06.03.2023	100	(1)	(1)	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.01.2053	102,250	05.01.2023	200	(1)	0	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.02.2053	99,750	06.02.2023	300	0	(2)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.02.2053	100,000	06.02.2023	100	(1)	(1)	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.02.2053	101,750	06.02.2023	300	0	(1)	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.02.2053	102,000	06.02.2023	100	(1)	0	0,00
					\$ (14)	\$ (11)	0,00

⁽¹⁾ Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag ⁽²⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
MYC	South Africa Government International Bond	1,000 %	20.12.2026	\$ 1.000	\$ (44)	\$ 5	\$ (39)	(0,02)

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Kontrahent	Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag ⁽²⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
MYC	CMBX.NA.AAA.14 Index	0,500 %	16.12.2072	\$ 1.600	\$ (39)	\$ 12	\$ (27)	(0,01)

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

⁽²⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definieren.

DEWISENTERMIKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	02.2023	£ 4.353	\$ 5.145	\$ 5	\$ (102)	\$ (97)	(0,04)
	02.2023	\$ 297	€ 278	1	0	1	0,00
	02.2023	177	¥ 24.800	12	0	12	0,01
	02.2023	338	NOK 3.358	3	0	3	0,00
	02.2023	109	ZAR 1.948	5	0	5	0,00
	03.2023	309	MXN 6.148	2	0	2	0,00
BPS	01.2023	381	ZAR 6.626	8	0	8	0,00
	02.2023	€ 17.461	\$ 18.106	0	(584)	(584)	(0,24)
	03.2023	\$ 806	MXN 16.250	16	0	16	0,01
BRC	02.2023	513	NOK 5.120	8	0	8	0,00
CBK	01.2023	CLP 209.791	\$ 236	0	(10)	(10)	0,00
	01.2023	\$ 10	BRL 51	0	0	0	0,00
	01.2023	220	CLP 209.721	26	0	26	0,01
	02.2023	£ 6.424	\$ 7.816	81	0	81	0,03
	02.2023	\$ 1.349	AUD 2.015	20	0	20	0,01
	02.2023	236	CLP 210.947	10	0	10	0,01
	02.2023	186	€ 174	0	0	0	0,00
	02.2023	1.013	NZD 1.583	0	(11)	(11)	0,00

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	03.2023	IDR 1.278.167	\$ 82	\$ 0	\$ (1)	\$ (1)	0,00
	03.2023	\$ 247	MXN 4.844	0	(2)	(2)	0,00
	05.2023	MXN 51	\$ 3	0	0	0	0,00
DUB	02.2023	\$ 85	ZAR 1.415	0	(2)	(2)	0,00
GLM	01.2023	BRL 51	\$ 10	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 2.031	KRW 2.646.888	73	0	73	0,03
	01.2023	111	ZAR 1.990	5	0	5	0,00
	02.2023	10	BRL 51	0	0	0	0,00
	03.2023	MXN 1.658	\$ 81	0	(3)	(3)	0,00
	05.2023	\$ 149	ZAR 2.486	0	(4)	(4)	0,00
JPM	01.2023	181	KRW 237.396	7	0	7	0,00
	02.2023	€ 1.881	\$ 2.006	0	(7)	(7)	0,00
	02.2023	\$ 3.277	¥ 451.566	166	0	166	0,07
	02.2023	613	MXN 12.568	26	0	26	0,01
MBC	02.2023	367	AUD 546	4	0	4	0,00
	02.2023	1.692	CAD 2.242	0	(38)	(38)	(0,01)
	02.2023	337	¥ 45.600	10	0	10	0,00
MYI	03.2023	141	MXN 2.834	3	0	3	0,00
	01.2023	€ 58	\$ 62	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 145	ZAR 2.529	4	0	4	0,00
	02.2023	€ 116	\$ 121	0	(3)	(3)	0,00
	02.2023	\$ 1.585	AUD 2.338	3	0	3	0,00
	02.2023	234	¥ 31.800	8	0	8	0,00
	02.2023	232	ZAR 4.127	10	0	10	0,00
UAG	03.2023	272	MXN 5.404	2	0	2	0,00
				\$ 518	\$ (767)	\$ (249)	(0,10)

ABGESICHERTE DEWISETERMINKONTRÄKTE

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional AUD (Hedged) ausschüttend und R AUD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2023	AUD 141	\$ 95	\$ 0	\$ (1)	\$ (1)	0,00
	01.2023	\$ 14.840	AUD 22.018	95	0	95	0,04
CBK	01.2023	AUD 752	\$ 510	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 968	AUD 1.430	5	(3)	2	0,00
MBC	01.2023	7.339	10.915	70	(5)	65	0,03
MYI	01.2023	17.618	26.235	178	0	178	0,08
UAG	01.2023	19.718	29.212	97	0	97	0,04
				\$ 445	\$ (9)	\$ 436	0,19

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional CHF (Hedged) thesaurierend und E CHF (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2023	\$ 254	CHF 240	\$ 6	\$ 0	\$ 6	(0,01)
CBK	01.2023	440	416	9	0	9	0,00
MBC	01.2023	305	282	0	0	0	0,00
MYI	01.2023	CHF 5	\$ 5	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 2.294	CHF 2.132	12	0	12	0,01
RYL	01.2023	2.294	2.132	12	0	12	0,01
SCX	01.2023	2.294	2.132	12	0	12	0,01
				\$ 51	\$ 0	\$ 51	0,02

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, E EUR (Hedged) thesaurierend und E EUR (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	01.2023	\$ 1.749	€ 1.642	\$ 4	\$ 0	\$ 4	0,00
BOA	01.2023	1.971	1.869	24	0	24	0,01
BPS	01.2023	€ 314	\$ 335	0	(1)	(1)	0,00
BRC	01.2023	\$ 11.053	€ 10.404	55	0	55	0,02
CBK	01.2023	€ 354	\$ 375	0	(3)	(3)	0,00
	01.2023	\$ 32.885	€ 31.630	887	0	887	0,38
MBC	01.2023	€ 4	\$ 4	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 33.880	€ 32.305	613	0	613	0,26
RYL	01.2023	6.973	6.602	76	0	76	0,03
SCX	01.2023	30.111	28.929	777	0	777	0,33
				\$ 2.436	\$ (4)	\$ 2.432	1,03

Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO ESG Income Fund (Forts.)

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilsklasse Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2023	£ 4	\$ 5	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	01.2023	\$ 165	£ 137	0	0	0	0,00
BRC	01.2023	£ 1	\$ 1	0	0	0	0,00
MBC	01.2023	\$ 172	£ 143	1	0	1	0,00
MYI	01.2023	4	3	0	0	0	0,00
UAG	01.2023	151	126	0	0	0	0,00
				\$ 1	\$ 0	\$ 1	0,00

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional SEK (Hedged) thesaurierend und Administrative SEK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2023	SEK 8	\$ 1	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	01.2023	\$ 273	SEK 2.819	0	(2)	(2)	0,00
CBK	01.2023	SEK 1.232	\$ 120	1	0	1	0,00
	01.2023	\$ 3.789	SEK 39.632	18	(2)	16	0,01
MBC	01.2023	66	686	0	0	0	0,00
MYI	01.2023	5.192	54.607	51	0	51	0,02
SCX	01.2023	1.132	11.898	10	0	10	0,00
UAG	01.2023	8.909	93.471	65	0	65	0,03
				\$ 145	\$ (4)	\$ 141	0,06

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilsklasse Institutional SGD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2023	\$ 84	SGD 115	\$ 2	\$ 0	\$ 2	0,00
BPS	01.2023	84	115	2	0	2	0,00
GLM	01.2023	14	19	0	0	0	0,00
MBC	01.2023	88	121	2	0	2	0,00
UAG	01.2023	SGD 3	\$ 2	0	0	0	0,00
				\$ 6	\$ 0	\$ 6	0,00

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ 2.636 1,11

LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖGENS
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN			
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA			
3,000 % fällig am 01.02.2053	\$ 500	\$ (439)	(0,19)
3,500 % fällig am 01.01.2053	400	(364)	(0,15)
6,000 % fällig am 01.01.2053 (g)	1.800	(1.827)	(0,77)
Summe Leerverkaufte Wertpapiere		\$ (2.630)	(1,11)
Summe Anlagen		\$ 297.156	124,88
Sonstige Aktiva und Passiva		\$ (59.195)	(24,88)
Nettovermögen		\$ 237.961	100,00

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

- * Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt
- ^ Das Wertpapier ist in Verzug.
- (a) Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.
- (b) Nullkuponwertpapier.
- (c) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.
- (d) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.
- (e) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.
- (f) Bedingt wandelbares Wertpapier.
- (g) Zum 31. Dezember 2022 leerverkauftes Wertpapier ist durch Long-Portfolioanlagen in übertragbaren Wertpapieren und Geldmarktinstrumenten abgedeckt.

(h) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2021: 0,28 %):

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeitsdatum	Kaufdatum	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
Citigroup, Inc.	4,615 %	25.01.2026	19.07.2022	\$ 485	\$ 489	0,21
Deutsche Bank AG	3,035	28.05.2032	25.08.2021 - 02.09.2021	359	266	0,11
Standard Chartered PLC	3,603	12.01.2033	05.01.2022	200	151	0,06
				\$ 1.044	\$ 906	0,38

Barmittel in Höhe von 1.927 USD (31. Dezember 2021: 2.030 USD) wurden zum 31. Dezember 2022 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Wertpapier mit einem Gesamtmarktwert von 0 USD (31. Dezember 2021: 102 USD) und Barmittel in Höhe von 810 USD (31. Dezember 2021: 0 USD) wurden gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. zum 31. Dezember 2022 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 254.108	\$ 0	\$ 254.108
Pensionsgeschäfte	0	44.400	0	44.400
Finanzderivate ⁽³⁾	(9)	1.287	0	1.278
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(2.630)	0	(2.630)
Summen	\$ (9)	\$ 297.165	\$ 0	\$ 297.156

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

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 122.326	\$ 0	\$ 122.326
Finanzderivate	0	1.270	0	1.270
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(204)	0	(204)
Summen	\$ 0	\$ 123.392	\$ 0	\$ 123.392

⁽¹⁾ Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

⁽²⁾ Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

⁽³⁾ Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung des Marktwerts der außerbörslich gehandelten Finanzderivate und (erhaltenen)/verpfändeten Sicherheiten nach Kontrahenten zum 31. Dezember 2022 und 31. Dezember 2021:

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2022			Zum 31. Dez. 2021		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾
AZD	\$ 4	\$ 0	\$ 4	\$ k. A.	\$ k. A.	\$ k. A.
BOA	43	0	43	34	0	34
BPS	(571)	550	(21)	310	0	310
BRC	59	0	59	229	(140)	89
CBK	1.021	(950)	71	(9)	0	(9)
DUB	(9)	0	(9)	k. A.	k. A.	k. A.
GLM	3	260	263	(11)	0	(11)
HUS	k. A.	k. A.	k. A.	310	(330)	(20)
JPM	187	0	187	k. A.	k. A.	k. A.
MBC	660	(350)	310	k. A.	k. A.	k. A.
MYC	(69)	0	(69)	3	0	3
MYI	263	(20)	243	65	102	167
RYL	88	0	88	k. A.	k. A.	k. A.
SAL	(6)	0	(6)	(11)	0	(11)
SCX	799	(780)	19	279	0	279
SSB	k. A.	k. A.	k. A.	8	0	8
UAG	164	0	164	(46)	0	(46)

⁽¹⁾ Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Nettobeträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2022:

	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	36,58	42,95
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	69,50	52,99
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,71	1,85
Pensionsgeschäfte	18,66	k. A.
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,05	(0,06)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,62)	0,14
Freiverkehrsfinanzderivate	1,11	0,93
Leerverkaufte Wertpapiere	(1,11)	(0,16)

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2022 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
Kreditbeteiligungen und -abtretungen	0,52	k. A.
Unternehmensanleihen und Wechsel	34,38	50,66
US-Regierungsbehörden	29,05	4,26
US-Schatzobligationen	5,52	2,72
Non-Agency-MBS	12,90	11,55
Forderungsbesicherte Wertpapiere	6,03	4,24
Staatsemissionen	1,19	2,39
Kurzfristige Instrumente	17,20	21,97
Pensionsgeschäfte	18,66	k. A.
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,05	(0,06)
Verkaufsoptionen		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	0,00	k. A.
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf	(0,01)	(0,03)
Zinsswaps	(0,61)	0,17
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Zinsswapoptionen	0,08	k. A.
Verkaufsoptionen		
Devisenoptionen	k. A.	0,00
Zinsswapoptionen	(0,10)	(0,03)
Zinsscaps	(0,04)	k. A.
Optionen auf Wertpapiere	0,00	(0,01)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf	(0,02)	k. A.
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	(0,01)	k. A.
Zinsswaps	k. A.	0,01
Devisenterminkontrakte	(0,10)	0,10
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	1,30	0,86
Leerverkaufte Wertpapiere	(1,11)	(0,16)
Sonstige Aktiva und Passiva	(24,88)	1,36
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE											
KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNGEN											
Hilton Domestic Operating Co., Inc. 6,173 % fällig am 22.06.2026	\$	214	0,01	Fab Sukuk Co. Ltd. 3,625 % fällig am 05.03.2023	\$	1.500	0,07	3,500 % fällig am 01.10.2053	DKK	38.735	0,25
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL											
BANKEN UND FINANZEN											
AMCO - Asset Management Co. SpA 1,500 % fällig am 17.07.2023	€	9.000	0,47	Federation des Caisses Desjardins du Quebec 2,875 % fällig am 28.11.2024	€	3.400	0,18	5,000 % fällig am 01.10.2053		24.130	0,17
Banca Carige SpA 0,625 % fällig am 28.10.2029		6.600	0,29	Ford Motor Credit Co. LLC 1,744 % fällig am 19.07.2024		3.500	0,17	Realkredit Danmark A/S 1,500 % fällig am 01.10.2047		66	0,00
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. 5,875 % fällig am 24.09.2023 (e)(g)		1.200	0,06	2,748 % fällig am 14.06.2024	£	6.500	0,36	1,500 % fällig am 01.10.2053		96.205	0,49
Banco Santander S.A. 4,375 % fällig am 14.01.2026 (e)(g)		5.200	0,23	General Motors Financial Co., Inc. 1,000 % fällig am 24.02.2025	€	3.400	0,17	2,000 % fällig am 01.10.2047		0	0,00
Bank of America Corp. 2,243 % fällig am 25.04.2024		900	0,05	Goldman Sachs Group, Inc. 2,605 % fällig am 30.04.2024		14.100	0,74	2,000 % fällig am 01.10.2050		14.939	0,09
Barclays PLC 2,895 % fällig am 31.01.2027	€	4.000	0,20	2,732 % fällig am 07.02.2025		7.300	0,38	2,500 % fällig am 01.04.2036		1	0,00
3,125 % fällig am 17.01.2024	£	8.700	0,50	5,702 % fällig am 15.03.2024	\$	1.700	0,08	Royal Bank of Canada 4,784 % fällig am 12.12.2025	\$	6.500	0,32
4,375 % fällig am 15.03.2028 (e)(g)	\$	200	0,01	HSBC Holdings PLC 6,250 % fällig am 23.03.2023 (e)(g)		2.400	0,11	Santander UK Group Holdings PLC 4,750 % fällig am 15.09.2025		600	0,03
7,750 % fällig am 15.09.2023 (e)(g)		700	0,03	6,500 % fällig am 20.05.2024	£	1.800	0,11	Societe Generale S.A. 1,250 % fällig am 15.02.2024	€	7.300	0,37
BNP Paribas S.A. 4,500 % fällig am 25.02.2030 (e)(g)		200	0,01	ING Groep NV 3,875 % fällig am 16.05.2027 (e)(g)	\$	200	0,01	Toronto-Dominion Bank 1,707 % fällig am 28.07.2025		5.100	0,26
CaixaBank S.A. 3,625 % fällig am 14.09.2028 (e)(g)	€	200	0,01	4,875 % fällig am 16.05.2029 (e)(g)		8.200	0,31	TP ICAP Finance PLC 5,250 % fällig am 26.01.2024	£	4.039	0,23
6,750 % fällig am 13.06.2024 (e)(g)		2.000	0,10	Intesa Sanpaolo SpA 5,500 % fällig am 01.03.2028 (e)(g)	€	250	0,01	UBS Group AG 1,250 % fällig am 17.04.2025	€	1.600	0,08
Citigroup, Inc. 4,412 % fällig am 31.03.2031	\$	8.100	0,36	JAB Holdings BV 2,000 % fällig am 18.05.2028		5.100	0,24	UniCredit SpA 1,625 % fällig am 03.07.2025		7.700	0,39
Cooperative Rabobank UA 3,250 % fällig am 29.12.2026 (e)(g)	€	1.400	0,06	Jyske Realkredit A/S 0,375 % fällig am 01.07.2024		800	0,04	3,127 % fällig am 03.06.2032	\$	4.400	0,16
4,625 % fällig am 29.12.2025 (e)(g)		3.800	0,18	1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK	15	0,00	7,830 % fällig am 04.12.2023		3.400	0,17
CPI Property Group S.A. 1,500 % fällig am 27.01.2031		6.500	0,20	1,500 % fällig am 01.10.2037		0	0,00	Vonovia Finance BV 5,000 % fällig am 02.10.2023		500	0,02
1,625 % fällig am 23.04.2027		700	0,03	1,500 % fällig am 01.10.2050		23	0,00			436.993	22,84
2,750 % fällig am 12.05.2026		8.000	0,33	2,000 % fällig am 01.10.2047		0	0,00	INDUSTRIEWERTE			
2,750 % fällig am 22.01.2028	£	4.500	0,18	2,000 % fällig am 01.10.2050		0	0,00	Atlantia SpA 1,875 % fällig am 12.02.2028	€	10.150	0,44
Credit Suisse AG 1,000 % fällig am 07.06.2023	€	1.300	0,07	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0,000 % fällig am 15.09.2028 (b) €		6.500	0,29	Bacardi Ltd. 2,750 % fällig am 03.07.2023		1.000	0,05
3,184 % fällig am 31.05.2024		6.800	0,34	0,000 % fällig am 15.06.2029 (b)		11.100	0,48	Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide 1,625 % fällig am 09.07.2024		6.000	0,30
6,500 % fällig am 08.08.2023 (g)	\$	2.600	0,12	0,000 % fällig am 15.09.2031 (b)		17.900	0,72	GN Store Nord A/S 0,875 % fällig am 25.11.2024		3.300	0,16
Credit Suisse Group AG 3,250 % fällig am 02.04.2026	€	6.000	0,28	2,000 % fällig am 15.11.2029		17.100	0,84	Holding d'Infrastructures de Transport SASU 1,475 % fällig am 18.01.2031		4.900	0,20
4,194 % fällig am 01.04.2031	\$	2.500	0,09	5,000 % fällig am 19.03.2024	AUD	200	0,01	Informa PLC 1,500 % fällig am 05.07.2023		1.476	0,08
7,250 % fällig am 12.09.2025 (e)(g)		7.300	0,26	Landesbank Baden-Wuerttemberg 2,000 % fällig am 24.02.2025	\$	3.300	0,15	Market Bidco Finco PLC 4,750 % fällig am 04.11.2027		4.600	0,20
7,500 % fällig am 17.07.2023 (e)(g)		2.200	0,09	LeasePlan Corp. NV 1,000 % fällig am 02.05.2023	€	1.100	0,06	Molnycke Holding AB 1,750 % fällig am 28.02.2024		400	0,02
Credit Suisse Schweiz AG 3,390 % fällig am 05.12.2025	€	7.700	0,40	1,375 % fällig am 07.03.2024		6.100	0,31	1,875 % fällig am 28.02.2025		400	0,02
CTP NV 0,500 % fällig am 21.06.2025		3.200	0,14	Liberty Mutual Group, Inc. 3,625 % fällig am 23.05.2059		10.700	0,49	Nissan Motor Co. Ltd. 1,940 % fällig am 15.09.2023		4.400	0,23
Deutsche Bank AG 1,375 % fällig am 03.09.2026		7.400	0,35	Lloyds Bank PLC 4,875 % fällig am 30.03.2027	£	4.000	0,24	Oracle Corp. 3,600 % fällig am 01.04.2040	\$	2.800	0,10
1,625 % fällig am 20.01.2027		3.000	0,14	Metropolitan Life Global Funding 0,900 % fällig am 08.06.2023	\$	3.400	0,16	3,600 % fällig am 01.04.2050		3.000	0,10
2,222 % fällig am 18.09.2024	\$	1.900	0,09	Nexi SpA 1,625 % fällig am 30.04.2026	€	3.797	0,18	3,850 % fällig am 01.04.2060		1.200	0,04
4,000 % fällig am 29.11.2027	€	3.000	0,15	Nordea Kredit Realkreditaktieselskab 1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK	58.456	0,29	Owens Corning 4,300 % fällig am 15.07.2047		622	0,02
4,500 % fällig am 30.11.2026 (e)(g)		200	0,01	1,000 % fällig am 01.10.2053		12.669	0,06	Teleperformance 1,875 % fällig am 02.07.2025	€	200	0,01
Dexia Credit Local S.A. 0,000 % fällig am 21.01.2028 (b)		4.300	0,19	1,500 % fällig am 01.10.2050		0	0,00	Ubisoft Entertainment S.A. 0,878 % fällig am 24.11.2027		2.300	0,09
0,010 % fällig am 22.01.2027		6.700	0,31	2,000 % fällig am 01.10.2047		0	0,00	1,289 % fällig am 30.01.2023		4.400	0,23
0,500 % fällig am 17.01.2025		3.500	0,17	2,000 % fällig am 01.10.2050		8.287	0,05			43.772	2,29
DVI Deutsche Vermögens- & Immobilienverwaltungs GmbH 2,500 % fällig am 25.01.2027		6.500	0,25	Nova Kreditna Banka Maribor d.d. 1,875 % fällig am 27.01.2025	€	5.200	0,25	VERSORGUNGSUNTERNEHMEN			
Eurofima Europaeische Gesellschaft fuer die Finanzierung von Eisenbahnmaterial 0,010 % fällig am 23.06.2028		10.500	0,46	Nova Ljubljanska Banka dd 10,750 % fällig am 28.11.2032		5.700	0,30	Electricite de France S.A. 2,625 % fällig am 01.12.2027 (e)		6.600	0,27
Europäische Investitionsbank 0,250 % fällig am 20.01.2032		4.200	0,17	Nykredit Realkredit A/S 0,500 % fällig am 01.10.2043	DKK	8.892	0,05	2,875 % fällig am 15.12.2026 (e)		12.800	0,55
European Union 0,000 % fällig am 06.07.2026 (b)		1.100	0,05	1,000 % fällig am 01.10.2050		393.131	1,93	Verizon Communications, Inc. 3,875 % fällig am 08.02.2029	\$	2.000	0,09
0,000 % fällig am 04.07.2029 (b)		1.000	0,04	1,000 % fällig am 01.10.2053		24	0,00			17.456	0,91
0,000 % fällig am 04.07.2031 (b)		4.200	0,17	1,500 % fällig am 01.10.2037		0	0,00	Summe Unternehmensanleihen und Wechsel		498.221	26,04
0,250 % fällig am 22.04.2036		23.000	0,82	1,500 % fällig am 01.10.2047		4	0,00	US-REGIERUNGSBEHÖRDEN			
0,450 % fällig am 04.07.2041		8.600	0,27	1,500 % fällig am 01.10.2050		0	0,00	Fannie Mae 3,821 % fällig am 25.07.2037		5	0,00
0,450 % fällig am 02.05.2046		930	0,03	1,500 % fällig am 01.10.2053		80.031	0,41	4,789 % fällig am 25.06.2036		33	0,00
0,700 % fällig am 06.07.2051		1.000	0,03	2,000 % fällig am 01.10.2047		0	0,00				
0,750 % fällig am 04.01.2047		7.700	0,24	2,000 % fällig am 01.10.2050		57.440	0,33				
				2,000 % fällig am 01.10.2053		5.665	0,03				
				2,500 % fällig am 01.10.2036		363	0,00				
				2,500 % fällig am 01.10.2047		28	0,00				
				3,000 % fällig am 01.10.2053		4.655	0,03				

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
2,028 % fällig am 15.10.2031	€ 4.598	€ 4.473	0,23	Morgan Stanley Home Equity Loan Trust				5,250 % fällig am 18.02.2024	\$ 21.451	20.096	1,05
2,028 % fällig am 15.10.2031	2.000	1.926	0,10	25.12.2036	2.836	1.349	0,07	South Korea Government International Bond			
BNPP AM Euro CLO DAC				Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust				0,000 % fällig am 16.09.2025 (b)	€ 4.400	€ 4.012	0,21
2,028 % fällig am 15.10.2031	1.036	1.015	0,05	4,539 % fällig am 25.07.2036	\$ 536	€ 452	0,02	Spain Government International Bond			
Bridgepoint CLO DAC				5,004 % fällig am 25.02.2036	5	4	0,00	0,000 % fällig am 31.01.2026 (b)	8.400	71.462	3,74
2,588 % fällig am 15.01.2034	1.600	1.566	0,08	NovaStar Mortgage Funding Trust				0,100 % fällig am 30.04.2031	3.600	2.742	0,14
Bumper UK Finance PLC				4,589 % fällig am 25.09.2037	506	458	0,02	1,400 % fällig am 30.07.2028	19.200	17.454	0,91
3,900 % fällig am 20.12.2030	£ 2.952	3.325	0,17	5,094 % fällig am 25.01.2036	139	128	0,01	1,450 % fällig am 31.10.2027	23.300	21.555	1,13
Cairn CLO DAC				OCF Euro CLO DAC				1,900 % fällig am 31.10.2052	19.200	12.233	0,64
2,253 % fällig am 25.04.2032	€ 1.400	1.365	0,07	2,198 % fällig am 15.01.2032	€ 4.100	4.025	0,21	1,950 % fällig am 30.04.2026	4.600	4.446	0,23
2,275 % fällig am 31.01.2030	4.821	4.726	0,25	2,382 % fällig am 22.09.2034	5.600	5.443	0,28	2,550 % fällig am 31.10.2032	7.400	6.751	0,35
2,333 % fällig am 25.07.2029	2.037	2.020	0,11	2,098 % fällig am 15.10.2031	7.334	7.112	0,37	3,450 % fällig am 30.07.2043	9.100	8.390	0,44
2,688 % fällig am 20.10.2028	145	142	0,01	Palmer Square European Loan Funding DAC				3,450 % fällig am 30.07.2066	9.400	8.314	0,44
Carlyle Euro CLO DAC				PBD Germany Auto Lease Master S.A., Compartment					386.108	20.18	
2,428 % fällig am 15.08.2030	7.423	7.246	0,38	2,594 % fällig am 26.11.2030	3.167	3.168	0,17				
Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC				Purple Master Credit Cards							
2,273 % fällig am 25.01.2032	4.998	4.894	0,26	2,594 % fällig am 25.05.2034	6.300	6.301	0,33				
Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd.				Sculptor European CLO DAC							
2,548 % fällig am 15.11.2031	4.600	4.458	0,23	2,153 % fällig am 14.01.2032	4.600	4.477	0,23				
Citizen Irish Auto Receivables Trust DAC				Silver Arrow Merfina SRL							
2,506 % fällig am 15.12.2029	3.307	3.303	0,17	2,448 % fällig am 20.07.2033	4.490	4.489	0,24				
Compartment VCL				Silver Arrow S.A.							
2,497 % fällig am 21.01.2028	2.746	2.754	0,14	2,386 % fällig am 15.02.2027	595	596	0,03				
Contego CLO BV				SLC Student Loan Trust							
2,148 % fällig am 15.10.2030	3.748	3.664	0,19	5,574 % fällig am 25.11.2042	\$ 781	726	0,04				
Contego CLO DAC				SLM Student Loan Trust							
2,142 % fällig am 23.01.2030	4.592	4.475	0,23	1,943 % fällig am 25.10.2039	€ 475	450	0,02				
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust				Soundview Home Loan Trust							
4,486 % fällig am 25.07.2036	\$ 69	61	0,00	4,889 % fällig am 25.10.2036	\$ 5.173	4.597	0,24				
4,529 % fällig am 25.06.2035	4.223	3.575	0,19	Tikehau CLO DAC							
4,609 % fällig am 25.06.2047	3.311	2.958	0,16	2,596 % fällig am 04.08.2034	€ 4.000	3.883	0,20				
4,649 % fällig am 25.11.2037	2.048	1.694	0,09	Toro European CLO DAC							
5,229 % fällig am 25.10.2047	1.202	1.086	0,06	2,239 % fällig am 12.01.2032	3.900	3.757	0,20				
CVC Cordatus Loan Fund DAC				Turbo Finance PLC							
2,028 % fällig am 15.10.2031	€ 3.400	3.302	0,17	4,230 % fällig am 20.08.2028	£ 1.847	2.082	0,11				
2,578 % fällig am 15.08.2032	3.300	3.217	0,17	Voya Euro CLO DAC							
Ellington Loan Acquisition Trust				2,128 % fällig am 15.10.2030	€ 3.199	3.131	0,16				
5,439 % fällig am 25.05.2037	\$ 2.843	2.530	0,13			237.301	12,40				
FACT Master S.A.											
2,248 % fällig am 20.11.2025	€ 143	143	0,01								
FCT Pulse France											
2,198 % fällig am 25.01.2035	2.900	2.903	0,15								
First Franklin Mortgage Loan Trust											
4,549 % fällig am 25.11.2036	\$ 154	141	0,01								
Grosvenor Place CLO BV											
2,325 % fällig am 30.10.2029	€ 1.578	1.561	0,08								
Harvest CLO DAC											
2,018 % fällig am 15.10.2031	5.600	5.443	0,29								
2,136 % fällig am 20.10.2031	4.300	4.176	0,22								
2,138 % fällig am 15.07.2031	5.400	5.215	0,27								
2,228 % fällig am 15.01.2032	8.300	8.042	0,42								
2,433 % fällig am 18.11.2029	443	437	0,02								
Invesco Euro CLO DAC											
2,028 % fällig am 15.07.2031	1.550	1.506	0,08								
JPMorgan Mortgage Acquisition Trust											
4,659 % fällig am 25.07.2036	\$ 78	60	0,00								
Jubilee CLO DAC											
2,128 % fällig am 12.07.2028	€ 206	205	0,01								
2,846 % fällig am 15.12.2029	4.920	4.828	0,25								
Laurelin DAC											
2,176 % fällig am 20.10.2031	6.000	5.817	0,30								
Lehman XS Trust											
6,500 % fällig am 25.06.2046	\$ 2.406	1.829	0,10								
Long Beach Mortgage Loan Trust											
4,689 % fällig am 25.05.2036	2.109	1.150	0,06								
4,689 % fällig am 25.06.2036	4.846	2.261	0,12								
Man GLG Euro CLO DAC											
2,058 % fällig am 15.10.2030	€ 2.910	2.843	0,15								
2,188 % fällig am 15.10.2032	4.298	4.158	0,22								
2,248 % fällig am 15.01.2030	6.517	6.372	0,33								
MASTR Asset-Backed Securities Trust											
4,539 % fällig am 25.10.2036	\$ 3.049	937	0,05								
Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust											
4,639 % fällig am 25.07.2036	353	280	0,02								

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Euro Bond Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
(0,160) % fällig am 30.01.2023 (b)(c)	¥ 4.033.500	€ 28.647	1,50	INVESTMENTFONDS			
(0,149) % fällig am 30.01.2023 (b)(c)	1.846.500	13.114	0,68	BÖRSENGEHANDELTE FONDS			
(0,117) % fällig am 20.02.2023 (b)(c)	7.240.000	51.426	2,69	PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (f)	1.908.200	€ 181.654	9,49
				Summe Investmentfonds		€ 181.654	9,49
		151.038	7,89				
Summe kurzfristige Instrumente		246.265	12,87				
Summe Übertragbare Wertpapiere	€ 1.747.790		91,35				

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kapital- betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions- geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions- geschäft ⁽¹⁾	% des Nettovermögens
BPS	(1,000) %	30.12.2022	02.01.2023	€ 10.900	BNG Bank NV 0,125 % fällig am 19.04.2033	€ (11.063)	€ 10.900	€ 10.899	0,57
FICC	1,900	30.12.2022	03.01.2023	\$ 656	U.S. Treasury Notes 0,125 % fällig am 15.05.2023	(627)	615	615	0,03
Summe Pensionsgeschäfte						€ (11.690)	€ 11.515	€ 11.514	0,60

⁽¹⁾ Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
3-Month Euribor March Futures	Long	03.2023	1.046	€ (8.316)	(0,43)
Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 146,000 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond February 2023 Futures ⁽¹⁾	Short	01.2023	45	34	0,00
Euro-Bobl March Futures	Long	03.2023	3.137	(10.666)	(0,56)
Euro-BTP Italy Government Bond March Futures	Long	03.2023	516	(4.170)	(0,22)
Euro-Bund 10-Year Bond March Futures	Short	03.2023	2.316	15.823	0,83
Euro-Buxl 30-Year Bond March Futures	Long	03.2023	329	(8.442)	(0,44)
Euro-OAT France Government 10-Year Bond March Futures	Long	03.2023	1.595	(15.352)	(0,80)
Euro-Schatz March Futures	Long	03.2023	2.331	(3.260)	(0,17)
Japan Government 10-Year Bond March Futures	Short	03.2023	5	98	0,01
Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 138,500 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond February 2023 Futures ⁽¹⁾	Short	01.2023	45	(216)	(0,01)
U.S. Treasury 2-Year Note March Futures	Short	03.2023	129	(33)	0,00
U.S. Treasury 5-Year Note March Futures	Short	03.2023	242	229	0,01
U.S. Treasury 10-Year Note March Futures	Long	03.2023	1.115	(906)	(0,05)
U.S. Treasury 30-Year Bond March Futures	Long	03.2023	135	(143)	(0,01)
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond March Futures	Short	03.2023	1.715	2.377	0,12
United Kingdom Long Gilt March Futures	Short	03.2023	70	515	0,03
				€ (32.428)	(1,69)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				€ (32.428)	(1,69)

⁽¹⁾ Future-Style-Option.

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
British Telecommunications PLC	1,000 %	20.12.2027	€ 100	€ (2)	0,00

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF⁽²⁾

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽³⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.HY-38 5-Year Index	(5,000) %	20.06.2027	\$ 22.671	€ (228)	(0,01)
iTraxx Crossover 37 5-Year Index	(5,000)	20.06.2027	€ 49.600	(2.265)	(0,12)
				€ (2.493)	(0,13)

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung ⁽⁴⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	2,000 %	15.03.2053	£ 1.000	€ 10	0,00
Zahlung ⁽⁴⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	2,250	15.03.2028	27.700	(802)	(0,04)
Zahlung	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,500	12.12.2027	20.600	(198)	(0,01)
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000	16.06.2029	¥ 7.571.000	954	0,05
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,435	20.06.2029	2.729.000	290	0,02
Zahlung	3-Month EUR-EURIBOR	0,526	21.11.2023	€ 124.100	(4.239)	(0,22)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,880	25.01.2052	\$ 11.900	(3.244)	(0,17)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,000	08.11.2032	€ 20.310	(5.103)	(0,27)
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,195	04.11.2052	11.660	5.508	0,29
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,197	08.11.2052	6.760	2.769	0,15
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,550	10.08.2024	5.200	(209)	(0,01)
Erhalt ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	1,500	15.03.2025	105.800	2.152	0,11
Zahlung ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	1,500	15.03.2028	177.000	(7.967)	(0,42)
Erhalt ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	1,500	15.03.2053	26.800	1.914	0,10
Zahlung ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	1,750	15.03.2033	245.900	(7.126)	(0,37)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,800	27.10.2032	16.000	(1.542)	(0,08)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,960	27.10.2032	17.100	(1.384)	(0,07)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,250	21.09.2037	46.800	(2.581)	(0,13)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,250	21.09.2042	21.400	(1.289)	(0,07)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,500	12.12.2032	20.600	(687)	(0,04)
Zahlung	CPTFEMU	1,380	15.03.2031	28.500	(5.539)	(0,29)
Erhalt	CPTFEMU	2,359	15.08.2030	2.800	78	0,00
Zahlung	CPTFEMU	2,421	15.05.2052	990	(108)	(0,01)
Erhalt	CPTFEMU	2,470	15.07.2032	2.300	82	0,00
Zahlung	CPTFEMU	2,488	15.05.2037	6.880	(383)	(0,02)
Erhalt	CPTFEMU	2,600	15.05.2032	4.500	153	0,01
Erhalt	CPTFEMU	2,720	15.06.2032	6.600	103	0,01
Erhalt	CPTFEMU	2,975	15.08.2027	6.700	48	0,00
Erhalt	CPTFEMU	3,340	15.08.2027	25.900	(182)	(0,01)
Erhalt	CPURNSA	3,479	18.07.2023	\$ 26.800	44	0,00
					€ (28.478)	(1,49)
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					€ (30.973)	(1,62)

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

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

(3) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definieren.

(4) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

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

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

OPTIONSKAUF

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variable Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
BPS	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,000 %	15.03.2023	10.600	€990	€5.381	0,28
BRC	Call – OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,410	02.02.2023	133.600	592	0	0,00
CBK	Call – OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,720	23.02.2023	27.600	134	0	0,00
GLM	Call – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,200	26.04.2023	22.500	228	13	0,00
JPM	Call – OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,710	25.01.2023	29.400	158	0	0,00
MYC	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,000	15.03.2023	8.500	773	4.315	0,23
	Call – OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,428	31.01.2023	133.200	607	0	0,00
	Call – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,200	31.05.2023	63.600	724	71	0,00
							€ 4.206	€ 9.780	0,51

VERKAUFSOPTIONEN

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variable Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
BPS	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,175 %	15.03.2023	31.800	€ (967)	€ (9.157)	(0,48)
BRC	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,558	02.02.2023	29.200	(591)	0	0,00
CBK	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,736	23.02.2023	6.100	(133)	0	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Euro Bond Fund (Forts.)

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
GLM	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Erhalt	4,290 %	17.01.2023	12.500	€ (536)	€ (648)	(0,03)
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Zahlung	4,290	17.01.2023	12.500	(536)	(28)	0,00
	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,350	26.04.2023	12.400	(232)	(20)	0,00
	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,547	07.03.2023	6.700	(140)	(14)	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,547	07.03.2023	6.700	(140)	(395)	(0,02)
GST	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,067	09.06.2023	7.700	(87)	(18)	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	3,140	09.06.2023	7.700	(100)	(236)	(0,01)
	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,950	05.01.2023	26.200	(689)	(7)	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,950	05.01.2023	26.200	(689)	(556)	(0,03)
	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	3,230	18.01.2023	16.000	(437)	(169)	(0,01)
JPM	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	3,230	18.01.2023	16.000	(437)	(128)	(0,01)
	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Erhalt	4,670	10.01.2023	12.700	(520)	(1.075)	(0,06)
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Zahlung	4,670	10.01.2023	12.700	(520)	(2)	0,00
	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,785	25.01.2023	6.500	(159)	0	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,175	15.03.2023	25.500	(760)	(7.343)	(0,38)
MYC	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,579	31.01.2023	29.100	(607)	0	0,00
	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,350	31.05.2023	35.000	(723)	(97)	(0,01)
							€ (9.003)	€ (19.893)	(1,04)

⁽¹⁾ Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Kontrahent	Referenzzeit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag ⁽²⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
GST	South Africa Government International Bond	1,000 %	20.12.2023	\$ 200	€ (8)	€ 8	€ 0	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.06.2024	16.800	(655)	626	(29)	0,00
					€ (663)	€ 634	€ (29)	0,00

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

⁽²⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definieren.

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2023	\$ 9.442	€ 8.932	€ 89	€ 0	€ 89	0,00
	02.2023	€ 7.120	£ 6.164	0	(185)	(185)	(0,01)
	02.2023	£ 1.350	€ 1.526	7	0	7	0,00
BPS	02.2023	¥ 264.800	€ 1.838	0	(47)	(47)	0,00
	02.2023	IDR 410.179	\$ 26	0	0	0	0,00
BRC	01.2023	\$ 1.283	CNH 8.943	11	0	11	0,00
	01.2023	€ 11.213	€ 10.751	249	0	249	0,01
CBK	02.2023	€ 1.965	£ 1.709	0	(43)	(43)	0,00
	03.2023	¥ 5.750.000	€ 40.147	0	(889)	(889)	(0,05)
	01.2023	DKK 622.337	€ 83.703	11	0	11	0,00
	01.2023	€ 1.854	\$ 1.974	0	(5)	(5)	0,00
	01.2023	ILS 16.894	€ 5.359	535	0	535	0,03
GLM	01.2023	\$ 16.518	€ 15.691	221	0	221	0,01
	02.2023	€ 7.393	£ 6.531	0	(45)	(45)	0,00
	03.2023	\$ 463	MXN 9.083	0	(3)	(3)	0,00
	01.2023	€ 1.334	CNH 9.283	8	0	8	0,00
	01.2023	€ 2.444	DKK 18.170	0	0	0	0,00
JPM	01.2023	¥ 273.000	€ 1.908	0	(31)	(31)	0,00
	01.2023	\$ 4.139	€ 3.904	27	0	27	0,00
	02.2023	AUD 170	€ 110	2	0	2	0,00
	02.2023	€ 1.813	£ 1.563	0	(54)	(54)	0,00
	02.2023	IDR 708.482	\$ 45	0	(1)	(1)	0,00
MBC	03.2023	€ 758.490	€ 48	0	(1)	(1)	0,00
	01.2023	€ 995	DKK 7.400	0	0	0	0,00
	01.2023	€ 3.822	\$ 4.034	0	(44)	(44)	0,00
	01.2023	¥ 5.880.000	€ 40.246	0	(1.576)	(1.576)	(0,08)
	01.2023	\$ 161.461	€ 154.007	2.787	0	2.787	0,15
MYI	02.2023	AUD 54	€ 35	1	0	1	0,00
	02.2023	¥ 7.240.000	€ 50.401	0	(1.169)	(1.169)	(0,06)
	03.2023	IDR 460.358	\$ 29	0	0	0	0,00
	05.2023	CNH 19.033	€ 2.836	54	0	54	0,00
	01.2023	€ 5	CHF 4	0	0	0	0,00
RBC	01.2023	€ 6.928	\$ 7.284	0	(105)	(105)	(0,01)
	01.2023	\$ 4.519	€ 4.297	64	0	64	0,00
	02.2023	€ 1.550	¥ 217.077	6	(10)	(4)	0,00
	03.2023	IDR 648.633	\$ 41	0	(1)	(1)	0,00
	02.2023	€ 2.222	£ 1.949	0	(29)	(29)	0,00
04.2023	MXN 310	\$ 15	0	(1)	(1)	0,00	

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
RYL	01.2023	¥	2.121.000	€	14.855	€	0
	02.2023	£	848		980	€	(224)
SCX	01.2023	KRW	173.486	\$	131		0
	02.2023	€	1.063	£	933		(6)
	02.2023	IDR	745.478	\$	47		(14)
SSB	02.2023	£	192.475	€	219.304		(1)
UAG	02.2023	IDR	1.106.392	\$	70		0
	03.2023	¥	9.060.528	€	63.614		2.746
							0
							(2)
							(960)
							(960)
							(0,05)
							€
							6.844
							€
							(5.446)
							€
							1.398
							0,07

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilsklasse Institutional CHF (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CBK	01.2023	€	109.727	CHF	108.039	€	0
MBC	01.2023		109.729		108.039	€	(288)
RBC	01.2023	CHF	4	€	5		(289)
	01.2023	€	345	CHF	340		0
RYL	01.2023		143		141		0
SCX	01.2023		109.764		108.071		0
							(292)
							(292)
							(0,02)
							€
							0
							€
							(869)
							€
							(869)
							(0,04)
							€
							(9.613)
							(0,50)
							€
							1.867.945
							97,63
							€
							45.330
							2,37
							€
							1.913.275
							100,00

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

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

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.

(b) Nullkuponwertpapier.

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

(d) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

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

(f) Mit dem Fonds verbunden.

(g) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(h) Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von 4.360 EUR (31. Dezember 2021: 8.559 EUR) und Barmittel in Höhe von 5.628 EUR (31. Dezember 2021: 3.399 EUR) wurden gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. zum 31. Dezember 2022 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 53.376 EUR (31. Dezember 2021: 26.110 EUR) wurden zum 31. Dezember 2022 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	€	0	€	1.747.790
Investmentfonds		180.784		870
Pensionsgeschäfte		0		11.515
Finanzderivate ⁽³⁾		(33.951)		(39.063)
Summen	€	146.833	€	1.721.112
			€	0
			€	1.867.945

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

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	€	0	€	2.354.423
Investmentfonds		0		167.438
Pensionsgeschäfte		0		24.716
Finanzderivate ⁽³⁾		(10.991)		(22.207)
Summen	€	(10.991)	€	2.524.370
			€	0
			€	2.513.379

- (1) Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.
 (2) Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.
 (3) Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung des Marktwerts der außerbörslich gehandelten Finanzderivate und (erhaltenen)/verpfändeten Sicherheiten nach Kontrahenten zum 31. Dezember 2022 und 31. Dezember 2021:

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2022			Zum 31. Dez. 2021		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Nettoengagement ⁽¹⁾	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Nettoengagement ⁽¹⁾
BOA	€ (136)	€ 0	€ (136)	€ (72)	€ 0	€ (72)
BPS	(3.776)	1.243	(2.533)	(905)	830	(75)
BRC	(672)	250	(422)	(60)	90	30
CBK	(250)	0	(250)	(1.771)	1.973	202
DUB	k. A.	k. A.	k. A.	134	0	134
GLM	(662)	553	(109)	597	(550)	47
GSC	k. A.	k. A.	k. A.	(22)	0	(22)
GST	(1.966)	1.883	(83)	(56)	59	3
HUS	k. A.	k. A.	k. A.	(270)	459	189
JPM	(3.086)	3.064	(22)	(403)	330	(73)
MCB	(236)	(390)	(626)	k. A.	k. A.	k. A.
MYC	(26)	70	44	(247)	(1.100)	(1.347)
MYI	(46)	37	(9)	(1.867)	1.091	(776)
RBC	(30)	0	(30)	426	1.091	346
RYL	(198)	30	(168)	(6.655)	6.956	301
SCX	(313)	373	60	2.937	(2.310)	627
SSB	2.746	(1.770)	976	k. A.	k. A.	k. A.
UAG	(962)	(4.040)	(5.002)	k. A.	k. A.	k. A.

⁽¹⁾ Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Nettobeträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2022:

	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	71,54	87,11
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	19,58	4,14
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,23	0,22
Investmentfonds	9,49	6,50
Pensionsgeschäfte	0,60	0,96
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(1,69)	(0,46)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(1,62)	(0,51)
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,50)	(0,32)

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2022 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
Kreditbeteiligungen und -abtretungen	0,01	0,01
Unternehmensanleihen und Wechsel	26,04	35,59
US-Regierungsbehörden	5,29	0,30
US-Schatzobligationen	2,26	3,32
Non-Agency-MBS	12,23	10,40
Forderungsbesicherte Wertpapiere	12,40	11,76
Staatsemissionen	20,18	26,92
Vorzugswertpapiere	0,07	0,08
Kurzfristige Instrumente	12,87	3,09
Investmentfonds	9,49	6,50
Pensionsgeschäfte	0,60	0,96
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(1,69)	(0,46)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf	0,00	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	(0,13)	k. A.
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	k. A.	0,00
Zinsswaps	(1,49)	(0,51)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Zinsswapoptionen	0,51	0,35
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes	k. A.	0,00
Devisenoptionen	k. A.	(0,01)
Zinsswapoptionen	(1,04)	(0,68)
Optionen auf Wertpapiere	k. A.	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf	0,00	0,00
Devisenterminkontrakte	0,07	(0,02)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	(0,04)	0,04
Sonstige Aktiva und Passiva	2,37	2,36
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE											
KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNGEN											
Charter Communications Operating LLC				Credit Agricole S.A.				Mizuho Financial Group, Inc.			
6,140 % fällig am 01.02.2027	\$	3.300	€3.024	1,907 % fällig am 16.06.2026	\$	2.600	€2.223	3,490 % fällig am 05.09.2027	€	5.300	€5.166
Hilton Domestic Operating Co., Inc.			0,49	Credit Suisse Group AG			1,02	MPT Operating Partnership LP			0,06
6,173 % fällig am 22.06.2026		3.240	3.030	1,250 % fällig am 17.07.2025	€	6.900	6.203	0,993 % fällig am 15.10.2026		500	383
INEOS Finance PLC			0,50	3,869 % fällig am 12.01.2029	\$	2.100	1.580	Nationwide Building Society			1,55
3,898 % fällig am 01.04.2024	€	2.237	2.233	4,194 % fällig am 01.04.2031		400	292	4,363 % fällig am 01.08.2024	\$	10.200	9.434
			0,37	4,282 % fällig am 09.01.2028		6.000	4.668	NatWest Group PLC			0,67
			1,36	Cromwell Ereit Lux Finco SARL			0,40	1,750 % fällig am 02.03.2026	€	4.339	4.086
		8.287		2,125 % fällig am 19.11.2025	€	3.000	2.426	2,000 % fällig am 04.03.2025		4.900	4.781
				CTP NV				NE Property BV			0,78
				0,625 % fällig am 27.09.2026		600	462	1,875 % fällig am 09.10.2026		200	168
				0,875 % fällig am 27.10.2026		3.100	2.527	3,375 % fällig am 14.07.2027		4.400	3.818
				Dell Bank International DAC			0,23	Nordea Bank Abp			0,04
				0,500 % fällig am 27.10.2026		1.600	1.387	1,125 % fällig am 16.02.2027		300	272
				Deutsche Bank AG				Nordea Kredit Realkreditaktieselskab			
				0,750 % fällig am 17.02.2027		3.200	2.794	0,500 % fällig am 01.10.2043	DKK	0	0
				1,375 % fällig am 03.09.2026		2.100	1.916	1,000 % fällig am 01.10.2050		105.202	9.995
				1,625 % fällig am 20.01.2027		3.900	3.445	1,000 % fällig am 01.10.2053		0	0
				1,750 % fällig am 17.01.2028		2.700	2.312	1,500 % fällig am 01.10.2037		150	17
				2,129 % fällig am 24.11.2026 (e)	\$	400	331	1,500 % fällig am 01.10.2050		0	0
				2,552 % fällig am 07.01.2028		200	160	2,500 % fällig am 01.10.2047		0	0
				2,625 % fällig am 12.02.2026	€	2.000	1.890	Nykredit Realkredit A/S			
				Digital Euro Finco LLC				0,250 % fällig am 13.01.2026	€	4.900	4.327
				2,625 % fällig am 15.04.2024		2.100	2.040	0,375 % fällig am 17.01.2028		1.200	969
				EQT AB				0,500 % fällig am 01.10.2043	DKK	0	0
				2,375 % fällig am 06.04.2028		700	616	1,000 % fällig am 01.10.2050		74.797	7.414
				Equitable Financial Life Global Funding				1,000 % fällig am 01.10.2053		0	0
				0,600 % fällig am 16.06.2028		2.900	2.395	1,500 % fällig am 01.10.2037		290	34
				Fairfax Financial Holdings Ltd.				1,500 % fällig am 01.10.2050		0	0
				2,750 % fällig am 29.03.2028		7.000	6.126	2,000 % fällig am 01.10.2053		0	0
				Ford Motor Credit Co. LLC				2,500 % fällig am 01.10.2036		36	4
				2,386 % fällig am 17.02.2026		1.400	1.281	2,500 % fällig am 01.10.2047		0	0
				2,684 % fällig am 01.12.2024		200	193	P3 Group SARL			
				2,700 % fällig am 10.08.2026	\$	400	326	1,625 % fällig am 26.01.2029	€	4.000	2.950
				G City Europe Ltd.				Pacific Life Global Funding			
				4,250 % fällig am 11.09.2025	€	2.400	2.016	1,200 % fällig am 24.06.2025	\$	200	170
				GA Global Funding Trust				Prologis International Funding S.A.			
				1,625 % fällig am 15.01.2026	\$	200	167	3,125 % fällig am 01.06.2031	€	900	802
				General Motors Financial Co., Inc.				QNB Finance Ltd.			
				2,200 % fällig am 01.04.2024	€	600	589	1,375 % fällig am 26.01.2026	\$	3.300	2.772
				Globalworth Real Estate Investments Ltd.				Realkredit Danmark A/S			
				3,000 % fällig am 29.03.2025		2.700	2.370	2,500 % fällig am 01.04.2036	DKK	3	0
				Goldman Sachs Group, Inc.				2,500 % fällig am 01.04.2047		0	0
				0,875 % fällig am 09.05.2029		8.100	6.511	Sagax AB			
				HSBC Holdings PLC				1,125 % fällig am 30.01.2027	€	1.600	1.296
				0,309 % fällig am 13.11.2026		100	89	Sagax Euro MTN NL BV			
				4,292 % fällig am 12.09.2026	\$	1.400	1.256	0,750 % fällig am 26.01.2028		800	603
				ING Bank NV				Santander UK Group Holdings PLC			
				2,750 % fällig am 21.11.2025	€	1.700	1.675	0,603 % fällig am 13.09.2029		9.400	7.325
				ING Groep NV				2,975 % fällig am 27.03.2024		2.000	2.001
				1,250 % fällig am 16.02.2027		200	182	SBB Treasury Oyj			
				3,000 % fällig am 18.02.2026	£	3.600	3.779	2,284 % fällig am 08.02.2024		1.900	1.768
				Intesa Sanpaolo SpA				SELP Finance SARL			
				4,000 % fällig am 23.09.2029	\$	3.700	2.973	3,750 % fällig am 10.08.2027		400	373
				5,710 % fällig am 15.01.2026		2.300	2.073	Sirius Real Estate Ltd.			
				JAB Holdings BV				1,125 % fällig am 22.06.2026		4.800	3.756
				1,750 % fällig am 25.06.2026	€	1.100	1.025	Skandinaviska Enskilda Banken AB			
				4,750 % fällig am 29.06.2032		4.300	4.349	4,000 % fällig am 09.11.2026		2.100	2.109
				Jyske Realkredit A/S				Societe Generale S.A.			
				0,500 % fällig am 01.10.2043	DKK	0	0	0,625 % fällig am 02.12.2027		2.000	1.722
				1,000 % fällig am 01.10.2050		32.010	3.172	1,792 % fällig am 09.06.2027	\$	4.700	3.794
				1,000 % fällig am 01.10.2053		0	0	Sofina S.A.			
				1,500 % fällig am 01.10.2037		264	31	1,000 % fällig am 23.09.2028	€	4.900	3.832
				1,500 % fällig am 01.10.2050		0	0	Standard Chartered PLC			
				Kojamo Oyj				0,800 % fällig am 17.11.2029		1.000	796
				1,500 % fällig am 19.06.2024	€	500	475	1,214 % fällig am 23.03.2025 (e)	\$	200	177
				LeasePlan Corp. NV				1,214 % fällig am 23.03.2025		3.800	3.362
				0,250 % fällig am 07.09.2026		2.600	2.231	3,785 % fällig am 21.05.2025		1.300	1.176
				Liberty Mutual Finance Europe DAC				Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.			
				1,750 % fällig am 27.03.2024		400	390	1,474 % fällig am 08.07.2025		400	342
				Lloyds Banking Group PLC				TP ICAP Finance PLC			
				3,511 % fällig am 18.03.2026	\$	200	178	2,625 % fällig am 18.11.2028	£	3.300	2.742
				3,750 % fällig am 18.03.2028		3.700	3.205	UBS Group AG			
				Logicor Financing SARL				1,250 % fällig am 17.04.2025	€	12.500	12.023
				2,250 % fällig am 13.05.2025	€	5.500	5.033	UniCredit SpA			
				3,250 % fällig am 13.11.2028		2.000	1.687	5,850 % fällig am 15.11.2027		1.400	1.423

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
1,764 % fällig am 03.03.2023 (a)(b)	€ 2.000	€ 1.994	0,33	SPAIN TREASURY BILLS			
		3.988	0,65	1,447 % fällig am 13.01.2023 (a)(b)	€ 430	€ 430	0,07
TREASURY BILLS DES EUROPÄISCHEN STABILITÄTSMCHANISMUS				1,448 % fällig am 13.01.2023 (a)(b)	290	290	0,05
1,754 % fällig am 09.03.2023 (a)(b)	800	797	0,13	1,455 % fällig am 13.01.2023 (a)(b)	580	579	0,09
1,755 % fällig am 09.03.2023 (a)(b)	1.000	997	0,17	1,460 % fällig am 13.01.2023 (a)(b)	500	500	0,08
1,760 % fällig am 09.03.2023 (a)(b)	1.000	997	0,16			1.799	0,29
		2.791	0,46	Summe kurzfristige Instrumente		33.404	5,47
FRANCE TREASURY BILLS				Summe Übertragbare Wertpapiere		€ 491.678	80,60
0,253 % fällig am 04.01.2023 (a)(b)	5.400	5.400	0,89				
0,994 % fällig am 22.02.2023 (a)(b)	2.800	2.794	0,46	AKTIEN			
1,600 % fällig am 22.03.2023 (a)(b)	700	698	0,12	INVESTMENTFONDS BÖRSENGEHANDELTE FONDS			
1,612 % fällig am 22.03.2023 (a)(b)	700	698	0,11	PIMCO ETFs plc – PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (d)	532.500	50.689	8,31
1,625 % fällig am 22.03.2023 (a)(b)	700	697	0,11	Summe Investmentfonds		€ 50.689	8,31
		10.287	1,69				
GERMANY TREASURY BILLS							
0,958 % fällig am 18.01.2023 (a)(b)(f)	9.220	9.217	1,51				
1,939 % fällig am 17.05.2023 (a)(b)	2.750	2.730	0,45				
		11.947	1,96				

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kapital- betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions- geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions- geschäft ⁽¹⁾	% des Nettovermögens
BPS	(1,000) %	30.12.2022	02.01.2023	€ 7.400	Landwirtschaftliche Rentenbank 0,500 % fällig am 28.02.2029	€ (7.498)	€ 7.400	€ 7.399	1,21
FICC	1,900	30.12.2022	03.01.2023	\$ 983	U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 29.06.2023	(940)	921	921	0,15
IND	(0,500)	30.12.2022	02.01.2023	€ 36.300	BNG Bank NV 0,000 % – 0,500 % fällig am 16.04.2025 – 31.08.2028	(2.776)	36.300	36.298	5,95
					Bpifrance SACA 0,250 % fällig am 29.03.2030	(483)			
					Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale 2,750 % fällig am 25.11.2032	(568)			
					Council of Europe Development Bank 0,000 % fällig am 20.01.2031	(784)			
					European Financial Stability Facility 0,000 % – 3,000 % fällig am 15.10.2025 – 04.09.2034	(4.447)			
					European Investment Bank 0,000 % - 4,000 % fällig am 15.03.2024 - 14.03.2042	(6.798)			
					Treasury Bills des europäischen Stabilitätsmechanismus 1,800 % fällig am 02.11.2046	(549)			
					European Union 0,000 % – 3,375 % fällig am 04.11.2025 – 04.03.2053	(12.520)			
					Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0,000 % – 1,375 % fällig am 07.11.2023 – 29.09.2034	(4.431)			
					Land North Rhine-Westphalia 2,375 % fällig am 13.05.2033	(837)			
					Landwirtschaftliche Rentenbank 0,375 % - 0,500 % fällig am 14.02.2028 – 28.02.2029	(1.038)			
					UNEDIC 1,500 % fällig am 20.04.2032	(1.626)			
Summe Pensionsgeschäfte						€ (45.295)	€ 44.621	€ 44.618	7,31

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Euro-Bund 10-Year Bond March Futures	Short	03.2023	72	€ 456	0,08
Euro-Buxl 30-Year Bond March Futures	Long	03.2023	131	(3.348)	(0,55)
U.S. Treasury 10-Year Note March Futures	Short	03.2023	16	5	0,00
				€ (2.887)	(0,47)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				€ (2.887)	(0,47)

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Euro Credit Fund (Forts.)

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
AT&T, Inc.	1,000 %	20.06.2024	\$ 5.600	€ (78)	(0,01)
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2026	6.300	(96)	(0,02)
British Telecommunications PLC	1,000	20.12.2025	€ 2.500	(46)	(0,01)
British Telecommunications PLC	1,000	20.12.2027	1.100	(34)	(0,01)
British Telecommunications PLC	1,000	20.06.2028	3.300	(106)	(0,02)
British Telecommunications PLC	1,000	20.12.2028	1.600	(42)	(0,01)
Electricite de France S.A.	1,000	20.12.2026	3.300	(65)	(0,01)
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20.06.2027	\$ 700	1	0,00
General Electric Co.	1,000	20.06.2026	2.900	(3)	0,00
General Electric Co.	1,000	20.12.2026	400	(2)	0,00
General Motors Co.	5,000	20.06.2026	500	(33)	(0,01)
LafargeHolcim Ltd.	1,000	20.06.2026	€ 5.800	(90)	(0,01)
Marks & Spencer PLC	1,000	20.12.2024	1.500	(4)	0,00
Stellantis NV	5,000	20.06.2026	5.900	(455)	(0,07)
Syngenta Finance NV	1,000	20.06.2028	400	(9)	0,00
Telefonica Emisiones S.A.	1,000	20.06.2028	100	(2)	0,00
Tesco PLC	1,000	20.12.2027	4.700	(94)	(0,01)
				€ (1.158)	(0,19)

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
iTraxx Europe Main 37 5-Year Index	1,000 %	20.06.2027	€ 49.600	€ 122	0,02

ZINSSWAPS

Zahlung/Erhalt	variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt ⁽³⁾	1-Day GBP-SONIO	Compounded-OIS	2,250 %	15.03.2028	£ 8.700	€ 252	0,04
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM	Compounded-OIS	0,050	15.12.2031	¥ 1.860.000	456	0,08
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate	Compounded-OIS	1,750	15.06.2024	\$ 23.000	87	0,01
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate	Compounded-OIS	1,750	15.06.2052	3.400	316	0,05
Erhalt	3-Month USD-LIBOR		0,500	16.06.2026	27.600	2.642	0,43
Erhalt	3-Month USD-LIBOR		0,750	16.06.2031	15.100	2.202	0,36
Zahlung ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR		1,500	15.03.2025	€ 21.200	(225)	(0,04)
Zahlung ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR		1,500	15.03.2028	105.600	(3.326)	(0,54)
Zahlung ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR		1,750	15.03.2033	133.800	(3.193)	(0,52)
						€ (789)	(0,13)
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate						€ (1.825)	(0,30)

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

⁽²⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definieren.

⁽³⁾ Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

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

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

VERKAUFSOPTIENEN

CREDIT DEFAULT SWAPPTIONS AUF KREDITINDIZES

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/-verkauf	Ausübungs-kurs	Verfallsdatum	Nennbetrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
GST	Put – OTC iTraxx Europe 37 5-Year Index	Verkauf	3,000 %	15.03.2023	1.800	€ (3)	€ 0	0,00

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
GLM	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,500 %	07.02.2023	52.200	€ (151)	€ (1.458)	(0,24)

⁽¹⁾ Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag ⁽²⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
MYC	Mexico Government International Bond	1,000 %	20.12.2026	\$ 200	€ 0	€ 0	€ 0	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2027	400	(14)	9	(5)	0,00
					€ (14)	€ 9	€ (5)	0,00

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

⁽²⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definieren.

DEVISENTERMINKONTRÄKTE

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2023	€ 2.981	\$ 3.150	€ 0	€ (31)	€ (31)	(0,01)
	02.2023	£ 144	\$ 162	1	0	1	0,00
	02.2023	¥ 164.900	1.145	0	(30)	(30)	0,00
BPS	03.2023	\$ 2.189	MXN 44.118	40	0	40	0,01
BRC	01.2023	€ 23.854	\$ 25.448	0	(19)	(19)	0,00
	01.2023	\$ 1.062	€ 1.010	15	0	15	0,00
CBK	02.2023	€ 866	¥ 124.400	19	0	19	0,00
	01.2023	DKK 191.616	€ 25.772	3	0	3	0,00
	01.2023	€ 458	DKK 3.405	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 8	BRL 42	0	0	0	0,00
	02.2023	€ 829	£ 732	0	(5)	(5)	0,00
	03.2023	\$ 235	MXN 4.602	0	(2)	(2)	0,00
GLM	01.2023	BRL 42	\$ 8	0	0	0	0,00
	02.2023	\$ 8	BRL 42	0	0	0	0,00
	03.2023	MXN 47.752	\$ 2.323	0	(87)	(87)	(0,01)
JPM	01.2023	CNH 53	8	0	0	0	0,00
	02.2023	€ 1.044	¥ 150.200	26	0	26	0,00
MBC	01.2023	DKK 10.855	€ 1.460	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 118.059	112.645	2.073	0	2.073	0,34
MYI	02.2023	AUD 14	9	0	0	0	0,00
	05.2023	CNH 7.698	\$ 1.147	22	0	22	0,00
	01.2023	€ 6.028	DKK 44.840	2	0	2	0,00
	01.2023	\$ 3.726	\$ 3.902	0	(71)	(71)	(0,01)
	02.2023	2.305	£ 1.988	0	(68)	(68)	(0,01)
	02.2023	¥ 31.082	€ 216	0	(5)	(5)	0,00
RBC	02.2023	\$ 42	ZAR 773	3	0	3	0,00
	02.2023	£ 120	€ 137	2	0	2	0,00
	02.2023	¥ 177.500	1.231	0	(32)	(32)	(0,01)
SCX	02.2023	€ 1.202	¥ 173.800	35	0	35	0,01
	02.2023	¥ 113.400	€ 791	0	(17)	(17)	0,00
SSB	02.2023	£ 20.482	23.337	292	0	292	0,05
UAG	05.2023	\$ 1.052	CNH 7.293	11	0	11	0,00
				€ 2.544	€ (367)	€ 2.177	0,36

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

€ 714 0,12

Summe Anlagen

€ 582.990 95,57

Sonstige Aktiva und Passiva

€ 27.018 4,43

Nettovermögen

€ 610.008 100,00

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

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

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Nullkuponwertpapier.

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

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

(d) Mit dem Fonds verbunden.

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Euro Credit Fund (Forts.)

(e) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2021: 0,07 %):

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeitsdatum	Kaufdatum	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
Deutsche Bank AG	2,129 %	24.11.2026	17.11.2020	€ 337	€ 331	0,05
Standard Chartered PLC	1,214	23.03.2025	16.03.2021	168	177	0,03
				€ 505	€ 508	0,08

(f) Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von 262 EUR (31. Dezember 2021: 0 EUR) und Barmittel in Höhe von 1.150 EUR (31. Dezember 2021: 10 EUR) wurden gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. zum 31. Dezember 2022 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 25.216 EUR (31. Dezember 2021: 34.510 EUR) wurden zum 31. Dezember 2022 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	€ 0	€ 491.678	€ 0	€ 491.678
Investmentfonds	50.689	0	0	50.689
Pensionsgeschäfte	0	44.621	0	44.621
Finanzderivate ⁽³⁾	(2.892)	(1.106)	0	(3.998)
Summen	€ 47.797	€ 535.193	€ 0	€ 582.990

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

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	€ 0	€ 902.376	€ 0	€ 902.376
Investmentfonds	0	63.657	0	63.657
Pensionsgeschäfte	0	5.883	0	5.883
Finanzderivate ⁽³⁾	(1.606)	654	(15)	(967)
Summen	€ (1.606)	€ 972.570	€ (15)	€ 970.949

⁽¹⁾ Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

⁽²⁾ Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

⁽³⁾ Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung des Marktwerts der außerbörslich gehandelten Finanzderivate und (erhaltenen)/verpfändeten Sicherheiten nach Kontrahenten zum 31. Dezember 2022 und 31. Dezember 2021:

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2022			Zum 31. Dez. 2021		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾
BOA	€ (60)	€ 0	€ (60)	€ (15)	€ 0	€ (15)
BPS	40	0	40	2	0	2
BRC	15	0	15	(16)	0	(16)
CBK	(4)	0	(4)	(1)	0	(1)
DUB	k. A.	k. A.	k. A.	15	0	15
FBF	k. A.	k. A.	k. A.	(15)	0	(15)
GLM	(1.545)	1.412	(133)	(379)	0	(379)
GST	k. A.	k. A.	k. A.	(9)	10	1
HUS	k. A.	k. A.	k. A.	(36)	0	(36)
JPM	26	0	26	814	(890)	(76)
MBC	2.095	(1.900)	195	k. A.	k. A.	k. A.
MYC	(5)	0	(5)	(2)	0	(2)
MYI	(139)	(50)	(189)	k. A.	k. A.	k. A.
RBC	(30)	0	(30)	15	0	15
RYL	k. A.	k. A.	k. A.	76	0	76
SCX	18	0	18	1.434	(1.140)	294
SSB	292	0	292	k. A.	k. A.	k. A.
UAG	11	0	11	k. A.	k. A.	k. A.

⁽¹⁾ Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Nettobeträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2022:

	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	72,82	84,44
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	7,71	3,43
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,07	0,84
Investmentfonds	8,31	6,26
Pensionsgeschäfte	7,31	0,58
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,47)	(0,16)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,30)	(0,12)
Freiverkehrsfinanzderivate	0,12	0,19

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2022 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
Kreditbeteiligungen und -abtretungen	1,36	1,54
Unternehmensanleihen und Wechsel	62,43	79,65
US-Regierungsbehörden	2,01	k. A.
Non-Agency-MBS	4,11	2,58
Forderungsbesicherte Wertpapiere	5,19	3,76
Staatsemissionen	0,03	1,01
Kurzfristige Instrumente	5,47	0,17
Investmentfonds	8,31	6,26
Pensionsgeschäfte	7,31	0,58
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,47)	(0,16)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf	(0,19)	(0,03)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,02	0,01
Zinsswaps	(0,13)	(0,10)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes	0,00	0,00
Zinsswapoptionen	(0,24)	k. A.
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf	0,00	0,08
Devisenterminkontrakte	0,36	0,11
Sonstige Aktiva und Passiva	4,43	4,54
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
Renaissance Home Equity Loan Trust			
5,879 % fällig am 25.06.2037 [^]	\$ 3.494	€ 1.046	0,08
6,189 % fällig am 25.09.2037	158	127	0,01
7,238 % fällig am 25.09.2037 [^]	216	95	0,01
Residential Asset Mortgage Products Trust			
5,334 % fällig am 25.10.2035	3.000	2.267	0,17
Residential Asset Securities Corp. Trust			
4,649 % fällig am 25.11.2036	751	640	0,05
Rockford Tower Europe CLO DAC			
3,077 % fällig am 20.12.2031	€ 600	585	0,04
Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust			
4,569 % fällig am 25.07.2036	\$ 195	65	0,01
4,709 % fällig am 25.07.2036	191	64	0,01
4,869 % fällig am 25.07.2036	163	55	0,00
4,889 % fällig am 25.05.2036	673	343	0,03
Toro European CLO DAC			
2,173 % fällig am 18.01.2031	€ 294	288	0,02
2,336 % fällig am 20.07.2032	2.000	1.936	0,14
Soundview Home Loan Trust			
4,499 % fällig am 25.02.2037	\$ 266	72	0,01
4,569 % fällig am 25.02.2037	394	107	0,01
4,669 % fällig am 25.06.2037	142	95	0,01
Specialty Underwriting & Residential Finance Trust			
4,689 % fällig am 25.09.2037	67	44	0,00
St Paul's CLO DAC			
2,138 % fällig am 17.07.2030	€ 1.497	1.457	0,11
Structured Asset Investment Loan Trust			
4,539 % fällig am 25.09.2036	\$ 33	30	0,00
Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust			
6,139 % fällig am 25.04.2031	1.879	1.721	0,13
Toro European CLO DAC			
2,118 % fällig am 15.10.2030	€ 1.199	1.175	0,09
2,239 % fällig am 12.01.2032	9.200	8.863	0,66
2,298 % fällig am 15.07.2030	2.390	2.349	0,17
Voya Euro CLO DAC			
2,128 % fällig am 15.10.2030	4.298	4.208	0,31
		151.289	11,18

STAATSEMISSIONEN			
Bpifrance Financement S.A.			
3,000 % fällig am 10.09.2026	800	793	0,06
France Government International Bond			
0,000 % fällig am 25.03.2023 (c)	7.150	7.118	0,53
Ivory Coast Government International Bond			
5,250 % fällig am 22.03.2030	6.000	5.087	0,38

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
Russia Government International Bond			
2,875 % fällig am 04.12.2025 [^]	€ 4.000	€ 1.160	0,08
Ukraine Government International Bond			
7,750 % fällig am 01.09.2025 [^]	\$ 6.500	1.408	0,10

KURZFRISTIGE INSTRUMENTE KURZFRISTIGE SCHULDITITEL

Corestate Capital Holding S.A.			
8,000 % fällig am 15.04.2023 (g)	€ 700	700	0,05
BELGIUM TREASURY BILLS			
1,641 % fällig am 09.03.2023 (c)(d)	700	697	0,05
1,643 % fällig am 09.03.2023 (c)(d)	700	698	0,05
		1.395	0,10

Treasury Bills des europäischen Stabilitätsmechanismus			
1,754 % fällig am 09.03.2023 (c)(d)	2.430	2.422	0,18
1,755 % fällig am 09.03.2023 (c)(d)	3.030	3.021	0,22
1,760 % fällig am 09.03.2023 (c)(d)	3.040	3.030	0,23
		8.473	0,63

EUROPEAN UNION TREASURY BILLS			
0,233 % fällig am 06.01.2023 (c)(d)	3.900	3.900	0,29
1,217 % fällig am 06.01.2023 (c)(d)	150	150	0,01
1,351 % fällig am 03.02.2023 (c)(d)	3.500	3.496	0,26
1,369 % fällig am 03.03.2023 (c)(d)	5.000	4.985	0,37
1,666 % fällig am 03.03.2023 (c)(d)	9.180	9.153	0,68
1,668 % fällig am 03.03.2023 (c)(d)	9.900	9.871	0,73
1,764 % fällig am 03.03.2023 (c)(d)	1.100	1.097	0,08
2,185 % fällig am 09.06.2023 (c)(d)	12.210	12.084	0,89
		44.736	3,31

FRANCE TREASURY BILLS			
0,253 % fällig am 04.01.2023 (c)(d)	13.700	13.700	1,01
0,740 % fällig am 08.02.2023 (c)(d)	2.300	2.297	0,17
0,904 % fällig am 08.02.2023 (c)(d)	2.300	2.297	0,17
0,918 % fällig am 08.02.2023 (c)(d)	2.500	2.497	0,18
0,994 % fällig am 22.02.2023 (c)(d)	2.500	2.495	0,18
1,282 % fällig am 08.02.2023 (c)(d)	3.500	3.495	0,26
1,600 % fällig am 22.03.2023 (c)(d)	1.200	1.195	0,09
1,612 % fällig am 22.03.2023 (c)(d)	1.150	1.146	0,09
1,625 % fällig am 22.03.2023 (c)(d)	1.200	1.196	0,09
1,735 % fällig am 15.03.2023 (c)(d)	2.550	2.541	0,19
		32.859	2,43

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
GERMANY TREASURY BILLS			
0,958 % fällig am 18.01.2023 (c)(d)	€ 5.290	€ 5.288	0,39
1,257 % fällig am 22.02.2023 (c)(d)	720	719	0,05
1,925 % fällig am 17.05.2023 (c)(d)	420	417	0,03
1,954 % fällig am 17.05.2023 (c)(d)	5.420	5.381	0,40
		11.805	0,87

JAPAN TREASURY BILLS			
(0,198) % fällig am 27.03.2023 (c)(d)	¥ 4.410.200	31.331	2,32
(0,179) % fällig am 27.03.2023 (c)(d)	5.469.800	38.859	2,87
		70.190	5,19

SPAIN TREASURY BILLS			
1,441 % fällig am 13.01.2023 (c)(d)	€ 250	250	0,02
1,460 % fällig am 13.01.2023 (c)(d)	350	350	0,02
		600	0,04

Summe kurzfristige Instrumente		170.758	12,62
Summe Übertragbare Wertpapiere	€ 1.100.441		81,34

AKTIEN			
INVESTMENTFONDS ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN			
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO European High Yield Bond Fund (a)	1.494.064	14.761	1,09
BÖRSENGEHANDELTE FONDS			
PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (e)	1.261.200	120.054	8,87
Summe Investmentfonds	€ 134.815		9,96

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kapital- betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions- geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions- geschäft ⁽¹⁾	% des Nettvermögens
BPS	(1,000) %	30.12.2022	02.01.2023	€ 16.600	ABN BNG Bank NV 0,875 % fällig am 24.10.2036	€ (16.819)	€ 16.600	€ 16.599	1,23
COM	(0,500)	30.12.2022	02.01.2023	100.000	Land Berlin 0,625% due 08/02/2027	(102.209)	100.000	99.996	7,38
FICC	1,900	30.12.2022	03.01.2023	\$ 4.117	U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 29.06.2023	(3.935)	3.858	3.858	0,29
Summe Pensionsgeschäfte						€ (122.963)	€ 120.458	€ 120.453	8,90

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
Euro-Bund 10-Year Bond March Futures	Long	03.2023	189	€ (1.621)	(0,12)
Euro-Schatz March Futures	Short	03.2023	3.801	5.121	0,38
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond March Futures	Long	03.2023	802	(958)	(0,07)
United Kingdom Long Gilt March Futures	Short	03.2023	17	123	0,01
				€ 2.665	0,20
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				€ 2.665	0,20

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Euro Income Bond Fund (Forts.)

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
AT&T, Inc.	1,000 %	20.06.2024	\$ 13.000	€ (132)	(0,01)
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2026	9.700	(140)	(0,01)
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20.06.2025	200	3	0,00
General Electric Co.	1,000	20.06.2024	4.400	86	0,01
General Electric Co.	1,000	20.06.2026	11.700	(14)	0,00
General Electric Co.	1,000	20.12.2026	1.300	(7)	0,00
Syngenta Finance NV	1,000	20.06.2028	€ 800	(18)	0,00
Tesco PLC	1,000	20.06.2028	500	(13)	0,00
Valeo S.A.	1,000	20.06.2028	400	(24)	(0,01)
				€ (259)	(0,02)

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.HY-39 5-Year Index	5,000 %	20.12.2027	\$ 71.800	€ (325)	(0,02)
CDX.IG-38 5-Year Index	1,000	20.06.2027	1.000	(1)	0,00
CDX.IG-39 5-Year Index	1,000	20.12.2027	2.700	18	0,00
iTraxx Crossover 38 5-Year Index	5,000	20.12.2027	€ 42.400	2.124	0,16
iTraxx Europe Main 37 5-Year Index	1,000	20.06.2027	82.500	335	0,02
				€ 2.151	0,16

ZINSSWAPS

Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung ⁽³⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	2,000 %	15.03.2053	£ 3.000	€ (117)	(0,01)
Erhalt ⁽³⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	2,250	15.03.2028	26.500	767	0,06
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,400	15.06.2032	¥ 8.530.000	2.580	0,19
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2024	\$ 215.000	3.418	0,25
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,868	05.05.2032	15.100	(1.842)	(0,14)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,040	25.05.2032	7.800	(845)	(0,06)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,068	11.05.2032	15.400	(1.639)	(0,12)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,153	18.05.2032	15.400	(1.522)	(0,11)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,270	04.11.2023	220.700	(7.170)	(0,53)
Erhalt ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	0,830	09.12.2052	€ 22.000	609	0,04
Zahlung ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	1,500	15.03.2028	137.700	(3.476)	(0,26)
Erhalt ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	1,500	15.03.2053	47.000	5.289	0,39
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,520	07.07.2027	9.600	(587)	(0,04)
					€ (4.535)	(0,34)
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					€ (2.643)	(0,20)

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

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

⁽³⁾ Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

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

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

VERKAUFSOPTIONEN

CREDIT DEFAULT SWAPPTIONS AUF KREDITINDIZES

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/-verkauf	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
GST	Put - OTC iTraxx Europe 37 5-Year Index	Verkauf	3,000 %	15.03.2023	3.300	€ (6)	€ (1)	0,00

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
GLM	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,500 %	07.02.2023	115.000	€ (333)	€ (3.211)	(0,24)

⁽¹⁾ Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag ⁽²⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
GST	ADLER Real Estate AG	5,000 %	20.12.2026	€ 1.200	€ (7)	€ (281)	€ (288)	(0,02)

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

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

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens		
BOA	01.2023	€	26.518 DKK	197.230	€ 6	€ 0	0,00		
	01.2023		9.514 \$	10.128	0	(29)	0,00		
	01.2023	\$	11.670 BRL	62.172	96	0	0,01		
	01.2023		12.636 €	11.884	49	0	0,00		
	02.2023	CAD	124	90	4	0	0,00		
	02.2023	£	190	215	1	0	0,00		
BPS	03.2023	\$	3.762 MXN	74.756	22	0	0,00		
	01.2023		34.984 €	32.845	79	0	0,01		
	03.2023	INR	19.159 \$	231	1	0	0,00		
BRC	03.2023	\$	10.740 MXN	216.455	195	0	0,01		
	01.2023		5.456 €	5.114	4	0	0,00		
CBK	01.2023		7.313 KRW	9.430.845	171	0	0,01		
	01.2023	€	8.529 \$	9.071	0	(33)	0,00		
GLM	01.2023	\$	31 BRL	161	0	0	0,00		
	01.2023		11.739 €	11.020	25	0	0,00		
	02.2023	€	1.337 £	1.181	0	(8)	0,00		
	01.2023	BRL	62.333 \$	11.696	0	(100)	(0,01)		
	01.2023	CNH	216	31	0	0	0,00		
	03.2023	MXN	195.687	9.519	0	(354)	(0,03)		
JPM	04.2023	\$	11.491 BRL	62.333	102	0	0,01		
	01.2023	€	4.948 DKK	36.800	1	0	0,00		
	02.2023	TWD	310	10	0	0	0,00		
	03.2023	IDR	282.387	18	0	0	0,00		
MBC	03.2023	¥	9.884.973 €	68.267	0	(2.315)	(0,17)		
	01.2023	DKK	7.320	984	0	0	0,00		
	01.2023	€	4.084 \$	4.326	0	(32)	0,00		
	01.2023	\$	217.231 €	207.268	3.812	0	3.812	0,28	
	02.2023	AUD	50	32	1	0	1	0,00	
	03.2023	IDR	171.508	\$ 11	0	0	0	0,00	
MYI	05.2023	CNH	30.884	4.602	88	0	88	0,01	
	01.2023	€	19.230 DKK	143.045	7	0	7	0,00	
	01.2023		8.756 \$	9.170	0	(167)	(167)	(0,01)	
	01.2023	\$	7.894 €	7.424	30	0	30	0,00	
	02.2023	¥	48.304	336	0	(8)	(8)	0,00	
	02.2023	TWD	574	\$ 19	0	0	0	0,00	
RBC	02.2023	\$	142 ZAR	2.604	10	0	10	0,00	
	03.2023	IDR	241.503	\$ 15	0	0	0	0,00	
	02.2023	€	5.552 £	4.810	0	(141)	(141)	(0,01)	
	02.2023		1.140 ¥	161.300	8	0	8	0,00	
	03.2023	\$	4 MXN	78	0	0	0	0,00	
	04.2023	MXN	18.319	\$ 884	0	(35)	(35)	0,00	
RYL	01.2023	\$	600 €	577	15	0	15	0,00	
	02.2023	€	13.756 AUD	21.380	0	(186)	(186)	(0,01)	
	02.2023		13.540 ¥	1.942.600	292	0	292	0,02	
	02.2023		3.437 NOK	35.780	0	(38)	(38)	0,00	
SCX	01.2023	DKK	638.976 €	85.948	18	0	18	0,00	
	02.2023	€	1.963 £	1.693	0	(59)	(59)	0,00	
	02.2023	TWD	3.473	\$ 113	0	(1)	(1)	0,00	
SSB	02.2023	£	27.154 €	30.939	387	0	387	0,03	
	03.2023	\$	7.357 IDR	114.511.705	41	0	41	0,00	
UAG	03.2023		3.307 MXN	65.709	19	0	19	0,00	
	05.2023		4.351 CNH	30.155	46	0	46	0,00	
						€ 5.530	€ (3.506)	€ 2.024	0,15
Summe Freiverkehrsfinanzderivate							€ (1.476)		(0,11)
Summe Anlagen							€ 1.354.260		100,09
Sonstige Aktiva und Passiva							€ (1.280)		(0,09)
Nettovermögen							€ 1.352.980		100,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Euro Income Bond Fund (Forts.)

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

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

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.

(b) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.

(c) Nullkuponwertpapier.

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

(e) Mit dem Fonds verbunden.

(f) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(g) Eingeschränkte Wertpapiere: (31. Dezember 2021: 0,19 %):

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeits- datum	Kauf- datum	Kosten	Markt- wert	% des Nettvermögens
Corestate Capital Holding S.A.	8,000 %	15.04.2023	06.12.2022	€ 700	€ 700	0,05
Deutsche Bank AG	3,035	28.05.2032	29.07.2021	173	142	0,01
				€ 873	€ 842	0,06

Wertpapier mit einem Gesamtmarktwert von 0 EUR (31. Dezember 2021: 3.312 EUR) wurden gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen zum 31. Dezember 2022 als Sicherheiten verpfändet.

Barmittel in Höhe von 41.642 EUR (31. Dezember 2021: 61.805 EUR) wurden zum 31. Dezember 2022 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 5.462 EUR (31. Dezember 2021: 2.269 EUR) wurden zum 31. Dezember 2022 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	€ 0	€ 1.098.581	€ 1.860	€ 1.100.441
Investmentfonds	134.815	0	0	134.815
Pensionsgeschäfte	0	120.458	0	120.458
Finanzderivate ⁽³⁾	3.623	(5.077)	0	(1.454)
Summen	€ 138.438	€ 1.213.962	€ 1.860	€ 1.354.260

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

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	€ 0	€ 2.206.773	€ 0	€ 2.206.773
Investmentfonds	95.911	80.957	0	176.868
Pensionsgeschäfte	0	7.551	0	7.551
Finanzderivate ⁽³⁾	863	15.756	(32)	16.587
Summen	€ 96.774	€ 2.311.037	€ (32)	€ 2.407.779

⁽¹⁾ Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

⁽²⁾ Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

⁽³⁾ Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2021:

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2022			Zum 31. Dez. 2021		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement ⁽¹⁾	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement ⁽¹⁾
BOA	€ 149	€ (272)	€ (123)	€ (68)	€ 0	€ (68)
BPS	275	(290)	(15)	50	0	50
BRC	175	0	175	(88)	0	(88)
CBK	(16)	0	(16)	11	0	11
DUB	k. A.	k. A.	k. A.	53	0	53
FBF	k. A.	k. A.	k. A.	262	(229)	33
GLM	(3.563)	3.382	(181)	(1.761)	2.023	262
GST	(289)	328	39	1.171	(1.301)	(130)
HUS	k. A.	k. A.	k. A.	(126)	246	120

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2022			Zum 31. Dez. 2021		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement ⁽¹⁾	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement ⁽¹⁾
JPM	€ (2.314)	€ 1.752	€ (562)	€ 2.018	€ (2.207)	€ (189)
MBC	3.869	(3.429)	440	k. A.	k. A.	k. A.
MYC	k. A.	k. A.	k. A.	5	(9)	(4)
MYI	(128)	0	(128)	(170)	0	(170)
RBC	(168)	0	(168)	3	0	3
RYL	83	0	83	k. A.	k. A.	k. A.
SCX	(42)	0	(42)	4.527	(2.647)	1.880
SSB	428	(272)	156	k. A.	k. A.	k. A.
UAG	65	0	65	k. A.	k. A.	k. A.

⁽¹⁾ Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2022:

	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	60,94	77,13
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	19,96	8,49
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,44	3,28
Investmentfonds	9,96	7,13
Pensionsgeschäfte	8,90	0,30
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,20	0,06
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,20)	0,37
Freiverkehrfinanzderivate	(0,11)	0,24
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	k. A.	(0,13)

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2022 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
Kreditbeteiligungen und -abtretung	2,26	5,73
Unternehmensanleihen und Wechsel	43,78	69,07
Wandelanleihen & Wechsel	0,11	0,28
US-Regierungsbehörden	6,78	k. A.
Non-Agency-MBS	3,46	4,91
Forderungsbesicherte Wertpapiere	11,18	5,01
Staatsemissionen	1,15	3,84
Kurzfristige Instrumente	12,62	0,06
Investmentfonds	9,96	7,13
Pensionsgeschäfte	8,90	0,30
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,20	0,06
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	(0,02)	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,16	0,03
Zinsswaps	(0,34)	0,34
Freiverkehrfinanzderivate		
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes	0,00	0,00
Zinsswapoptionen	(0,24)	(0,03)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	(0,02)	0,14
Devisenterminkontrakte	0,15	0,13
Sonstige Aktiva und Passiva	(0,09)	3,00
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
STAATSEMISSIONEN								KURZFRISTIGE INSTRUMENTE			
COMMERCIAL PAPER											
Austria Government International Bond 0,850 % fällig am 30.06.2120	€ 110	€ 43	0,04	Ministeries Van de Vlaamse Gemeenschap 3,250 % fällig am 12.01.2043	€ 1.200	€ 1.114	1,01	Acciona Energia Financiacion Filiales S.A. 2,078 % fällig am 16.01.2023	€ 500	€ 499	0,45
Belgium Government International Bond 1,400 % fällig am 22.06.2053	1.500	939	0,85	Netherlands Government International Bond 0,000 % fällig am 15.01.2038 (a)	2.500	1.629	1,48	Alcoa Nederland Holding BV 2,109 % fällig am 12.01.2023	500	500	0,46
Croatia Government International Bond 1,500 % fällig am 17.06.2031	400	332	0,30	0,000 % fällig am 15.01.2052 (a)	3.900	1.871	1,70	Universal Music Group NV 2,099 % fällig am 13.02.2023	300	299	0,27
France Government International Bond 0,500 % fällig am 25.06.2044	2.000	1.156	1,05	2,750 % fällig am 15.01.2047	3.650	3.645	3,31	Summe kurzfristige Instrumente		1.298	1,18
0,500 % fällig am 25.05.2072	3.850	1.436	1,31	4,000 % fällig am 15.01.2037	1.400	1.565	1,42	Summe Übertragbare Wertpapiere	€ 103.959		94,47
0,750 % fällig am 25.05.2052	24.400	12.887	11,71	Romania Government International Bond 2,125 % fällig am 07.03.2028	100	84	0,08				
1,500 % fällig am 25.05.2050	1.100	744	0,68	3,750 % fällig am 07.02.2034	100	75	0,07				
1,750 % fällig am 25.06.2039	2.850	2.313	2,10	Serbia Government International Bond 2,050 % fällig am 23.09.2036	200	113	0,10				
1,750 % fällig am 25.05.2066	670	453	0,41	0,000 % fällig am 12.02.2031 (a)	700	517	0,47				
2,000 % fällig am 25.05.2048	6.450	4.986	4,53	1,500 % fällig am 25.03.2035	2.400	1.829	1,66				
3,250 % fällig am 25.05.2045	7.200	7.103	6,46	United Kingdom Gilt 0,125 % fällig am 30.01.2026	£ 1.900	1.933	1,76				
4,000 % fällig am 25.04.2055	2.300	2.589	2,35			59.302	53,89				
4,000 % fällig am 25.04.2060	4.600	5.285	4,80								
4,500 % fällig am 25.04.2041	3.150	3.642	3,31								
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,400 % fällig am 15.05.2030 (b)	233	204	0,19								
1,300 % fällig am 15.05.2028 (b)	842	815	0,74								

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft ⁽¹⁾	% des Nettovermögens
BPS	(1,000) %	30.12.2022	02.01.2023	€ 1.500	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0,625 % fällig am 07.01.2028	€ (1.517)	€ 1.500	€ 1.500	1,36
Summe Pensionsgeschäfte						€ (1.517)	€ 1.500	€ 1.500	1,36

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Euro-Bobl March Futures	Short	03.2023	21	€ 77	0,07
Euro-BTP Italy Government Bond March Futures	Short	03.2023	20	162	0,15
Euro-Bund 10-Year Bond March Futures	Long	03.2023	53	(441)	(0,40)
Euro-Buxl 30-Year Bond March Futures	Long	03.2023	229	(5.793)	(5,27)
Euro-OAT France Government 10-Year Bond March Futures	Long	03.2023	109	(995)	(0,91)
Euro-Schatz March Futures	Long	03.2023	41	(45)	(0,04)
U.S. Treasury 2-Year Note March Futures	Long	03.2023	29	0	0,00
U.S. Treasury 5-Year Note March Futures	Short	03.2023	10	7	0,01
U.S. Treasury 10-Year Note March Futures	Long	03.2023	37	(15)	(0,01)
U.S. Treasury 30-Year Bond March Futures	Short	03.2023	15	(1)	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond March Futures	Short	03.2023	60	49	0,04
United Kingdom Long Gilt March Futures	Long	03.2023	6	(44)	(0,04)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				€ (7.039)	(6,40)

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nennbetrag ⁽³⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
British Telecommunications PLC	1,000 %	20.12.2028	€ 100	€ (2)	0,00

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF⁽²⁾

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nennbetrag ⁽³⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
iTraxx Europe Main 38 5-Year Index	(1,000) %	20.12.2027	€ 10.400	€ (95)	(0,09)

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Euro Long Average Duration Fund (Forts.)

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung ⁽⁴⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	2,000 %	15.03.2033	£ 1.000	€ (53)	(0,05)
Erhalt ⁽⁴⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	2,000	15.03.2053	200	2	0,00
Erhalt ⁽⁴⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	2,250	15.03.2028	1.800	(14)	(0,01)
Zahlung ⁽⁴⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	2,500	15.03.2025	100	0	0,00
Zahlung	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,707	16.12.2027	1.200	0	0,00
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000	16.06.2029	¥ 147.000	19	0,02
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,050	15.12.2031	120.000	20	0,02
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,435	20.06.2029	103.000	11	0,01
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2024	\$ 9.300	(4)	0,00
Erhalt	3-Month EUR-ESTRON Compounded-OIS	0,312	08.06.2026	€ 3.200	140	0,13
Zahlung	3-Month EUR-ESTRON Compounded-OIS	0,546	28.02.2023	5.900	(21)	(0,02)
Zahlung	3-Month EUR-ESTRON Compounded-OIS	0,566	08.03.2032	1.600	2	0,00
Erhalt	3-Month EUR-ESTRON Compounded-OIS	1,000	07.07.2024	9.400	301	0,27
Erhalt	3-Month EUR-ESTRON Compounded-OIS	2,250	20.09.2024	2.900	21	0,02
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,880	25.01.2052	\$ 800	(218)	(0,20)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,000	04.11.2032	€ 3.600	(938)	(0,85)
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,000	17.03.2036	700	200	0,18
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,195	04.11.2052	650	307	0,28
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,197	08.11.2052	1.300	531	0,48
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,450	15.12.2035	9.700	(3.209)	(2,92)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,550	10.08.2024	300	(12)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,550	15.12.2040	10.800	(4.353)	(3,95)
Zahlung ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	1,500	15.03.2025	6.300	(11)	(0,01)
Zahlung ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	1,500	15.03.2028	300	(1)	0,00
Erhalt ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	1,500	15.03.2053	15.000	449	0,41
Zahlung ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	1,700	15.03.2073	100	(20)	(0,02)
Erhalt ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	1,750	15.03.2033	35.100	698	0,63
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,250	21.09.2037	11.100	(697)	(0,63)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,250	21.09.2042	12.700	(870)	(0,79)
Erhalt	CPTFEMU	3,340	15.08.2027	1.300	(9)	(0,01)
					€ (7.729)	(7,02)
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					€ (7.826)	(7,11)

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

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

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

⁽⁴⁾ Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

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

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

OPTIONSKAUF

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nennbetrag ⁽¹⁾	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
BPS	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,000 %	15.03.2023	450	€ 42	€ 229	0,21
BRC	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,410	02.02.2023	4.100	18	0	0,00
CBK	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,720	23.02.2023	800	4	0	0,00
GLM	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,200	26.04.2023	1.400	14	1	0,00
JPM	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,710	25.01.2023	900	5	0	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,000	15.03.2023	250	23	127	0,12
MYC	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,428	31.01.2023	4.100	19	0	0,00
	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,200	31.05.2023	3.900	44	4	0,00
							€ 169	€ 361	0,33

VERKAUFSOPTIONEN

DEVIENOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nennbetrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
GLM	Call - OTC EUR versus USD	\$ 0,978	13.01.2023	553	€ (14)	€ (46)	(0,04)
	Put - OTC EUR versus USD	0,978	13.01.2023	553	(14)	0	0,00
					€ (28)	€ (46)	(0,04)

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nennbetrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
BPS	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,175 %	15.03.2023	1.350	€ (41)	€ (389)	(0,36)
BRC	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,558	02.02.2023	900	(18)	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,635	30.05.2023	1.500	(47)	(12)	(0,01)
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,635	30.05.2023	1.500	(47)	(86)	(0,08)
CBK	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Erhalt	4,290	17.01.2023	700	(30)	(36)	(0,03)
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Zahlung	4,290	17.01.2023	700	(30)	(2)	0,00
GLM	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,350	26.04.2023	800	(15)	(1)	0,00
GST	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Erhalt	4,670	10.01.2023	800	(33)	(68)	(0,06)
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Zahlung	4,670	10.01.2023	800	(33)	0	0,00
JPM	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,785	25.01.2023	200	(5)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,175	15.03.2023	750	(22)	(216)	(0,20)
							€ (321)	€ (810)	(0,74)

⁽¹⁾ Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2023	€ 274	DKK 2.040	€ 0	€ 0	€ 0	0,00
	02.2023	114	AUD 176	0	(2)	(2)	0,00
	02.2023	543	NOK 5.640	0	(7)	(7)	(0,01)
	02.2023	645	\$ 680	0	(10)	(10)	(0,01)
	02.2023	£ 82	€ 92	0	0	0	0,00
	02.2023	¥ 7.700	€ 53	0	(1)	(1)	0,00
BPS	02.2023	€ 35	¥ 5.040	1	0	1	0,00
	02.2023	\$ 3.344	€ 3.225	102	0	102	0,09
BRC	01.2023	20	CNH 138	0	0	0	0,00
	02.2023	€ 154	\$ 165	0	0	0	0,00
	02.2023	\$ 1.016	€ 964	14	0	14	0,01
CBK	01.2023	DKK 1.020	€ 137	0	0	0	0,00
	02.2023	€ 552	£ 488	0	(3)	(3)	0,00
	02.2023	€ 316	\$ 330	0	(8)	(8)	(0,01)
	02.2023	\$ 447	€ 423	5	0	5	0,00
GLM	01.2023	21	CNH 143	0	0	0	0,00
JPM	01.2023	CNY 299	\$ 43	0	0	0	0,00
	01.2023	€ 229	DKK 1.705	0	0	0	0,00
	01.2023	ILS 147	\$ 43	1	0	1	0,00
	02.2023	€ 405	AUD 626	0	(8)	(8)	(0,01)
	02.2023	€ 627	£ 542	0	(18)	(18)	(0,02)
	02.2023	€ 308	\$ 326	0	(3)	(3)	0,00
	02.2023	\$ 1.779	€ 1.694	32	0	32	0,03
	03.2023	CNY 533	\$ 77	0	0	0	0,00
MBC	05.2023	CNH 1.128	€ 168	3	0	3	0,00
MYI	02.2023	AUD 797	€ 515	9	0	9	0,01
	02.2023	€ 151	£ 130	0	(4)	(4)	0,00
	02.2023	1.020	¥ 146.419	23	0	23	0,02
	02.2023	\$ 249	€ 238	5	0	5	0,01
RBC	02.2023	1.073	1.030	27	0	27	0,03
RYL	02.2023	¥ 86.000	€ 602	0	(11)	(11)	(0,01)
	02.2023	NOK 5.610	€ 541	8	0	8	0,01
SCX	01.2023	DKK 41.419	€ 5.571	1	0	1	0,00
	02.2023	€ 3.115	£ 2.738	0	(36)	(36)	(0,03)
	02.2023	131	¥ 18.900	4	0	4	0,00
	02.2023	£ 1.648	€ 1.878	24	0	24	0,02
	03.2023	€ 238	\$ 253	0	(2)	(2)	0,00
	03.2023	\$ 253	CNY 1.745	1	0	1	0,00
SSB	02.2023	£ 11.662	€ 13.288	167	0	167	0,15
UAG	02.2023	\$ 369	€ 350	5	0	5	0,01
				€ 432	€ (113)	€ 319	0,29

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

€ (176) (0,16)

Summe Anlagen

€ 95.358 86,65

Sonstige Aktiva und Passiva

€ 14.690 13,35

Nettovermögen

€ 110.048 100,00

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

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

(a) Nullkuponwertpapier.

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Euro Long Average Duration Fund (Forts.)

- (b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.
(c) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.
(d) Mit dem Fonds verbunden.
(e) Bedingt wandelbares Wertpapier.

Barmittel in Höhe von 4.192 EUR (31. Dezember 2021: 2.569 EUR) wurden zum 31. Dezember 2022 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Wertpapier mit einem Gesamtmarktwert von 0 EUR (31. Dezember 2021: 276 EUR) wurden gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen zum 31. Dezember 2022 als Sicherheiten verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	€ 0	€ 103.959	€ 0	€ 103.959
Investmentfonds	4.940	0	0	4.940
Pensionsgeschäfte	0	1.500	0	1.500
Finanzderivate ⁽³⁾	(7.079)	(7.962)	0	(15.041)
Summen	€ (2.139)	€ 97.497	€ 0	€ 95.358

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

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	€ 0	€ 155.866	€ 0	€ 155.866
Investmentfonds	407	0	0	407
Pensionsgeschäfte	0	1.236	0	1.236
Finanzderivate ⁽³⁾	(2.521)	(1.841)	0	(4.362)
Summen	€ (2.114)	€ 155.261	€ 0	€ 153.147

⁽¹⁾ Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

⁽²⁾ Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

⁽³⁾ Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2021:

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2022			Zum 31. Dez. 2021		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement ⁽¹⁾	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement ⁽¹⁾
BOA	€ (20)	€ 0	€ (20)	€ (3)	€ 0	€ (3)
BPS	(57)	190	133	(48)	0	(48)
BRC	(84)	0	(84)	(8)	0	(8)
CBK	(44)	0	(44)	(38)	0	(38)
DUB	k. A.	k. A.	k. A.	1	0	1
GLM	(46)	0	(46)	(63)	0	(63)
GSC	k. A.	k. A.	k. A.	(1)	0	(1)
GST	(68)	0	(68)	k. A.	k. A.	k. A.
HUS	k. A.	k. A.	k. A.	(95)	0	(95)
JPM	(85)	0	(85)	(15)	0	(15)
MBC	3	0	3	k. A.	k. A.	k. A.
MYC	4	0	4	(17)	(120)	(137)
MYI	33	0	33	3	0	3
RBC	27	0	27	k. A.	k. A.	k. A.
RYL	(3)	0	(3)	(350)	276	(74)
SCX	(8)	0	(8)	1	0	1
SSB	167	0	167	k. A.	k. A.	k. A.
UAG	5	0	5	64	0	64

⁽¹⁾ Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2022:

	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	87,44	95,50
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	7,03	1,55
Investmentfonds	4,49	0,25
Pensionsgeschäfte	1,36	0,77
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(6,40)	(1,57)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(7,11)	(0,79)
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,16)	(0,35)

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2022 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
Unternehmensanleihen und Wechsel	7,89	20,96
US-Regierungsbehörden	5,28	0,50
US-Schatzobligationen	3,51	2,54
Non-Agency-MBS	12,44	8,65
Forderungsbesicherte Wertpapiere	10,28	12,35
Staatsemissionen	53,89	51,74
Kurzfristige Instrumente	1,18	0,31
Investmentfonds	4,49	0,25
Pensionsgeschäfte	1,36	0,77
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(6,40)	(1,57)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,00	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	(0,09)	k. A.
Zinsswaps	(7,02)	(0,79)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Zinsswapoptionen	0,33	0,28
Verkaufsoptionen		
Devisenoptionen	(0,04)	(0,01)
Zinsswapoptionen	(0,74)	(0,55)
Optionen auf Wertpapiere	k. A.	0,00
Devisenterminkontrakte	0,29	(0,07)
Sonstige Aktiva und Passiva	13,35	4,64
Nettovermögen	100,00	100,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Euro Short-Term Fund

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS		
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				INDUSTRIEWERTE					
BANKEN UND FINANZEN				Hamburg Commercial Bank AG				American Medical Systems Europe BV					
1,500 % fällig am 17.07.2023	€ 4.200	€ 4.160	1,18	1,375 % fällig am 27.05.2025	€ 1.500	€ 1.428	0,40	0,750 % fällig am 08.03.2025	€ 300	€ 282	0,08		
American Tower Corp.	1,375 % fällig am 04.04.2025	1.100	1,038	6,250 % fällig am 18.11.2024	2.000	2.028	0,57	ArcelorMittal S.A.	1,000 % fällig am 19.05.2023	1.100	1,092	0,31	
Australia & New Zealand Banking Group Ltd.	0,250 % fällig am 17.03.2025	3.400	3,172	HSBC Holdings PLC	1,000 % fällig am 04.12.2024	983	0,28	Bacardi Ltd.	2,750 % fällig am 03.07.2023	2.192	2,187	0,62	
AyT Cedulas Cajas IV Fondo de Titulizacion de Activos	3,750 % fällig am 30.06.2025	1.100	1,102	6,500 % fällig am 20.05.2024	€ 300	343	0,10	Barry Callebaut Services NV	2,375 % fällig am 24.05.2024	400	395	0,11	
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA	2,875 % fällig am 16.07.2024	2.500	2,464	ING Bank Australia Ltd.	3,890 % fällig am 26.05.2025	AUD 1.200	761	0,22	Bayer AG	0,050 % fällig am 12.01.2025	1.200	1,119	0,32
Banco de Sabadell S.A.	1,625 % fällig am 07.03.2024	1.800	1,752	4,700 % fällig am 08.12.2025	2.400	1.516	0,43	Becton Dickinson and Co.	0,000 % fällig am 13.08.2023 (a)	3.000	2,946	0,83	
Banco Santander S.A.	2,552 % fällig am 21.11.2024	500	501	ING Groep NV	0,100 % fällig am 03.09.2025	€ 1.200	1,123	0,32	Bureau Veritas S.A.	1,250 % fällig am 07.09.2023	3.300	3,291	0,93
Bank of America Corp.	2,863 % fällig am 24.08.2025	3.300	3,288	Land Securities Capital Markets PLC	1,974 % fällig am 08.02.2026	€ 1.500	1,634	0,46	Upjohn Finance BV	2,552 % fällig am 19.05.2024	1.800	1,809	0,51
Bank of China Ltd.	3,772 % fällig am 10.08.2023	€ 5.000	5,620	Landesbank Baden-Wuerttemberg	2,000 % fällig am 24.02.2025	€ 1.200	1,056	0,30	Daimler International Finance BV	1,250 % fällig am 06.04.2025	1.300	1,231	0,35
Bank of Ireland Group PLC	1,375 % fällig am 29.08.2023	€ 1.500	1,484	LeasePlan Corp. NV	0,125 % fällig am 13.09.2023	€ 2.200	2,147	0,61	Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide	1,625 % fällig am 09.07.2024	3.200	3,098	0,88
Bank of Nova Scotia	3,050 % fällig am 31.10.2024	1.800	1,787	1,000 % fällig am 02.05.2023	1.200	1.192	0,34	Informa PLC	1,500 % fällig am 05.07.2023	1.122	1,113	0,31	
Banque Federative du Credit Mutuel S.A.	3,508 % fällig am 26.01.2025	€ 1.600	1,793	Liberty Mutual Finance Europe DAC	1,750 % fällig am 27.03.2024	3.000	2,923	0,83	InterContinental Hotels Group PLC	1,625 % fällig am 08.10.2024	1.200	1,150	0,33
Barclays PLC	3,125 % fällig am 17.01.2024	500	551	1,000 % fällig am 03.02.2025	1.000	924	0,26	Nissan Motor Co. Ltd.	1,940 % fällig am 15.09.2023	2.900	2,862	0,81	
BNP Paribas S.A.	0,500 % fällig am 15.07.2025	€ 1.200	1,140	Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.	2,264 % fällig am 14.06.2025	1.600	1,558	0,44	Ryanair DAC	1,125 % fällig am 15.08.2023	2.500	2,472	0,70
BNZ International Funding Ltd.	0,625 % fällig am 03.07.2025	6.300	5,871	3,273 % fällig am 19.09.2025	1.700	1,674	0,47	Schaeffler AG	1,875 % fällig am 26.03.2024	3.000	2,936	0,83	
CaixaBank S.A.	0,375 % fällig am 03.02.2025	2.800	2,615	Mizuh Financial Group, Inc.	0,523 % fällig am 10.06.2024	1.400	1,342	0,38	SEB S.A.	1,500 % fällig am 31.05.2024	3.000	2,869	0,81
Caja Rural de Navarra SCC	0,625 % fällig am 01.12.2023	3.000	2,929	Morgan Stanley	0,637 % fällig am 26.07.2024	2.600	2,560	0,72	Ubisoft Entertainment S.A.	1,289 % fällig am 30.01.2023	2.900	2,893	0,82
Cedulas TDA 5 Fondo de Titulizacion de Activos	3,875 % fällig am 23.05.2025	2.800	2,819	Nationwide Building Society	0,250 % fällig am 22.07.2025	1.800	1,659	0,47	Presidio Holdings, Inc.	6,092 % fällig am 15.03.2024	€ 400	374	0,11
Citigroup, Inc.	5,586 % fällig am 24.05.2025	€ 1.700	1,589	1,000 % fällig am 24.01.2023	€ 1.100	1,238	0,35	Worldline S.A.	1,625 % fällig am 13.09.2024	€ 1.500	1,445	0,41	
Clydesdale Bank PLC	4,062 % fällig am 22.03.2026	€ 1.900	2,145	Natwest Group PLC	0,750 % fällig am 15.11.2025	€ 1.500	1,404	0,40	ZF Finance GmbH	3,000 % fällig am 21.09.2025	1.300	1,201	0,34
Commonwealth Bank of Australia	4,928 % fällig am 09.12.2026	€ 2.600	2,439	2,000 % fällig am 04.03.2025	1.900	1,854	0,52	ZF North America Capital, Inc.	2,750 % fällig am 27.04.2023	800	797	0,23	
Credit Suisse AG	3,184 % fällig am 31.05.2024	€ 2.700	2,617	Nomura Holdings, Inc.	2,648 % fällig am 16.01.2025	€ 2.100	1,859	0,53			37,562	10,64	
6,500 % fällig am 08.08.2023 (c)	€ 800	728	0,21	Permanent TSB Group Holdings PLC	5,250 % fällig am 30.06.2025	€ 900	868	0,25	VERSORGUNGSUNTERNEHMEN				
Deil Bank International DAC	1,625 % fällig am 24.06.2024	€ 2.500	2,413	Sagax AB	2,000 % fällig am 17.01.2024	700	671	0,19	CK Hutchison Group Telecom Finance S.A.	0,375 % fällig am 17.10.2023	1.900	1,857	0,53
Deutsche Bank AG	1,000 % fällig am 19.11.2025	1.400	1,308	Santander UK Group Holdings PLC	2,975 % fällig am 27.03.2024	2.800	2,801	0,79	National Grid Electricity Transmission PLC	3,625 % fällig am 06.11.2023	€ 2.200	2,454	0,70
2,625 % fällig am 16.12.2024	€ 1.800	1,886	0,53	Societe Generale S.A.	1,125 % fällig am 23.01.2025	1.300	1,232	0,35	National Grid North America, Inc.	1,000 % fällig am 12.07.2024	€ 800	768	0,22
Deutsche Pfandbriefbank AG	3,994 % fällig am 26.04.2024	1.500	1,698	1,250 % fällig am 15.02.2024	2.100	2,050	0,58	SSE PLC	1,250 % fällig am 16.04.2025	1.100	1,041	0,29	
4,442 % fällig am 29.09.2023	1.000	1,131	0,32	Standard Chartered PLC	1,214 % fällig am 23.03.2025 (d)	€ 1.900	1,681	0,48	Teollisuudon Voima Oyj	2,125 % fällig am 04.02.2025	1.900	1,807	0,51
Dexia Credit Local S.A.	0,250 % fällig am 01.06.2023	€ 3.800	3,766	Sumitomo Mitsui Banking Corp.	0,550 % fällig am 06.11.2023	€ 7.300	7,129	2,02	Wintershall Dea Finance BV	0,452 % fällig am 25.09.2023	1.600	1,562	0,44
Digital Euro Finco LLC	2,625 % fällig am 15.04.2024	800	777	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.	2,550 % fällig am 10.03.2025	€ 200	177	0,05			9,489	2,69	
Eurofima Europaeische Gesellschaft fuer die Finanzierung von Eisenbahnmaterial	0,250 % fällig am 25.04.2023	1.500	1,491	4,800 % fällig am 15.09.2025	€ 400	370	0,10				56,35		
Federation des Caisses Desjardins du Quebec	2,875 % fällig am 28.11.2024	1.200	1,187	Toronto-Dominion Bank	1,707 % fällig am 28.07.2025	€ 3.100	2,971	0,84	US-REGIERUNGSBEHÖRDEN				
Ford Motor Credit Co. LLC	1,514 % fällig am 17.02.2023	1.500	1,492	3,405 % fällig am 22.04.2025	€ 1.900	2,137	0,61	Freddie Mac	0,650 % fällig am 27.10.2025	€ 3.900	3,271	0,93	
General Motors Financial Co., Inc.	5,360 % fällig am 17.11.2023	€ 600	561	TP ICAP Finance PLC	5,250 % fällig am 26.01.2024	1.500	1,652	0,47	0,800 % fällig am 28.10.2026	4.200	3,431	0,97	
Goldman Sachs Group, Inc.	0,010 % fällig am 30.04.2024	€ 1.500	1,483	UBS AG	4,565 % fällig am 09.08.2024	€ 1.400	1,303	0,37			6,702	1,90	
2,605 % fällig am 30.04.2024	1.900	1,900	0,54	UBS Group AG	1,000 % fällig am 21.03.2025	€ 2.100	2,021	0,57	NON-AGENCY-MBS				
Great-West Lifeco, Inc.	2,500 % fällig am 18.04.2023	1.200	1,199	Virgin Money UK PLC	0,375 % fällig am 27.05.2024	3.400	3,337	0,94	Blend Funding PLC	3,894 % fällig am 25.07.2058	€ 1.226	1,371	0,39
				Wells Fargo & Co.	1,338 % fällig am 04.05.2025	2.470	2,385	0,68	Ferguson Finance PLC	4,331 % fällig am 20.09.2048	3.476	3,844	1,09
				Yorkshire Building Society	0,125 % fällig am 08.05.2024	3.100	2,966	0,84					
				3,075 % fällig am 11.04.2023	2.000	1,990	0,56						
				3,000 % fällig am 18.04.2025	€ 400	433	0,12						
						151,910	43,02						

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	
William Hill PLC 4,352 % fällig am 27.08.2058	£	615	€ 686	0,19	FÖRDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE			KURZFRISTIGE INSTRUMENTE				
Ferguson Finance PLC 4,335 % fällig am 16.05.2057		284	320	0,09	Accunia European CLO DAC 2,308 % fällig am 15.10.2030			COMMERCIAL PAPER				
Cheshire PLC 4,595 % fällig am 16.05.2056		579	652	0,18	2,326 % fällig am 20.01.2031			Acciona Energia Financiacion Filiales S.A. 2,078 % fällig am 16.01.2023				
Domini BV 2,642 % fällig am 15.11.2052	€	963	966	0,27	Avoca CLO DAC 2,129 % fällig am 12.01.2031			Fiserv, Inc. 1,673 % fällig am 05.01.2023				
Dutch Property Finance BV 2,278 % fällig am 28.04.2059		136	135	0,04	BlueMountain Fuji Euro CLO DAC 2,268 % fällig am 15.04.2033			Nomura Bank International PLC 2,078 % fällig am 28.02.2023				
Eurosal PLC 4,461 % fällig am 13.06.2045	£	787	876	0,25	Black Diamond CLO Ltd. 2,316 % fällig am 20.01.2032			Alcoa Nederland Holding BV 2,099 % fällig am 30.01.2023				
Fingal Securities RMBS DAC 2,578 % fällig am 28.07.2055	€	1.688	1.684	0,48	BlueMountain Fuji Eur CLO DAC 2,028 % fällig am 15.07.2030			2,210 % fällig am 19.01.2023				
Spirit Issuer PLC 3,844 % fällig am 28.07.2047	£	1.376	1.529	0,43	BNPP AM Euro CLO BV 1,978 % fällig am 15.04.2031			FRANCE TREASURY BILLS				
William Hill PLC 4,732 % fällig am 27.05.2054		332	371	0,10	Cairn CLO DAC 2,275 % fällig am 31.01.2030			1,600 % fällig am 22.03.2023 (a)(b)				
Jubilee Place BV 2,228 % fällig am 17.01.2059	€	2.979	2.927	0,83	CVC Cordatus Loan Fund DAC 2,112 % fällig am 24.04.2034			1,612 % fällig am 22.03.2023 (a)(b)				
Kinbane DAC 2,744 % fällig am 25.09.2062		1.383	1.321	0,37	Driver Australia Six Trust 3,910 % fällig am 21.12.2027			1,625 % fällig am 22.03.2023 (a)(b)				
Lanebrook Mortgage Transaction PLC 4,487 % fällig am 12.06.2057	£	648	726	0,21	Euro-Galaxy CLO DAC 1,958 % fällig am 11.04.2031			1,784 % fällig am 15.03.2023 (a)(b)				
Mansard Mortgages PLC 4,172 % fällig am 15.12.2049		625	678	0,19	Harvest CLO DAC 2,775 % fällig am 26.06.2030							
Polaris PLC 4,732 % fällig am 23.05.2059		1.221	1.360	0,39	Jubilee CLO DAC 1,988 % fällig am 15.04.2030			GERMANY TREASURY BILLS				
Precise Mortgage Funding PLC 4,265 % fällig am 16.10.2056		44	49	0,01	Man GLG Euro CLO DAC 2,058 % fällig am 15.10.2030			1,658 % fällig am 22.03.2023 (a)(b)				
Residential Mortgage Securities PLC 4,681 % fällig am 20.06.2070		66	74	0,02	Oak Hill Credit Partners Ltd. 2,356 % fällig am 22.07.2030			HUNGARY TREASURY BILLS				
Shamrock Residential DAC 2,744 % fällig am 24.12.2059	€	2.273	2.238	0,63	Bastille Euro CLO DAC 2,198 % fällig am 15.01.2032			18,250 % fällig am 03.01.2023 (a)(b)				
Stratton Mortgage Funding PLC 3,826 % fällig am 20.07.2060	£	2.954	3.301	0,93	OZLME DAC 2,613 % fällig am 24.08.2030			IRELAND TREASURY BILLS				
Towd Point Mortgage Funding PLC 3,596 % fällig am 20.10.2051		1.700	1.871	0,53	Palmer Square European Loan Funding DAC 2,098 % fällig am 15.10.2031			0,022 % fällig am 04.01.2023 (a)(b)				
4,826 % fällig am 20.07.2045		336	374	0,11	2,108 % fällig am 15.07.2031			0,851 % fällig am 02.03.2023 (a)(b)				
4,071 % fällig am 20.10.2051		965	1.081	0,31	2,158 % fällig am 15.04.2031			0,913 % fällig am 05.04.2023 (a)(b)				
4,190 % fällig am 20.02.2045		2.359	2.623	0,74	Toro European CLO DAC 2,118 % fällig am 15.10.2030			1,203 % fällig am 02.03.2023 (a)(b)				
4,471 % fällig am 20.02.2054		1.628	1.828	0,52	Holland Park CLO DAC 2,218 % fällig am 15.01.2031			5,800				
Tower Bridge Funding PLC 4,801 % fällig am 20.09.2063		1.017	1.145	0,32	STAATSEMISSIONEN			3,146				
Trinity Square PLC 3,729 % fällig am 15.07.2059		4.752	5.294	1,50	Development Bank of Japan, Inc. 0,010 % fällig am 15.10.2024			0,89				
Tudor Rose Mortgages PLC 4,031 % fällig am 20.06.2048		1.988	2.210	0,63	Korea Housing Finance Corp. 0,010 % fällig am 05.02.2025							
Twin Bridges PLC 4,386 % fällig am 12.09.2050		474	533	0,15	0,723 % fällig am 22.03.2025							
					Poland Government International Bond 0,000 % fällig am 07.07.2023							
					(a)							
		50.282	14,24					Summe kurzfristige Instrumente				
								36.741				
								10,41				
								Summe Übertragbare Wertpapiere				
								€ 330.698				
								93,66				

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kapitalbetrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensionsgeschäfte zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft ⁽¹⁾	% des Nettovermögens
BPS	(1,000) %	30.12.2022	02.01.2023	€ 14.100	ABN BNG Bank NV 0,875 % fällig am 24.10.2036	€ (14.286)	€ 14.100	€ 14.099	3,99
Summe Pensionsgeschäfte						€ (14.286)	€ 14.100	€ 14.099	3,99

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Euro Short-Term Fund (Forts.)

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

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Euro-Bobl March Futures	Short	03.2023	567	€ 1.923	0,54
Euro-Schatz March Futures	Short	03.2023	404	551	0,16
				€ 2.474	0,70
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				€ 2.474	0,70

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AT&T, Inc.	1,000 %	20.06.2024	\$ 1.000	€ 1	0,00

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	3-Month EUR-ESTRON Compounded-OIS	1,250 %	13.03.2023	€ 370.000	€ (87)	(0,02)
Zahlung ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	1,500	15.03.2025	29.700	(427)	(0,12)
Zahlung ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	1,500	15.03.2028	55.900	(1.088)	(0,31)
					€ (1.602)	(0,45)
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					€ (1.601)	(0,45)

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

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

⁽³⁾ Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

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

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

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
BOA	02.2023	AUD	280	€ 181	€ 3	€ 3	0,00	
	02.2023	¥	12.600	87	0	(2)	0,00	
	03.2023	ILS	5.752	\$ 1.695	56	0	56	0,02
BPS	01.2023	HUF	231.164	604	0	(11)	0,00	
	02.2023	€	79	¥ 11.422	2	0	2	0,00
BRC	01.2023	£	339	€ 392	10	0	10	0,00
	01.2023	HUF	352.829	\$ 920	0	(19)	(19)	(0,01)
CBK	01.2023	\$	170	€ 159	0	0	0	0,00
	01.2023	€	3.143	£ 2.714	0	(85)	(85)	(0,02)
	01.2023	ILS	3.999	\$ 1.269	127	0	127	0,04
JPM	04.2023		1.763	540	35	0	35	0,01
	01.2023		263	77	2	0	2	0,00
	02.2023	AUD	3.372	€ 2.154	14	0	14	0,00
MBC	02.2023	€	556	¥ 80.200	15	0	15	0,00
	01.2023		8.514	\$ 9.032	0	(55)	(55)	(0,02)
	01.2023	¥	1.200.000	€ 8.354	0	(177)	(177)	(0,05)
MYI	01.2023	\$	35.054	33.428	597	0	597	0,17
	02.2023	AUD	5	3	0	0	0	0,00
	03.2023	ILS	322	\$ 98	6	0	6	0,00
	01.2023	€	1.679	£ 1.449	0	(46)	(46)	(0,01)
	01.2023		1.808	\$ 1.893	0	(35)	(35)	(0,01)
RBC	01.2023	\$	1.841	€ 1.746	21	0	21	0,01
	02.2023	€	2.311	¥ 331.808	52	0	52	0,01
	02.2023	¥	70.200	€ 483	0	(17)	(17)	0,00
	01.2023		1.830.000	12.805	0	(191)	(191)	(0,05)
	02.2023		79.300	565	1	0	1	0,00

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
SCX	01.2023	€ 1.397	£ 1.221	€ 0	€ (21)	€ (21)	(0,01)
	01.2023	€ 65.278	€ 75.547	1.993	0	1.993	0,56
UAG	01.2023	€ 1.865	£ 1.613	0	(48)	(48)	(0,01)
	01.2023	HUF 55.579	\$ 145	0	(3)	(3)	0,00
				€ 2.934	€ (710)	€ 2.224	0,63
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						€ 2.224	0,63
Summe Anlagen						€ 347.895	98,53
Sonstige Aktiva und Passiva						€ 5.200	1,47
Nettovermogen						€ 353.095	100,00

ERLAUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend*):

* Auf null lautende Saldi konnen fur faktisch vorhandene Betrage stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

- (a) Nullkuponwertpapier.
 (b) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfalligkeit dar.
 (c) Bedingt wandelbares Wertpapier.
 (d) Eingeschrankte Wertpapiere:

Emittentenbeschreibung	Kupon	Falligkeitsdatum	Kaufdatum	Kosten	Marktwert	% des Nettovermogens
Standard Chartered PLC	1,214 %	23.03.2025	21.10.2022 - 24.10.2022	€ 1.793	€ 1.681	0,48

Barmittel in Hoh€e von 6.376 EUR (31. Dezember 2021: 2.551 EUR) wurden zum 31. Dezember 2022 als Sicherheit fur borsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfand€et.

Barmittel in Hoh€e von 20 EUR (31. Dezember 2021: 2.340 EUR) wurden zum 31. Dezember 2022 als Sicherheit fur borsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfand€et.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Markten notierte Kurse fur identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Ubertragbare Wertpapiere	€ 0	€ 330.698	€ 0	€ 330.698
Pensionsgeschafte	0	14.100	0	14.100
Finanzderivate ⁽³⁾	2.474	623	0	3.097
Summen	€ 2.474	€ 345.421	€ 0	€ 347.895

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

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Markten notierte Kurse fur identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Ubertragbare Wertpapiere	€ 0	€ 595.961	€ 0	€ 595.961
Pensionsgeschafte	0	26.537	0	26.537
Finanzderivate ⁽³⁾	328	(957)	0	(629)
Summen	€ 328	€ 621.541	€ 0	€ 621.869

⁽¹⁾ Zwecks zusatzlicher Informationen siehe Erlauterung 3 in den Erlauterungen zum Abschluss.

⁽²⁾ Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

⁽³⁾ Finanzderivate konnen offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Sicherheiten (erhalten)/verpfand€et fur OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfand€et zum 31. Dezember 2021:

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2022			Zum 31. Dez. 2021		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfand€et	Netto-Engagement ⁽¹⁾	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfand€et	Netto-Engagement ⁽¹⁾
BOA	€ 57	€ 0	€ 57	€ (5)	€ 0	€ (5)
BPS	(9)	0	(9)	(165)	240	75
BRC	(9)	0	(9)	327	0	327
CBK	77	0	77	(355)	330	(25)
GLM	k. A.	k. A.	k. A.	20	0	20
HUS	k. A.	k. A.	k. A.	93	0	93

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2022			Zum 31. Dez. 2021		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement ⁽¹⁾	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement ⁽¹⁾
JPM	€ 31	€ 0	€ 31	€ (32)	€ 0	€ (32)
MBC	371	(230)	141	k. A.	k. A.	k. A.
MYI	(25)	0	(25)	k. A.	k. A.	k. A.
RBC	(190)	20	(170)	k. A.	k. A.	k. A.
RYL	k. A.	k. A.	k. A.	0	840	840
SCX	1.972	(1.890)	82	(908)	930	22
SOG	k. A.	k. A.	k. A.	4	0	4
UAG	(51)	0	(51)	37	0	37

⁽¹⁾ Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2022:

	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	82,88	85,00
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	10,78	9,62
Pensionsgeschäfte	3,99	4,21
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,70	0,05
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,45)	0,01
Freiverkehrfinanzderivate	0,63	(0,16)

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2022 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
Unternehmensanleihen und Wechsel	56,35	56,96
US-Regierungsbehörden	1,90	1,10
Non-Agency-MBS	14,24	8,63
Forderungsbesicherte Wertpapiere	6,88	10,12
Staatsemissionen	3,88	6,66
Kurzfristige Instrumente	10,41	11,15
Pensionsgeschäfte	3,99	4,21
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,70	0,05
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,00	0,00
Zinsswaps	(0,45)	0,01
Freiverkehrfinanzderivate		
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes	k. A.	0,00
Devisenterminkontrakte	0,63	(0,16)
Sonstige Aktiva und Passiva	1,47	1,27
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE			
CAYMAN INSELN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Kaisa Group Holdings Ltd. 9,750 % fällig am 28.09.2023 ^	\$ 300	€ 40	0,02
CHINA			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Yango Justice International Ltd. 8,250 % fällig am 25.11.2023 ^	300	10	0,01
TSCHECHISCHE REPUBLIK			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
EP Infrastructure A/S 1,659 % fällig am 26.04.2024	€ 700	623	0,36
1,698 % fällig am 30.07.2026	1.900	1.518	0,87
Summe Tschechische Republik		2.141	1,23
DÄNEMARK			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
DKT Finance ApS 7,000 % fällig am 17.06.2023	1.000	997	0,57
Norican A/S 4,500 % fällig am 15.05.2023	1.100	1.041	0,60
TDC A/S 5,056 % fällig am 31.05.2028	300	295	0,17
Summe Dänemark		2.333	1,34
FRANKREICH			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Accor S.A. 2,375 % fällig am 29.11.2028	900	772	0,44
2,625 % fällig am 30.01.2025 (d)	500	415	0,24
4,375 % fällig am 30.01.2024 (d)	500	473	0,27
Altice France S.A. 2,125 % fällig am 15.02.2025	1.400	1.242	0,71
2,500 % fällig am 15.01.2025	800	721	0,41
BNP Paribas S.A. 7,750 % fällig am 16.08.2029 (d)(f)	\$ 700	649	0,37
CAB SELAS 3,375 % fällig am 01.02.2028	€ 1.100	887	0,51
Chrome Bidco SASU 3,500 % fällig am 31.05.2028	300	253	0,15
Electricite de France S.A. 2,625 % fällig am 01.12.2027 (d)	1.000	783	0,45
2,875 % fällig am 15.12.2026 (d)	1.800	1.481	0,85
3,375 % fällig am 15.06.2030 (d)	1.000	729	0,42
4,000 % fällig am 04.07.2024 (d)	700	658	0,38
5,625 % fällig am 22.01.2024 (d)	\$ 800	710	0,41
Elior Group S.A. 3,750 % fällig am 15.07.2026	€ 1.100	933	0,54
Faurecia SE 2,750 % fällig am 15.02.2027	2.400	2.034	1,17
Iliad S.A. 5,375 % fällig am 14.06.2027	2.700	2.689	1,54
Loxam S.A.S. 2,875 % fällig am 15.04.2026	500	447	0,26
3,250 % fällig am 14.01.2025	700	669	0,38
4,500 % fällig am 15.02.2027	300	275	0,16
4,500 % fällig am 15.04.2027	400	338	0,19
Renault S.A. 1,125 % fällig am 04.10.2027	2.000	1.613	0,93
2,500 % fällig am 02.06.2027	600	523	0,30
Rexel S.A. 2,125 % fällig am 15.12.2028	200	174	0,10
Valeo 5,375 % fällig am 28.05.2027	300	293	0,17
Vallourec S.A. 8,500 % fällig am 30.06.2026	800	787	0,45
Verallia S.A. 1,875 % fällig am 10.11.2031	800	626	0,36
Summe Frankreich		21.174	12,16

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
DEUTSCHLAND			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Cheplapharm Arzneimittel GmbH 3,500 % fällig am 11.02.2027	€ 900	€ 791	0,45
4,375 % fällig am 15.01.2028	100	88	0,05
Clearstream Banking AG 0,000 % fällig am 01.12.2025 (b)	100	91	0,05
Commerzbank AG 4,000 % fällig am 05.12.2030	1.300	1.225	0,70
CT Investments GmbH 5,500 % fällig am 15.04.2026	600	534	0,31
Ctec GmbH 5,250 % fällig am 15.02.2030	200	167	0,10
Deutsche Bank AG 5,625 % fällig am 19.05.2031	500	489	0,28
10,000 % fällig am 01.12.2027 (d)(f)	400	415	0,24
IHO Verwaltungs GmbH (3,875 % bar oder 4,625 % PIK) 3,875 % fällig am 15.05.2027 (a)	1.200	1.018	0,58
IHO Verwaltungs GmbH (6,375 % bar oder 7,125 % PIK) 6,375 % fällig am 15.05.2029 (a)	\$ 1.400	1.111	0,64
Nidda Healthcare Holding GmbH 7,500 % fällig am 21.08.2026	€ 2.200	2.108	1,21
Techem Verwaltungsgesellschaft mbH 2,000 % fällig am 15.07.2025	1.400	1.291	0,74
ZF Finance GmbH 2,250 % fällig am 03.05.2028	500	392	0,23
2,750 % fällig am 25.05.2027	2.800	2.366	1,36
Summe Deutschland		12.086	6,94
IRLAND			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Bank of Ireland Group PLC 7,500 % fällig am 19.05.2025 (d)(f)	1.000	974	0,56
Permanent TSB Group Holdings PLC 3,000 % fällig am 19.08.2031	1.000	819	0,47
Summe Irland		1.793	1,03
INSEL MAN			
KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG			
GVC Holdings PLC 4,398 % fällig am 29.03.2024	1.800	1.786	1,03
ITALIEN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Atlantia SpA 1,875 % fällig am 12.02.2028	4.900	4.085	2,35
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 1,875 % fällig am 09.01.2026	900	774	0,45
5,375 % fällig am 18.01.2028	600	485	0,28
10,500 % fällig am 23.07.2029	100	93	0,05
Castor SpA 6,000 % fällig am 15.02.2029	600	538	0,31
FIS Fabbrica Italiana Sintetici SpA 5,625 % fällig am 01.08.2027	900	721	0,41
Inter Media and Communication SpA 6,750 % fällig am 09.02.2027	2.000	1.901	1,09
Intesa Sanpaolo SpA 6,375 % fällig am 30.03.2028 (d)(f)	400	344	0,20
8,248 % fällig am 21.11.2033	\$ 2.100	2.002	1,15
Nexi SpA 2,125 % fällig am 30.04.2029	€ 1.900	1.547	0,89
Telecom Italia SpA 1,625 % fällig am 18.01.2029	600	460	0,26
UniCredit SpA 6,625 % fällig am 03.06.2023 (d)(f)	600	582	0,33
7,500 % fällig am 03.06.2026 (d)(f)	700	682	0,39
Summe Italien		14.214	8,16
JAPAN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
SoftBank Group Corp. 3,375 % fällig am 06.07.2029	400	296	0,17
4,000 % fällig am 19.09.2029	700	537	0,31

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
5,000 % fällig am 15.04.2028	€ 1.000	€ 853	0,49
Summe Japan		1.686	0,97
JERSEY, KANALINSELN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Adient Global Holdings Ltd. 3,500 % fällig am 15.08.2024	1.900	1.828	1,05
HSBC Bank Capital Funding Sterling LP 5,844 % fällig am 05.11.2031 (d)	£ 250	289	0,17
HSBC Capital Funding Dollar LP 10,176 % fällig am 30.06.2030 (d)	\$ 100	113	0,06
Summe Jersey, Kanalinseln		2.230	1,28
LUXEMBURG			
WANDELANLEIHEN & WECHSEL			
Corestate Capital Holding S.A. 1,375 % fällig am 28.11.2049 ^	€ 200	37	0,02
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Lincoln Financing SARL 5,250 % fällig am 15.10.2026	900	790	0,45
Altice Financing S.A. 3,000 % fällig am 15.01.2028	1.200	951	0,55
Altice France Holding S.A. 8,000 % fällig am 15.05.2027	550	408	0,23
ARD Finance PLC (5,000 % bar und 5,750 % PIK) 5,000 % fällig am 30.06.2027 (a)	600	406	0,23
ARD Finance PLC (6,500 % bar und 7,250 % PIK) 6,500 % fällig am 30.06.2027 (a)	\$ 700	457	0,26
Cidron Aida SARL 5,000 % fällig am 01.04.2028	€ 400	345	0,20
6,250 % fällig am 01.04.2028	£ 500	461	0,26
Cirsa Finance International SARL 4,500 % fällig am 15.03.2027	€ 500	433	0,25
4,750 % fällig am 22.05.2025	800	759	0,44
Corestate Capital Holding S.A. 3,500 % fällig am 15.04.2023 ^	300	47	0,03
CPI Property Group S.A. 4,875 % fällig am 16.07.2025 (d)	1.000	509	0,29
4,875 % fällig am 18.08.2026 (d)	400	203	0,12
InPost S.A. 2,250 % fällig am 15.07.2027	900	747	0,43
LHMC Finco 2 SARL (7,250 % bar oder 8,000 % PIK) 7,250 % fällig am 02.10.2025 (a)	400	347	0,20
Loarre Investments SARL 6,500 % fällig am 15.05.2029	900	835	0,48
Logicor Financing SARL 0,750 % fällig am 15.07.2024	300	276	0,16
2,250 % fällig am 13.05.2025	1.500	1.373	0,79
PLT Finance SARL 4,625 % fällig am 05.01.2026	1.000	945	0,54
Rossini SARL 6,750 % fällig am 30.10.2025	1.000	994	0,57
Signa Development Finance SCS 5,500 % fällig am 23.07.2026	600	376	0,22
Summer BC Holdco SARL 5,750 % fällig am 31.10.2026	2.350	2.012	1,15
Telecom Italia Capital S.A. 6,375 % fällig am 15.11.2033	\$ 700	538	0,31
Empark Funding S.A. 3,875 % fällig am 02.02.2026	€ 800	760	0,44
		14.972	8,60
Summe Luxemburg		15.009	8,62
MULTINATIONAL			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Clarios Global LP 4,375 % fällig am 15.05.2026	1.000	927	0,53
NIEDERLANDE			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Axalta Coating Systems Dutch Holding B BV 3,750 % fällig am 15.01.2025	900	865	0,50

Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO European High Yield Bond Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
CTP NV				9,750 % fällig am 23.06.2027 (d)(f) \$	800	€ 655	0,37	Graphic Packaging International LLC			
0,500 % fällig am 21.06.2025	€ 1.000	€ 840	0,48					2,625 % fällig am 01.02.2029	€ 300	€ 263	0,15
Dufry One BV				Summe Schweiz		1.574	0,90	IQVIA, Inc.			
2,000 % fällig am 15.02.2027	1.300	1.068	0,61	GROSSBRITANNIEN				2,250 % fällig am 15.03.2029	1.000	846	0,49
3,625 % fällig am 15.04.2026	CHF 1.300	1.159	0,67	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Olympus Water U.S. Holding Corp.			
Energizer Gamma Acquisition BV				Barclays PLC				3,875 % fällig am 01.10.2028	1.000	815	0,47
3,500 % fällig am 30.06.2029	€ 1.000	804	0,46	8,875 % fällig am 15.09.2027 (d)(f) £	300	334	0,19	5,375 % fällig am 01.10.2029	400	292	0,17
Sigma Holdco BV				Anglian Water Services Financing PLC				Organon & Co.			
5,750 % fällig am 15.05.2026	300	217	0,12	4,750 % fällig am 30.11.2028	€ 600	505	0,29	2,875 % fällig am 30.04.2028	1.100	967	0,55
Summer BidCo BV (9,000 % bar oder 9,750 % PIK)				6,750 % fällig am 30.11.2029	500	372	0,21	Rio Oil Finance Trust			
9,000 % fällig am 15.11.2025 (a)	346	252	0,14	Bellis Acquisition Co. PLC				8,200 % fällig am 06.04.2028	\$ 1.447	1.376	0,79
Telefonica Europe BV				3,250 % fällig am 16.02.2026	€ 1.400	1.290	0,74	Standard Industries, Inc.			
7,125 % fällig am 23.08.2028 (d)	400	410	0,23	Diageo Capital PLC				2,250 % fällig am 21.11.2026	€ 1.200	1.031	0,59
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV				5,000 % fällig am 01.12.2026	700	696	0,40	WMG Acquisition Corp.			
1,875 % fällig am 31.03.2027	3.400	2.746	1,58	EnQuest PLC				2,250 % fällig am 15.08.2031	1.500	1.179	0,68
4,500 % fällig am 01.03.2025	600	577	0,33	11,625 % fällig am 01.11.2027	\$ 400	353	0,20				
TMNL Holding BV				Gatwick Airport Finance PLC							
3,750 % fällig am 15.01.2029	550	483	0,28	4,375 % fällig am 07.04.2026	€ 1.500	1.530	0,88				
United Group BV				Cairn Energy PLC							
3,625 % fällig am 15.02.2028	1.000	727	0,42	5,500 % fällig am 15.10.2026	\$ 800	673	0,39				
ZF Europe Finance BV				Heathrow Finance PLC							
2,000 % fällig am 23.02.2026	500	432	0,25	3,875 % fällig am 01.03.2027	€ 400	382	0,22				
				4,125 % fällig am 01.09.2029	1.114	945	0,54				
				INEOS Finance PLC							
	10.580	6.07		3,375 % fällig am 15.01.2026	\$ 1.900	1.638	0,94	KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG			
KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG				Jaguar Land Rover Automotive PLC				INEOS Finance PLC			
Starfruit Finco BV				4,500 % fällig am 15.01.2026	€ 800	691	0,40	3,896 % fällig am 01.04.2024	2.549	2.545	1,46
5,052 % fällig am 01.10.2025	944	903	0,52	4,500 % fällig am 15.07.2028	400	305	0,17	Summe USA		14.720	8,45
Summe Niederlande		11.483	6,59	Market Bidco Finco PLC							
PANAMA				4,750 % fällig am 04.11.2027	1.600	1.291	0,74	KURZFRISTIGE INSTRUMENTE			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Marks & Spencer PLC				Treasury Bills des europäischen Stabilitätsmechanismus			
Carnival Corp.				3,750 % fällig am 19.05.2026	€ 700	690	0,40	1,541 % fällig am 09.02.2023 (b)(c)	500	499	0,29
10,125 % fällig am 01.02.2026	1.300	1.296	0,74	Rolls-Royce PLC				EUROPEAN UNION TREASURY BILLS			
SPANIEN				0,875 % fällig am 09.05.2024	€ 600	566	0,32	1,217 % fällig am 06.01.2023 (b)(c)	900	900	0,52
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				4,625 % fällig am 16.02.2026	2.100	2.042	1,18	1,350 % fällig am 03.02.2023 (b)(c)	1.900	1.898	1,09
Banco Santander S.A.				Travis Perkins PLC				1,756 % fällig am 03.03.2023 (b)(c)	6.290	6.272	3,60
4,375 % fällig am 14.01.2026 (d)(f)	600	511	0,29	3,750 % fällig am 17.02.2026	€ 500	501	0,29	1,866 % fällig am 07.04.2023 (b)(c)	300	298	0,17
CaixaBank S.A.				Victoria PLC				1,876 % fällig am 07.04.2023 (b)(c)	1.100	1.094	0,63
5,875 % fällig am 09.10.2027 (d)(f)	800	735	0,42	3,625 % fällig am 24.08.2026	€ 700	577	0,33				
Cellnex Finance Co. S.A.				3,750 % fällig am 15.03.2028	200	157	0,09				
1,500 % fällig am 08.06.2028	2.000	1.669	0,96	Virgin Media Secured Finance PLC							
2,000 % fällig am 15.09.2032	1.300	969	0,56	4,250 % fällig am 15.01.2030	€ 1.600	1.407	0,81				
2,000 % fällig am 15.02.2033	200	148	0,08	Virgin Money UK PLC							
Cellnex Telecom S.A.				9,250 % fällig am 08.06.2024 (d)(f)	800	903	0,52				
1,750 % fällig am 23.10.2030	200	156	0,09	Vmed O2 UK Financing PLC							
Summe Spanien		4.188	2,40	3,250 % fällig am 31.01.2031	€ 800	639	0,37				
SCHWEDEN				4,000 % fällig am 31.01.2029	€ 700	618	0,35				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				4,250 % fällig am 31.01.2031	\$ 200	152	0,09				
Dometic Group AB				Drax Finco PLC							
2,000 % fällig am 29.09.2028	1.000	794	0,46	6,500 % fällig am 30.06.2027	€ 800	707	0,41				
Intrum AB											
3,125 % fällig am 15.07.2024	313	302	0,17								
4,875 % fällig am 15.08.2025	1.100	1.005	0,58								
9,250 % fällig am 15.03.2028	1.800	1.784	1,02								
Verisure Holding AB											
3,250 % fällig am 15.02.2027	1.700	1.480	0,85								
3,875 % fällig am 15.07.2026	300	273	0,16								
Verisure Holding AB											
5,250 % fällig am 15.02.2029	700	562	0,32								
Volvo Treasury AB											
4,250 % fällig am 31.05.2028	900	829	0,48								
Summe Schweden		7.029	4,04								
SCHWEIZ											
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL											
Credit Suisse Group AG											
6,442 % fällig am 11.08.2028	\$ 400	342	0,20								
9,016 % fällig am 15.11.2033	600	577	0,33								

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft ⁽¹⁾	% des Nettovermögens
BPS	(1,000) %	30.12.2022	02.01.2023	€ 3.700	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0,625 % fällig am 07.01.2028	€ (3.743)	€ 3.700	€ 3.700	2,12
Summe Pensionsgeschäfte						€ (3.743)	€ 3.700	€ 3.700	2,12

⁽¹⁾ Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Euro-Bobl March Futures	Long	03.2023	59	€ (252)	(0,14)
Euro-Bund 10-Year Bond March Futures	Short	03.2023	5	14	0,01
Euro-Schatz March Futures	Long	03.2023	380	(531)	(0,31)
U.S. Treasury 2-Year Note March Futures	Short	03.2023	24	3	0,00
U.S. Treasury 5-Year Note March Futures	Short	03.2023	4	1	0,00
U.S. Treasury 10-Year Note March Futures	Short	03.2023	9	17	0,01
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond March Futures	Short	03.2023	16	57	0,03
				€ (691)	(0,40)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				€ (691)	(0,40)

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Jaguar Land Rover Automotive PLC	5,000 %	20.12.2027	€ 100	€ (3)	(0,01)
United Group BV	5,000	20.12.2027	700	9	0,01
				€ 6	0,00

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
iTraxx Crossover 38 5-Year Index	5,000 %	20.12.2027	€ 17.800	€ 304	0,17

ZINSSWAPS

Zahlung/Erhalt	variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fest-Zinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung ⁽³⁾	1-Day GBP-SONIO	Compounded-OIS	2,250 %	15.03.2028	£ 1.600	€ (47)	(0,03)
Zahlung ⁽³⁾	1-Day GBP-SONIO	Compounded-OIS	2,500	15.03.2025	5.400	(16)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate	Compounded-OIS	1,750	15.06.2027	\$ 2.100	81	0,05
Erhalt	3-Month USD-LIBOR		1,000	16.12.2025	3.800	428	0,25
Erhalt	3-Month USD-LIBOR		1,000	16.12.2030	3.000	540	0,31
						€ 986	0,57
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate						€ 1.296	0,74

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

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

⁽³⁾ Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO European High Yield Bond Fund (Forts.)

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

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

VERKAUFSOPTIOMEN

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nennbetrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,018 %	20.10.2023	1.300	€ (8)	€ (1)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,018	20.10.2023	1.300	€ (8)	€ (16)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,140	23.10.2023	1.300	€ (9)	€ (2)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,140	23.10.2023	1.300	€ (9)	€ (14)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,190	23.10.2023	1.300	€ (8)	€ (2)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,190	23.10.2023	1.300	€ (8)	€ (14)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,225	23.10.2023	1.300	€ (8)	€ (2)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,225	23.10.2023	1.300	€ (8)	€ (14)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,973	25.10.2023	1.300	€ (8)	€ (1)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,973	25.10.2023	1.300	€ (8)	€ (16)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,841	27.10.2023	1.300	€ (9)	€ (1)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,841	27.10.2023	1.300	€ (8)	€ (17)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,088	03.11.2023	400	€ (3)	€ (1)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,088	03.11.2023	400	€ (3)	€ (4)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,721	08.04.2024	100	€ (1)	€ 0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,721	08.04.2024	100	€ (1)	€ (1)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,547	07.03.2023	1.500	€ (31)	€ (3)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,547	07.03.2023	1.500	€ (31)	€ (89)	(0,05)
							€ (169)	€ (198)	(0,12)

⁽¹⁾ Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag ⁽²⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BPS	Deutsche Bank AG	1,000 %	20.06.2027	€ 600	€ (81)	€ 43	€ (38)	(0,02)

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

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

DEWISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2023	€ 895	\$ 945	€ 0	€ (11)	€ (11)	(0,01)
BPS	01.2023	\$ 1.887	€ 1.783	16	0	16	0,01
BRC	01.2023	£ 2.524	€ 2.924	80	0	80	0,05
CBK	01.2023	€ 213	\$ 226	0	(1)	(1)	0,00
	01.2023	£ 557	€ 647	20	0	20	0,01
	01.2023	\$ 165	€ 155	0	0	0	0,00
MBC	01.2023	CHF 68	€ 69	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 14.752	€ 14.046	230	0	230	0,13
MYI	01.2023	€ 448	\$ 469	0	(8)	(8)	0,00
	01.2023	£ 31	€ 35	0	0	0	0,00
SCX	01.2023	CHF 1.147	€ 1.167	5	0	5	0,00
	01.2023	£ 6.628	€ 7.671	202	0	202	0,12
				€ 553	€ (20)	€ 533	0,31
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						€ 297	0,17
Summe Anlagen						€ 170.524	97,91
Sonstige Aktiva und Passiva						€ 3.638	2,09
Nettovermögen						€ 174.162	100,00

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

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

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.

(b) Nullkuponwertpapier.

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

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

(e) Mit dem Fonds verbunden.

(f) Bedingt wandelbares Wertpapier.

Barmittel in Höhe von 2.986 EUR (31. Dezember 2021: 897 EUR) wurden zum 31. Dezember 2022 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	€ 0	€ 157.222	€ 0	€ 157.222
Investmentfonds	8.700	0	0	8.700
Pensionsgeschäfte	0	3.700	0	3.700
Finanzderivate ⁽³⁾	(769)	1.671	0	902
Summen	€ 7.931	€ 162.593	€ 0	€ 170.524

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

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	€ 0	€ 154.011	€ 0	€ 154.011
Investmentfonds	0	9.575	0	9.575
Pensionsgeschäfte	0	4.900	0	4.900
Finanzderivate ⁽³⁾	(140)	203	0	63
Summen	€ (140)	€ 168.689	€ 0	€ 168.549

⁽¹⁾ Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.⁽²⁾ Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.⁽³⁾ Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.**Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2021:

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2022			Zum 31. Dez. 2021		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement ⁽¹⁾	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- Engagement ⁽¹⁾
BOA	€ (11)	€ 0	€ (11)	€ k. A.	€ k. A.	€ k. A.
BPS	(22)	0	(22)	k. A.	k. A.	k. A.
BRC	80	0	80	k. A.	k. A.	k. A.
CBK	19	0	19	k. A.	k. A.	k. A.
GLM	(198)	0	(198)	5	0	5
MBC	230	0	230	k. A.	k. A.	k. A.
MYI	(8)	0	(8)	(4)	0	(4)
SCX	207	0	207	44	0	44

⁽¹⁾ Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.**Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2022:

	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	80,86	74,05
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	8,16	11,84
Sonstige übertragbare Wertpapiere	1,26	4,44
Investmentfonds	5,00	5,62
Pensionsgeschäfte	2,12	2,87
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,40)	(0,08)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,74	0,09
Freiverkehrsfonds	0,17	0,03

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2022 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
Österreich	k. A.	0,47
Cayman-Inseln	0,02	0,04
China	0,01	0,85
Tschechische Republik	1,23	k. A.
Dänemark	1,34	0,60
Frankreich	12,16	11,44
Deutschland	6,94	7,90
Irland	1,03	1,27
Insel Man	1,03	1,04
Italien	8,16	6,64
Japan	0,97	1,24
Jersey, Kanalinseln	1,28	2,07
Luxemburg	8,62	11,64
Mexiko	k. A.	1,04
Multinational	0,53	0,35
Niederlande	6,59	8,64
Panama	0,74	0,87
Rumänien	k. A.	0,98
Spanien	2,40	0,42
Schweden	4,04	4,00
Schweiz	0,90	k. A.
Großbritannien	12,74	9,73
USA	8,45	18,63
Kurzfristige Instrumente	11,10	0,47
Investmentfonds	5,00	5,62
Pensionsgeschäfte	2,12	2,87
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,40)	(0,08)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,00	k. A.
Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf	0,17	(0,01)
Zinsswaps	0,57	0,10
Freiverkehrsfinanzderivate		
Verkaufsoptionen		
Zinsswapoptionen	(0,12)	k. A.
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	(0,02)	k. A.
Devisenterminkontrakte	0,31	0,03
Sonstige Aktiva und Passiva	2,09	1,14
Nettovermögen	100,00	100,00

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft ⁽¹⁾	% des Nettovermögens
BPS	(1,000) %	30.12.2022	02.01.2023	€ 4.400	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0,625 % fällig am 07.01.2028	€ (4.454)	€ 4.400	€ 4.400	2,08
Summe Pensionsgeschäfte						€ (4.454)	€ 4.400	€ 4.400	2,08

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 146,000 EUR auf Euro-Bund 10-Year					
Bond February 2023 Futures	Short	01.2023	5	€ 4	0,00
Euro-Bobl March Futures	Long	03.2023	69	(229)	(0,11)
Euro-BTP Italy Government Bond March Futures	Short	03.2023	67	539	0,26
Euro-Bund 10-Year Bond March Futures	Short	03.2023	54	206	0,10
Euro-Buxl 30-Year Bond March Futures	Short	03.2023	56	1.145	0,53
Euro-OAT France Government 10-Year Bond March Futures	Short	03.2023	1	9	0,00
Euro-Schatz March Futures	Long	03.2023	387	(541)	(0,26)
Japan Government 10-Year Bond March Futures	Long	03.2023	1	(9)	0,00
Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 138,500 EUR auf Euro-Bund 10-Year					
Bond February 2023 Futures	Short	01.2023	5	(24)	(0,01)
U.S. Treasury 2-Year Note March Futures	Short	03.2023	11	0	0,00
U.S. Treasury 5-Year Note March Futures	Long	03.2023	47	(72)	(0,03)
U.S. Treasury 10-Year Note March Futures	Long	03.2023	154	(87)	(0,04)
U.S. Treasury 30-Year Bond March Futures	Short	03.2023	20	(1)	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond March Futures	Short	03.2023	162	156	0,07
United Kingdom Long Gilt March Futures	Long	03.2023	50	(368)	(0,17)
				€ 728	0,34
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				€ 728	0,34

(1) Future-Style-Option.

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF⁽¹⁾

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nennbetrag ⁽³⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
iTraxx Crossover 37 5-Year Index	(5,000) %	20.06.2027	€ 3.800	€ (124)	(0,06)
iTraxx Europe Main 38 5-Year Index	(1,000)	20.12.2027	23.000	(316)	(0,15)
				€ (440)	(0,21)

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF⁽²⁾

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nennbetrag ⁽³⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.IG-39 5-Year Index	1,000 %	20.12.2027	\$ 1.900	€ 15	0,01

ZINSSWAPS

Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt ⁽⁴⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	2,000 %	15.03.2033	£ 3.000	€ (302)	(0,14)
Erhalt ⁽⁴⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	2,000	15.03.2053	1.100	(192)	(0,09)
Zahlung	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,500	12.12.2027	2.500	(24)	(0,01)
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000	16.06.2029	¥ 1.048.000	130	0,06
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,435	20.06.2029	312.000	33	0,01
Erhalt	3-Month EUR-ESTRON Compounded-OIS	1,250	13.03.2023	€ 151.100	(47)	(0,02)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,880	25.01.2052	\$ 1.800	(491)	(0,23)
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,000	17.03.2036	€ 2.400	702	0,33
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,190	04.11.2052	1.100	452	0,21
Zahlung ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	0,193	23.06.2035	2.900	(558)	(0,26)
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,195	04.11.2052	1.150	543	0,26
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,550	10.08.2024	800	(32)	(0,02)

Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO European Short-Term Opportunities Fund (Forts.)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	0,819 %	19.12.2034	€ 6.800	€ (596)	(0,28)
Zahlung ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	0,854	19.12.2039	3.300	(475)	(0,23)
Erhalt ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	1,500	15.03.2025	78.900	1.728	0,82
Erhalt ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	1,500	15.03.2028	7.900	324	0,15
Zahlung ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	1,500	15.03.2053	200	(17)	(0,01)
Zahlung ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	1,750	15.03.2033	10.500	(484)	(0,23)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,500	12.12.2032	2.500	(83)	(0,04)
Zahlung	CPTFEMU	1,380	15.03.2031	700	(122)	(0,06)
Zahlung	CPTFEMU	3,520	15.09.2024	300	(4)	0,00
Zahlung	CPTFEMU	3,720	15.09.2024	700	(7)	0,00
Zahlung	CPTFEMU	3,850	15.09.2024	500	(5)	0,00
Zahlung	CPURNSA	4,950	07.03.2023	\$ 1.600	(22)	(0,01)
Zahlung	CPURNSA	5,033	08.03.2023	4.800	(61)	(0,03)
					€ 390	0,18
					€ (35)	(0,02)

Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate

- (1) Agiert der Teilfonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Teilfonds entweder (i) vom Sicherungsgeber einen Betrag in Höhe des Nennwerts des Swaps und liefert die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er erhält einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.
- (2) Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er erhält einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.
- (3) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.
- (4) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

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

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

OPTIONSKAUF

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nennbetrag ⁽¹⁾	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
BPS	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,000 %	15.03.2023	1.100	€ 103	€ 558	0,26
BRC	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,410	02.02.2023	20.100	89	0	0,00
CBK	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,720	23.02.2023	4.300	21	0	0,00
GLM	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,200	26.04.2023	3.100	31	2	0,00
JPM	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,710	25.01.2023	4.600	25	0	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,000	15.03.2023	900	82	457	0,22
MYC	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,428	31.01.2023	20.100	92	0	0,00
	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,200	31.05.2023	8.800	100	10	0,00
							€ 543	€ 1.027	0,48

VERKAUFSOPTIONEN

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nennbetrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
BOA	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,490 %	20.01.2023	8.400	€ (313)	€ (1)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,590	22.01.2024	4.200	(159)	(9)	0,00
BPS	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,175	15.03.2023	3.300	(101)	(950)	(0,45)
BRC	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,558	02.02.2023	4.400	(89)	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,065	19.06.2025	6.600	(249)	(35)	(0,02)
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Erhalt	4,308	23.01.2023	1.500	(59)	(82)	(0,04)
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Zahlung	4,308	23.01.2023	1.500	(59)	(5)	0,00
CBK	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,736	23.02.2023	900	(20)	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Erhalt	4,290	17.01.2023	1.500	(64)	(78)	(0,04)
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Zahlung	4,290	17.01.2023	1.500	(64)	(3)	0,00
GLM	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,350	26.04.2023	1.700	(32)	(3)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,547	07.03.2023	700	(15)	(1)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,547	07.03.2023	700	(15)	(41)	(0,02)
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,067	09.06.2023	800	(9)	(2)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	3,140	09.06.2023	800	(10)	(25)	(0,01)
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,590	22.01.2024	4.200	(206)	(11)	0,00
GST	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	3,230	18.01.2023	1.300	(35)	(14)	(0,01)
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	3,230	18.01.2023	1.300	(35)	(10)	(0,01)
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,804	17.05.2023	2.700	(85)	(29)	(0,01)
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,804	17.05.2023	2.700	(85)	(124)	(0,06)
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Erhalt	4,670	10.01.2023	1.600	(65)	(135)	(0,06)

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
JPM	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Zahlung	4,670 %	10.01.2023	1.600	€ (65)	€ 0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,785	25.01.2023	1.000	(24)	0	0,00
MYC	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,175	15.03.2023	2.700	(81)	(778)	(0,37)
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,579	31.01.2023	4.400	(92)	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,350	31.05.2023	4.800	(99)	(13)	(0,01)
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,008	17.12.2029	5.500	(341)	(155)	(0,07)
	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,008	17.12.2029	10.900	(352)	(151)	(0,07)
							€ (2.823)	€ (2.655)	(1,25)

⁽¹⁾ Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens		
AZD	01.2023	\$ 95	€ 91	€ 3	€ 0	€ 3	0,00		
BOA	01.2023	€ 1.026	DKK 7.630	0	0	0	0,00		
	01.2023	\$ 767	€ 724	6	0	6	0,00		
	02.2023	£ 193	€ 218	1	0	1	0,00		
	02.2023	¥ 32.000	€ 222	0	(6)	(6)	0,00		
BPS	01.2023	€ 413	\$ 437	0	(4)	(4)	0,00		
	02.2023	€ 209	£ 185	0	(1)	(1)	0,00		
BRC	01.2023	€ 809	\$ 862	0	(2)	(2)	0,00		
	01.2023	\$ 210	CNH 1.464	2	0	2	0,00		
CBK	01.2023	€ 1.156	€ 1.112	29	0	29	0,01		
	01.2023	DKK 2.150	€ 289	0	0	0	0,00		
	01.2023	€ 235	DKK 1.745	0	0	0	0,00		
	01.2023	€ 284	\$ 302	0	(1)	(1)	0,00		
	01.2023	\$ 1.493	€ 1.420	21	0	21	0,01		
	02.2023	€ 633	£ 559	0	(4)	(4)	0,00		
CLY	03.2023	\$ 64	MXN 1.248	0	0	0	0,00		
	02.2023	€ 100	£ 84	1	0	1	0,00		
GLM	01.2023	€ 218	CNH 1.520	1	0	1	0,00		
JPM	01.2023	€ 679	DKK 5.050	0	0	0	0,00		
	01.2023	ILS 116	\$ 34	1	0	1	0,00		
	01.2023	\$ 148	€ 140	2	0	2	0,00		
	02.2023	€ 291	£ 251	0	(8)	(8)	0,00		
MBC	01.2023	DKK 65	€ 9	0	0	0	0,00		
	01.2023	€ 648	\$ 684	0	(7)	(7)	0,00		
	01.2023	¥ 720.000	€ 4.928	0	(192)	(192)	(0,09)		
	01.2023	\$ 16.261	€ 15.503	274	0	274	0,13		
	02.2023	€ 23	SEK 247	0	(1)	(1)	0,00		
	02.2023	¥ 680.000	€ 4.734	0	(110)	(110)	(0,05)		
MYI	05.2023	CNH 2.981	\$ 444	9	0	9	0,00		
	01.2023	€ 218	DKK 1.625	0	0	0	0,00		
	01.2023	€ 1.874	\$ 1.981	0	(19)	(19)	(0,01)		
	01.2023	\$ 459	€ 435	5	0	5	0,00		
	02.2023	€ 228	£ 197	0	(7)	(7)	0,00		
	02.2023	€ 53	¥ 7.626	1	0	1	0,00		
RBC	02.2023	£ 59	€ 68	2	0	2	0,00		
	02.2023	\$ 50	£ 42	0	0	0	0,00		
RYL	02.2023	€ 214	¥ 30.300	2	0	2	0,00		
	02.2023	£ 106	€ 122	3	0	3	0,00		
	02.2023	\$ 25	CHF 24	1	0	1	0,00		
	01.2023	DKK 212.651	€ 28.603	6	0	6	0,00		
SSB	02.2023	£ 27.462	€ 31.290	391	0	391	0,19		
						€ 761	€ (362)	€ 399	0,19
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						€ (1.229)	€ (0,58)		
Summe Anlagen						€ 216.010	€ 102,29		
Sonstige Aktiva und Passiva						€ (4.838)	€ (2,29)		
Nettovermögen						€ 211.172	€ 100,00		

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

- * Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt
- Nullkuponwertpapier.
 - Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.
 - Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.
 - Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.
 - Mit dem Fonds verbunden.
 - Bedingt wandelbares Wertpapier.

Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO European Short-Term Opportunities Fund (Forts.)

Wertpapier mit einem Gesamtmarktwert von 0 EUR (31. Dezember 2021: 613 EUR) wurden gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen zum 31. Dezember 2022 als Sicherheiten verpfändet.

Barmittel in Höhe von 3.688 EUR (31. Dezember 2021: 4.806 EUR) wurden zum 31. Dezember 2022 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 1.165 EUR (31. Dezember 2021: 2.223 EUR) wurden zum 31. Dezember 2022 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	€ 0	€ 193.346	€ 0	€ 193.346
Investmentfonds	18.800	0	0	18.800
Pensionsgeschäfte	0	4.400	0	4.400
Finanzderivate ⁽³⁾	731	(1.267)	0	(536)
Summen	€ 19.531	€ 196.479	€ 0	€ 216.010

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

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	€ 0	€ 351.206	€ 0	€ 351.206
Investmentfonds	0	26.155	0	26.155
Pensionsgeschäfte	0	11.681	0	11.681
Finanzderivate ⁽³⁾	1.838	(4.909)	0	(3.071)
Summen	€ 1.838	€ 384.133	€ 0	€ 385.971

⁽¹⁾ Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

⁽²⁾ Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

⁽³⁾ Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2021:

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2022			Zum 31. Dez. 2021		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement ⁽¹⁾	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement ⁽¹⁾
AZD	€ 3	€ 0	€ 3	€ k. A.	€ k. A.	€ k. A.
BOA	(9)	(440)	(449)	(388)	0	(388)
BPS	(397)	360	(37)	(112)	0	(112)
BRC	(93)	0	(93)	(202)	(26)	(228)
CBK	(65)	290	225	(303)	250	(53)
CLY	1	0	1	k. A.	k. A.	k. A.
DUB	k. A.	k. A.	k. A.	4	0	4
GLM	(80)	(169)	(249)	(193)	0	(193)
GSC	k. A.	k. A.	k. A.	(3)	0	(3)
GST	(312)	253	(59)	k. A.	k. A.	k. A.
HUS	k. A.	k. A.	k. A.	(60)	0	(60)
JPM	(326)	262	(64)	(37)	0	(37)
MBC	(27)	0	(27)	k. A.	k. A.	k. A.
MYC	(309)	(253)	(562)	(735)	53	(682)
MYI	(18)	0	(18)	(5)	0	(5)
RBC	k. A.	k. A.	k. A.	(5)	0	(5)
RYL	6	0	6	(1.672)	1.680	8
SCX	6	0	6	(259)	240	(19)
SSB	391	(328)	63	k. A.	k. A.	k. A.
UAG	k. A.	k. A.	k. A.	(3)	0	(3)

⁽¹⁾ Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2022:

	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	78,37	86,65
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	13,20	2,15
Investmentfonds	8,90	6,61
Pensionsgeschäfte	2,08	2,95
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,34	0,47
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,02)	(0,24)
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,58)	(1,00)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	k. A.	(0,15)

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2022 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
Unternehmensanleihen und Wechsel	39,32	57,25
US-Regierungsbehörden	5,19	0,05
US-Schatzobligationen	2,49	3,37
Non-Agency-MBS	14,49	6,77
Forderungsbesicherte Wertpapiere	15,94	9,48
Staatsemissionen	7,09	9,12
Vorzugswertpapiere	0,30	0,26
Kurzfristige Instrumente	6,75	2,50
Investmentfonds	8,90	6,61
Pensionsgeschäfte	2,08	2,95
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,34	0,47
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	k. A.	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	(0,21)	k. A.
Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf	0,01	0,01
Zinsswaps	0,18	(0,25)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Zinsswapoptionen	0,48	0,23
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaptions auf Kreditindizes	k. A.	0,00
Devisenoptionen	k. A.	0,00
Zinsswapoptionen	(1,25)	(1,09)
Optionen auf Wertpapiere	k. A.	0,00
Devisenterminkontrakte	0,19	(0,14)
Sonstige Aktiva und Passiva	(2,29)	2,41
Nettovermögen	100,00	100,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Advantage Fund

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE												
ARGENTINIEN												
STAATSEMISSIONEN												
Argentina Government International Bond				Dryden Senior Loan Fund				Nykredit Realkredit A/S				
0,500 % fällig am 09.07.2030	\$	254	0,01	5,806 % fällig am 15.08.2030	\$	1.294	0,31	1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK	23.828	0,60	
1,000 % fällig am 09.07.2029		3	0,00	Gallatin CLO Ltd.				1,000 % fällig am 01.10.2053		0	0,00	
1,500 % fällig am 09.07.2035		91	0,01	5,328 % fällig am 21.01.2028		502	0,12	1,500 % fällig am 01.10.2037		0	0,00	
Summe Argentinien		85	0,02	LCM LP				1,500 % fällig am 01.10.2050		0	0,00	
				5,283 % fällig am 20.07.2031	1.300	1.281	0,31	1,500 % fällig am 01.10.2053	10.615	1.120	0,27	
AUSTRALIEN				Madison Park Funding Ltd.				2,000 % fällig am 01.10.2047		0	0,00	
NON-AGENCY-MBS				4,829 % fällig am 15.04.2029	1.244	1.231	0,30	2,500 % fällig am 01.10.2036		0	0,00	
Pepper Residential Securities Trust	AUD	366	0,06	OCP CLO Ltd.				2,500 % fällig am 01.10.2047		0	0,00	
4,210 % fällig am 16.09.2059				5,363 % fällig am 20.07.2029	1.126	1.116	0,27	3,000 % fällig am 01.10.2047		0	0,00	
RESIMAC Bastille Trust	\$	112	0,03	Octagon Investment Partners Ltd.				Realkredit Danmark A/S				
5,102 % fällig am 05.09.2057				5,039 % fällig am 16.04.2031	1.100	1.085	0,26	1,000 % fällig am 01.10.2050	3.674	389	0,10	
Summe Australien		359	0,09	OHA Loan Funding Ltd.				1,500 % fällig am 01.10.2053	3.352	360	0,09	
				5,854 % fällig am 18.11.2031	1.300	1.282	0,31	2,500 % fällig am 01.04.2036		0	0,00	
STAATSEMISSIONEN				Venture CLO Ltd.				2,500 % fällig am 01.04.2047		0	0,00	
Australia Government International Bond	AUD	4.100	0,60	4,959 % fällig am 15.04.2027	273	273	0,07	Summe Dänemark		10.959	2,67	
0,750 % fällig am 21.11.2027		3.822	0,39	5,293 % fällig am 20.07.2030	1.299	1.269	0,31	DOMINIKANISCHE REPUBLIK				
1,000 % fällig am 21.12.2030		700	0,09	5,343 % fällig am 20.01.2029	966	955	0,23	STAATSEMISSIONEN				
1,250 % fällig am 21.05.2032		500	0,06	Wind River CLO Ltd.				Dominican Republic Government International Bond				
1,750 % fällig am 21.06.2051		700	0,07	5,244 % fällig am 18.07.2031	1.295	1.267	0,31	6,500 % fällig am 15.02.2048				
2,500 % fällig am 21.05.2030		500	0,08						\$	800	662	0,16
4,500 % fällig am 21.04.2033		2.100	0,36									
Summe Australien		7.160	1,74									
BRASILIEN												
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL												
Banco Bradesco S.A.	\$	500	0,12									
2,850 % fällig am 27.01.2023												
Odebrecht Oil & Gas Finance Ltd.												
0,000 % fällig am 30.01.2023 (c)(f)	254	1	0,00									
Swiss Insured Brazil Power Finance SARL	BRL	15.566	0,64									
9,850 % fällig am 16.07.2032												
Summe Brasilien		3.102	0,76									
KANADA												
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL												
Air Canada Pass-Through Trust	\$	398	0,08									
3,300 % fällig am 15.07.2031												
Fairfax Financial Holdings Ltd.	€	500	0,12									
2,750 % fällig am 29.03.2028												
Summe Kanada		808	0,20									
NON-AGENCY-MBS												
Real Estate Asset Liquidity Trust	CAD	351	0,06									
3,072 % fällig am 12.08.2053												
STAATSEMISSIONEN												
Canadian Government Real Return Bond												
1,500 % fällig am 01.12.2044 (e)	2.527	1.942	0,47									
Summe Kanada		3.007	0,73									
CAYMAN INSELN												
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE												
Atlas Senior Loan Fund Ltd.	\$	1.080	0,26									
5,169 % fällig am 15.01.2031												
5,229 % fällig am 16.01.2030		1.238	0,30									
Babson CLO Ltd.												
5,233 % fällig am 20.01.2031	1.200	1.181	0,29									
Bain Capital Credit CLO												
5,285 % fällig am 23.04.2031	1.200	1.176	0,29									
Trestles CLO Ltd.												
5,043 % fällig am 20.01.2028	1.119	1.114	0,27									
CBAM CLO Ltd.												
5,099 % fällig am 17.04.2031	1.300	1.277	0,31									
CIFC Funding Ltd.												
5,194 % fällig am 18.04.2031	1.500	1.474	0,36									
Trestles CLO Ltd.												
5,099 % fällig am 15.04.2031	1.400	1.383	0,34									

BESCHREIBUNG	PARI	MARKT- WERT (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
UNGARN				
STAATSEMISSIONEN				
Hungary Government International Bond 5,000 % fällig am 22.02.2027	€	100	\$ 106	0,03
INDONESIEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara 3,000 % fällig am 30.06.2030	\$	3.500	2.877	0,70
STAATSEMISSIONEN				
Indonesia Government International Bond 8,375 % fällig am 15.03.2034	IDR 22.982.000	1.623		0,40
Summe Indonesien		4.500		1,10
IRLAND				
FÖRDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				
Accunia European CLO DAC 2,328 % fällig am 15.07.2030	€	535	560	0,14
Ares European CLO DAC 2,158 % fällig am 15.10.2031	1.100	1.138		0,28
Bastille Euro CLO DAC 2,098 % fällig am 15.07.2031	400	415		0,10
Aurium CLO DAC 2,108 % fällig am 16.01.2031	1.100	1.148		0,28
BNPP AM Euro CLO BV 2,322 % fällig am 22.07.2032	1.000	1.034		0,25
Cairn CLO DAC 2,178 % fällig am 30.04.2031	395	411		0,10
Bastille Euro CLO DAC 2,078 % fällig am 15.01.2031	1.000	1.041		0,25
Dryden Euro CLO DAC 2,038 % fällig am 15.04.2033	700	725		0,18
2,622 % fällig am 15.05.2034	1.000	1.037		0,25
GoldenTree Loan Management EUR CLO DAC 2,356 % fällig am 20.01.2032	1.000	1.032		0,25
Harvest CLO DAC 2,136 % fällig am 20.10.2031	800	829		0,20
2,138 % fällig am 15.07.2031	1.100	1.134		0,28
2,228 % fällig am 15.01.2032	1.100	1.137		0,28
2,433 % fällig am 18.11.2029	281	296		0,07
2,775 % fällig am 26.06.2030	1.062	1.108		0,27
Jubilee CLO DAC 1,978 % fällig am 15.04.2030	600	627		0,15
2,028 % fällig am 15.04.2031	400	415		0,10
Madison Park Euro Funding DAC 2,178 % fällig am 15.07.2032	1.100	1.138		0,28
Man GLG Euro CLO DAC 2,188 % fällig am 15.10.2032	1.099	1.135		0,28
2,736 % fällig am 15.12.2031	600	621		0,15
Oak Hill European Credit Partners I DAC 2,196 % fällig am 20.10.2031	1.100	1.139		0,28
Bastille Euro CLO DAC 2,382 % fällig am 22.09.2034	800	830		0,20
Palmer Square European Loan Funding DAC 2,108 % fällig am 15.07.2031	1.002	1.041		0,25
Toro European CLO DAC 2,153 % fällig am 14.01.2032	1.100	1.142		0,28
		21.133		5,15
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
AerCap Ireland Capital DAC 2,450 % fällig am 29.10.2026	\$	400	350	0,09
3,000 % fällig am 29.10.2028		500	420	0,10
			770	0,19
Summe Irland		21.903		5,34
ISRAEL				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Israel Electric Corp. Ltd. 3,750 % fällig am 22.02.2032		1.200	1.055	0,26

BESCHREIBUNG	PARI	MARKT- WERT (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
STAATSEMISSIONEN				
Israel Government International Bond 1,500 % fällig am 30.11.2023	ILS	6.000	\$ 1.669	0,41
1,750 % fällig am 31.08.2025		2.100	566	0,14
2,000 % fällig am 31.03.2027		2.700	715	0,17
			2.950	0,72
Summe Israel		4.005		0,98
ITALIEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
AMCO - Asset Management Co. SpA 1,500 % fällig am 17.07.2023	€	1.000	1.057	0,26
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 0,875 % fällig am 08.10.2027		1.300	1.233	0,30
UniCredit SpA 7,830 % fällig am 04.12.2023	\$	1.100	1.112	0,27
			3.402	0,83
STAATSEMISSIONEN				
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,350 % fällig am 15.09.2024 (e)	€	23.130	25.439	6,20
Italy Government International Bond 6,000 % fällig am 04.08.2028	£	1.000	1.215	0,29
			26.654	6,49
Summe Italien		30.056		7,32
ELFENBEINKÜSTE				
STAATSEMISSIONEN				
Ivory Coast Government International Bond 5,250 % fällig am 22.03.2030	€	1.600	1.448	0,35
JAPAN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Nissan Motor Co. Ltd. 4,345 % fällig am 17.09.2027	\$	500	454	0,11
4,810 % fällig am 17.09.2030		400	340	0,08
Nomura Holdings, Inc. 2,329 % fällig am 22.01.2027		400	351	0,09
Sumitomo Mitsui Banking Corp. 0,409 % fällig am 07.11.2029	€	1.300	1.120	0,27
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd. 0,010 % fällig am 15.10.2027		1.000	900	0,22
			3.165	0,77
STAATSEMISSIONEN				
Japan Finance Organization for Municipalities 3,375 % fällig am 27.09.2023	\$	1.400	1.382	0,33
Japan Government International Bond 0,100 % fällig am 10.03.2028 (e)	¥	754.474	5.915	1,44
0,100 % fällig am 10.03.2029 (e)		520.325	4.093	1,00
0,500 % fällig am 20.03.2049		268.000	1.591	0,39
0,700 % fällig am 20.06.2051		254.000	1.547	0,38
Tokyo Metropolitan Government 2,625 % fällig am 29.05.2024	\$	400	387	0,09
			14.915	3,63
Summe Japan		18.080		4,40
LUXEMBURG				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Aroundtown S.A. 0,375 % fällig am 15.04.2027	€	700	496	0,12
CBRE Global Investors Open-Ended Fund S.C.A. SICAV-SIF Pan European Core Fund 0,900 % fällig am 12.10.2029		300	234	0,06
CPI Property Group S.A. 1,625 % fällig am 23.04.2027		700	534	0,13
1,750 % fällig am 14.01.2030		300	195	0,05
Logicor Financing SARL 0,625 % fällig am 17.11.2025		200	183	0,04
0,750 % fällig am 15.07.2024		600	588	0,14
			2.230	0,54

BESCHREIBUNG	PARI	MARKT- WERT (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
NON-AGENCY-MBS				
Miravet SARL 2,758 % fällig am 26.05.2065	€	521	\$ 537	0,13
Summe Luxemburg			2.767	0,67
MALAYSIA				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Petronas Capital Ltd. 2,480 % fällig am 28.01.2032	\$	500	415	0,10
3,500 % fällig am 21.04.2030		200	183	0,05
4,550 % fällig am 21.04.2050		200	179	0,04
4,800 % fällig am 21.04.2060		200	184	0,05
			961	0,24
STAATSEMISSIONEN				
Malaysia Government International Bond 3,480 % fällig am 15.03.2023	MYR 13.000	2.954		0,72
Malaysia Government Investment Issue 3,151 % fällig am 15.05.2023	400	91		0,02
			3.045	0,74
Summe Malaysia			4.006	0,98
MEXIKO				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Petroleos Mexicanos 6,750 % fällig am 21.09.2047	\$	1.809	1.158	0,28
MAROKKO				
STAATSEMISSIONEN				
Morocco Government International Bond 2,000 % fällig am 30.09.2030 (j)	€	1.800	1.525	0,37
MULTINATIONAL				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Preferred Term Securities Ltd. 5,138 % fällig am 23.06.2035	\$	1.063	1.009	0,25
NIEDERLANDE				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Cooperatieve Rabobank UA 3,758 % fällig am 06.04.2033		400	342	0,08
CTP NV 0,500 % fällig am 21.06.2025	€	1.100	986	0,24
Enel Finance International NV 2,650 % fällig am 10.09.2024	\$	1.200	1.149	0,28
ING Groep NV 2,125 % fällig am 23.05.2026	€	500	508	0,12
3,875 % fällig am 16.05.2027 (f)(h)	\$	200	147	0,04
Prosus NV 1,207 % fällig am 19.01.2026	€	1.500	1.446	0,35
3,257 % fällig am 19.01.2027	\$	1.600	1.432	0,35
			6.010	1,46
NON-AGENCY-MBS				
Jubilee Place BV 2,378 % fällig am 17.10.2057	€	493	522	0,13
Summe Niederlande			6.532	1,59
NEUSEELAND				
STAATSEMISSIONEN				
New Zealand Government International Bond 1,500 % fällig am 15.05.2031	NZD	600	302	0,07
NORWEGEN				
STAATSEMISSIONEN				
Kommunalbanken A/S 1,900 % fällig am 19.01.2027	AUD	400	245	0,06
Norway Government International Bond 1,750 % fällig am 13.03.2025	NOK	6.000	592	0,14
Summe Norwegen			837	0,20

Aufstellung der Wertpapieranlagen Global Bond Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Sequoia Mortgage Trust				Uniform Mortgage-Backed Security				KURZFRISTIGE INSTRUMENTE			
2,976 % fällig am 20.01.2047 ^	\$ 17	\$ 11	0,00	2,500 % fällig am 01.02.2051 - 01.01.2052	\$ 2.015	\$ 1.712	0,42	HUNGARY TREASURY BILLS			
Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust				3,000 % fällig am 01.10.2042 - 01.10.2049	1.588	1.416	0,35	18,250 % fällig am 03.01.2023 (c)(d)	HUF 1.203.000	\$ 3.206	0,78
3,658 % fällig am 25.10.2036 ^	64	38	0,01	3,500 % fällig am 01.10.2034 - 01.07.2050	923	860	0,21	IRELAND TREASURY BILLS			
4,709 % fällig am 25.10.2035	155	142	0,03	4,000 % fällig am 01.09.2040 - 01.06.2050	538	512	0,12	0,505 % fällig am 08.02.2023 (c)(d)	ILS 9.900	2.796	0,68
4,829 % fällig am 25.05.2037	27	24	0,01	4,500 % fällig am 01.04.2041	62	62	0,02	0,746 % fällig am 05.04.2023 (c)(d)	4.200	1.179	0,29
Structured Asset Mortgage Investments Trust				5,500 % fällig am 01.07.2037 - 01.04.2039	183	190	0,05	0,753 % fällig am 05.04.2023 (c)(d)	6.700	1.881	0,46
4,749 % fällig am 25.07.2046	463	379	0,09	Uniform Mortgage-Backed Security, TBA				0,875 % fällig am 03.05.2023 (c)(d)	7.800	2.185	0,53
4,789 % fällig am 25.05.2036	202	155	0,04	2,500 % fällig am 01.01.2053	6.400	5.421	1,32	0,913 % fällig am 05.04.2023 (c)(d)	2.300	646	0,16
4,809 % fällig am 25.04.2036	17	14	0,00	3,000 % fällig am 01.02.2053	21.000	18.451	4,50	0,950 % fällig am 05.04.2023 (c)(d)	700	196	0,05
5,179 % fällig am 19.10.2033	2	2	0,00	3,500 % fällig am 01.02.2053	10.600	9.637	2,35				
Structured Asset Securities Corp.				4,000 % fällig am 01.01.2053	15.100	14.163	3,45				
4,669 % fällig am 25.01.2036	141	135	0,03	4,500 % fällig am 01.02.2053	23.300	22.431	5,47				
Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust				6,000 % fällig am 01.01.2053	3.100	3.144	0,77				
4,679 % fällig am 25.10.2036	514	451	0,11								
Tharaldson Hotel Portfolio Trust											
5,268 % fällig am 11.11.2034	1.296	1.261	0,31								
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust											
3,448 % fällig am 25.06.2042	1	1	0,00								
3,600 % fällig am 25.12.2036 ^	64	55	0,01								
4,949 % fällig am 25.11.2045	132	115	0,03								
Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust											
6,000 % fällig am 25.06.2037 ^	409	396	0,10								
		12.517	3,05								
				US-SCHATZOBIGLIGATIONEN							
				U.S. Treasury Bonds							
				1,625 % fällig am 15.11.2050	1.300	774	0,19				
				1,875 % fällig am 15.02.2041	13.500	9.549	2,32				
				2,875 % fällig am 15.05.2052	300	240	0,06				
				4,000 % fällig am 15.11.2052	400	401	0,10				
				U.S. Treasury Inflation Protected Securities (e)							
				0,125 % fällig am 15.07.2030	1.976	1.770	0,43				
				0,125 % fällig am 15.01.2031	1.145	1.017	0,25				
				0,125 % fällig am 15.07.2031	1.223	1.082	0,26				
				0,125 % fällig am 15.01.2032	3.870	3.393	0,83				
				0,250 % fällig am 15.02.2050	1.159	783	0,19				
				0,500 % fällig am 15.01.2028	9.906	9.319	2,27				
				0,625 % fällig am 15.07.2032	718	658	0,16				
				0,750 % fällig am 15.07.2028	2.018	1.923	0,47				
				U.S. Treasury Notes							
				2,875 % fällig am 30.04.2025	9.300	9.002	2,19				
						39.911	9,72				
				Summe USA		186.870	45,54				
								Summe kurzfristige Instrumente		12.089	2,95
								Summe Übertragbare Wertpapiere	\$ 443.632	108,10	
								AKTIEN			
								INVESTMENTFONDS			
								ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN			
								PIMCO Specialty Funds Ireland PLC - China Bond Fund (a)	446.527	5.948	1,44
								PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (g)	1.235.076	12.294	3,00
								Summe Investmentfonds	\$ 18.242	4,44	

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft ⁽¹⁾	% des Nettovermögens
FICC	1,900 %	30.12.2022	03.01.2023	\$ 1.408	U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 29.06.2023	\$ (1.436)	\$ 1.408	\$ 1.408	0,34
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (1.436)	\$ 1.408	\$ 1.408	0,34

⁽¹⁾ Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
3-Month Euribor December Futures	Short	03.2024	390	\$ 157	0,04
3-Month Euribor June Futures	Long	09.2023	235	(269)	(0,07)
3-Month Euribor June Futures	Long	09.2024	195	(63)	(0,01)
Australia Government 3-Year Note March Futures	Short	03.2023	28	26	0,01
Australia Government 10-Year Bond March Futures	Long	03.2023	64	(286)	(0,07)
Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 146,000 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond March 2023 Futures ⁽¹⁾	Short	01.2023	4	3	0,00
Canada Government 10-Year Bond March Futures	Short	03.2023	18	29	0,01
Euro-Bobl March Futures	Short	03.2023	209	785	0,19
Euro-BTP Italy Government Bond March Futures	Short	03.2023	219	1.169	0,29
Euro-Bund 10-Year Bond March Futures	Long	03.2023	33	(302)	(0,07)
Euro-Buxl 30-Year Bond March Futures	Short	03.2023	5	136	0,03
Euro-OAT France Government 10-Year Bond March Futures	Short	03.2023	202	1.943	0,47
Japan Government 10-Year Bond March Futures	Short	03.2023	13	265	0,06
Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 138,500 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond September 2023 Futures ⁽¹⁾	Short	01.2023	4	(20)	(0,01)

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
U.S. Treasury 2-Year Note March Futures	Short	03.2023	42	\$ (11)	0,00
U.S. Treasury 5-Year Note March Futures	Long	03.2023	290	(39)	(0,01)
U.S. Treasury 10-Year Note March Futures	Long	03.2023	46	(12)	0,00
U.S. Treasury 30-Year Bond March Futures	Short	03.2023	26	(2)	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond March Futures	Long	03.2023	5	4	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond March Futures	Short	03.2023	257	49	0,01
United Kingdom Long Gilt March Futures	Short	03.2023	123	904	0,22
				\$ 4.466	1,09

(1) Future-Style-Option.

VERKAUFSOPTIONEN**OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE**

Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
Call - CME Call Options Strike @ USD 98.000 on 3-Month SOFR December Futures	\$ 98,000	15.12.2023	7	\$ (6)	\$ (1)	0,00
Put - CME Put Options Strike @ USD 96.500 on 3-Month SOFR December Futures	96,500	15.12.2023	7	(6)	(21)	(0,01)
				\$ (12)	\$ (22)	(0,01)

Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate

\$ 4.444 1,08**ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)**

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

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽³⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AT&T, Inc.	1,000 %	20.12.2023	\$ 300	\$ (3)	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20.06.2028	€ 700	(21)	(0,01)
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20.06.2025	\$ 400	6	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20.12.2024	€ 200	8	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20.06.2026	450	16	0,01
				\$ 6	0,00

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF⁽²⁾

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽³⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.EM-37 5-Year Index	(1,000) %	20.06.2027	\$ 3.528	\$ (111)	(0,03)
CDX.IG-35 10-Year Index	(1,000)	20.12.2030	1.600	15	0,00
CDX.IG-37 10-Year Index	(1,000)	20.12.2031	5.300	(14)	0,00
CDX.IG-38 10-Year Index	(1,000)	20.06.2032	900	(9)	0,00
CDX.IG-39 5-Year Index	(1,000)	20.12.2027	2.400	(16)	0,00
CDX.IG-39 10-Year Index	(1,000)	20.12.2032	31.300	(328)	(0,08)
iTraxx Europe Main 38 10-Year Index	(1,000)	20.12.2032	€ 6.900	(160)	(0,04)
				\$ (623)	(0,15)

ZINSSWAPS - BASISWAPS

Zahlung variabler Zinssatzindex	Erhalt variabler Zinssatzindex	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
3-Month USD-LIBOR	1-Month USD-LIBOR + 0,070 %	07.03.2024	\$ 3.400	\$ 2	0,00
3-Month USD-LIBOR	1-Month USD-LIBOR + 0,088 %	06.09.2024	21.300	(4)	0,00
3-Month USD-LIBOR	1-Month USD-LIBOR + 0,098 %	02.03.2023	4.600	7	0,00
3-Month USD-LIBOR	1-Month USD-LIBOR + 0,102 %	04.10.2024	4.500	13	0,01
3-Month USD-LIBOR	1-Month USD-LIBOR + 0,105 %	27.09.2024	10.300	3	0,00
				\$ 21	0,01

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	0,010 %	07.02.2023	£ 17.800	\$ (356)	(0,09)
Zahlung ⁽⁴⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	2,000	15.03.2033	16.400	(163)	(0,04)
Zahlung ⁽⁴⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	2,000	15.03.2053	600	(13)	0,00
Zahlung ⁽⁴⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	2,250	15.03.2028	3.200	(61)	(0,01)
Zahlung ⁽⁴⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	2,500	15.03.2025	900	(1)	0,00
Zahlung	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	5,500	15.12.2026	INR 666.500	308	0,07

Aufstellung der Wertpapieranlagen Global Bond Fund (Forts.)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	5,750 %	16.03.2027	INR 666.520	\$ (261)	(0,06)
Zahlung	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	6,250	21.09.2024	336.810	(10)	0,00
Erhalt	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	6,250	16.03.2032	63.900	(49)	(0,01)
Zahlung	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	6,500	21.09.2024	747.800	37	0,01
Zahlung	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	6,750	21.09.2024	631.500	41	0,01
Erhalt	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	7,000	21.09.2027	154.500	(37)	(0,01)
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000	15.12.2028	¥ 250.000	(68)	(0,02)
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000	17.03.2031	230.000	(96)	(0,02)
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,050	15.12.2031	440.000	(141)	(0,03)
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,400	19.06.2039	280.000	287	0,07
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,800	15.06.2052	300.000	280	0,07
Zahlung	1-Day SGD-MIBOR Compounded-OIS	1,250	15.09.2031	SGD 400	16	0,00
Zahlung	1-Day SGD-MIBOR Compounded-OIS	2,500	21.09.2027	700	(12)	0,00
Zahlung	1-Day SGD-MIBOR Compounded-OIS	2,750	15.06.2027	3.200	(38)	(0,01)
Zahlung	1-Day SGD-MIBOR Compounded-OIS	2,750	21.09.2027	9.641	(87)	(0,02)
Zahlung	1-Day SGD-MIBOR Compounded-OIS	3,000	15.06.2027	1.900	(9)	0,00
Zahlung	1-Day SGD-MIBOR Compounded-OIS	3,250	21.12.2027	800	(4)	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,000	15.06.2027	\$ 10.400	984	0,24
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,000	15.06.2029	15.000	(970)	(0,24)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,250	15.12.2028	3.200	(428)	(0,10)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,250	15.06.2032	1.000	(184)	(0,04)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,430	31.03.2024	200	8	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,500	15.06.2052	290	(88)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,618	09.02.2029	1.600	(177)	(0,04)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2024	10.740	(53)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2027	41.800	1.623	0,39
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2029	3.100	149	0,04
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2032	4.250	(119)	(0,03)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2052	600	23	0,01
Erhalt ⁽⁴⁾	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,850	21.04.2024	21.900	372	0,09
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,888	22.03.2029	2.500	(242)	(0,06)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,175	21.04.2029	2.400	(195)	(0,05)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,209	31.03.2024	2.236	78	0,02
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,400	21.06.2024	600	(20)	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,750	30.04.2029	1.800	95	0,02
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,817	30.04.2029	3.600	176	0,04
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,818	30.04.2029	3.100	152	0,04
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,819	30.04.2029	2.400	117	0,03
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,886	15.05.2032	7.000	(530)	(0,13)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,906	16.09.2052	600	(36)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,965	30.11.2026	36.200	1.213	0,30
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,968	30.06.2024	13.100	(352)	(0,09)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,050	08.09.2029	400	(12)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,100	09.09.2029	1.200	(32)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,454	30.06.2029	2.900	(32)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,898	30.06.2029	3.200	46	0,01
Erhalt	1-Year BRL-CDI	6,280	04.01.2027	BRL 1.600	36	0,01
Erhalt ⁽⁴⁾	3-Month AUD-BBR-BBSW	3,750	15.03.2024	AUD 49.500	47	0,01
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,220	03.03.2025	CAD 6.700	(391)	(0,10)
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,500	17.06.2025	2.600	(154)	(0,04)
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,500	17.06.2030	1.600	(126)	(0,03)
Erhalt	3-Month CAD-Bank Bill	1,750	16.12.2046	1.400	171	0,04
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,900	18.12.2029	3.700	(317)	(0,08)

Zahlung/ Erhalt	variabler Zinssatz	Variablem Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	3-Month COP-IBR	Compounded-OIS	0,283 %	14.02.2027	CHF 1.700	\$ (103)	(0,03)
Zahlung	3-Month COP-IBR	Compounded-OIS	0,294	10.02.2027	4.400	(252)	(0,06)
Zahlung	3-Month COP-IBR	Compounded-OIS	0,300	15.02.2027	1.700	(102)	(0,02)
Zahlung	3-Month COP-IBR	Compounded-OIS	0,343	16.05.2027	1.300	(84)	(0,02)
Zahlung	3-Month COP-IBR	Compounded-OIS	0,500	15.09.2026	900	(74)	(0,02)
Erhalt	3-Month CNY-CNREPOFIX		2,500	21.12.2027	CNY 69.500	101	0,02
Zahlung	3-Month EUR-ESTRON	Compounded-OIS	1,000	23.11.2024	€ 9.400	(99)	(0,02)
Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR		3,000	21.09.2027	KRW 8.108.560	(148)	(0,04)
Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR		3,000	15.06.2032	876.900	(24)	(0,01)
Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR		3,250	15.06.2032	580.900	(11)	0,00
Zahlung	3-Month NZD-BBR		0,528	17.03.2024	NZD 350	(11)	0,00
Zahlung	3-Month NZD-BBR		3,000	01.11.2023	12.400	(170)	(0,04)
Zahlung	3-Month NZD-BBR		3,000	15.12.2023	11.700	(170)	(0,04)
Zahlung	3-Month NZD-BBR		3,250	21.03.2028	2.600	(315)	(0,08)
Zahlung	3-Month NZD-BBR		3,750	15.06.2027	4.100	(57)	(0,01)
Zahlung ⁽⁴⁾	3-Month NZD-BBR		4,000	14.06.2024	24.900	(198)	(0,05)
Zahlung	3-Month SEK-STIBOR		0,500	19.06.2024	SEK 12.700	(66)	(0,02)
Zahlung	3-Month SEK-STIBOR		1,000	19.06.2029	16.100	(235)	(0,06)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR		0,250	30.03.2023	\$ 1.200	(13)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR		1,249	31.08.2024	9.500	752	0,18
Erhalt	3-Month USD-LIBOR		1,250	15.12.2026	10.200	1.206	0,29
Erhalt	3-Month USD-LIBOR		1,298	25.08.2024	8.100	649	0,16
Erhalt	3-Month USD-LIBOR		1,500	18.12.2024	200	19	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR		1,500	15.12.2028	9.900	(1.433)	(0,35)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR		1,518	20.01.2029	800	(104)	(0,03)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR		1,630	20.01.2029	2.300	(284)	(0,07)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR		1,630	26.01.2029	500	(61)	(0,01)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR		2,000	15.12.2051	2.000	(733)	(0,18)
Erhalt	6-Month AUD-BBR-BBSW		1,250	17.06.2030	AUD 5.700	643	0,16
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW		1,750	16.03.2027	1.900	(122)	(0,03)
Erhalt	6-Month AUD-BBR-BBSW		1,750	16.06.2031	1.750	229	0,06
Zahlung ⁽⁴⁾	6-Month AUD-BBR-BBSW		4,250	15.09.2032	1.100	(16)	0,00
Zahlung ⁽⁴⁾	6-Month AUD-BBR-BBSW		4,250	15.03.2033	3.400	(38)	(0,01)
Zahlung ⁽⁴⁾	6-Month AUD-BBR-BBSW		4,500	15.09.2032	31.400	(314)	(0,08)
Erhalt ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR		0,054	27.05.2050	€ 200	49	0,01
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR		0,064	17.11.2052	500	171	0,04
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR		0,450	15.12.2035	300	94	0,02
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR		0,550	10.08.2024	500	(22)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR		0,650	12.04.2027	1.400	(144)	(0,04)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR		0,650	11.05.2027	900	(92)	(0,02)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR		0,700	11.04.2027	700	(70)	(0,02)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR		1,000	13.05.2027	1.600	(141)	(0,03)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR		1,000	18.05.2027	700	(62)	(0,02)
Erhalt ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR		1,500	15.03.2025	23.900	529	0,13
Zahlung ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR		1,500	15.03.2028	33.100	(747)	(0,18)
Erhalt ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR		1,500	15.03.2053	4.100	211	0,05
Zahlung ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR		1,750	15.03.2033	51.200	(1.101)	(0,27)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR		2,250	21.09.2037	1.400	(72)	(0,02)
Zahlung ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR		3,000	19.03.2027	6.650	(8)	0,00
Erhalt ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR		3,000	15.03.2033	2.980	9	0,00
Erhalt	6-Month NOK-NIBOR		1,635	18.03.2025	NOK 6.200	33	0,01
Erhalt	6-Month NOK-NIBOR		1,993	12.11.2024	4.200	27	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		4,870	07.07.2025	MXN 41.500	(116)	(0,03)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		6,080	26.02.2025	10.500	(39)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		6,380	25.02.2025	12.300	(49)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE		6,415	25.02.2025	300	(1)	0,00
Zahlung	UKRPI		3,700	15.04.2031	£ 100	(20)	0,00
Zahlung	UKRPI		3,740	15.03.2031	800	(160)	(0,04)
Erhalt	UKRPI		4,333	15.09.2032	900	(12)	0,00
						\$ (2.976)	(0,73)
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate						\$ (3.572)	(0,87)

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

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

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

(4) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Aufstellung der Wertpapieranlagen Global Bond Fund (Forts.)

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

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

OPTIONSKAUF

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nennbetrag ⁽¹⁾	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,180 %	11.01.2024	1.900	\$ 54	\$ 201	0,05

OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nennbetrag ⁽¹⁾	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
BPS	Put - OTC France Government International Bond 0,750 % fällig am 25.05.2052	€ 97,000	23.05.2025	800	\$ 61	\$ 327	0,08

VERKAUFSOPTIONEN

CREDIT DEFAULT SWAPPTIONS AUF KREDITINDIZES

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/-verkauf	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nennbetrag ⁽¹⁾	Aufgel d	Markt-wert	% des Nettovermögens
GST	Put - OTC iTraxx Europe 37 5-Year Index	Verkauf	3,000 %	15.03.2023	1.000	\$ (2)	\$ 0	0,00

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nennbetrag ⁽¹⁾	Aufgel d	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,150 %	01.12.2023	1.300	\$ (4)	\$ (1)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	01.12.2023	1.300	(4)	(10)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,310	11.01.2024	16.900	(56)	(279)	(0,07)
BPS	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,000	19.01.2023	300	(1)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,500	19.01.2023	300	(1)	(4)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,550	11.04.2023	2.000	(2)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,100	11.04.2023	2.000	(6)	(31)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,700	28.04.2023	1.200	(2)	0	0,00
BRC	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,250	28.04.2023	1.200	(2)	(17)	0,00
	Put - OTC 25-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,451	23.05.2025	800	(62)	(306)	(0,08)
	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,270	23.01.2023	400	(1)	0	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,770	23.01.2023	400	(1)	(2)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,000	19.01.2023	200	(1)	0	0,00
CBK	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,500	19.01.2023	200	(1)	(2)	0,00
	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,200	12.01.2023	400	(1)	0	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,800	12.01.2023	400	(1)	(1)	0,00
DUB	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,150	09.01.2023	1.400	(5)	0	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	09.01.2023	1.400	(5)	(8)	0,00
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,920	13.10.2023	700	(4)	(1)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,920	13.10.2023	700	(4)	(10)	0,00
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,790	08.04.2024	1.700	(13)	(6)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,790	08.04.2024	1.700	(13)	(20)	(0,01)
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,920	13.10.2023	500	(3)	(1)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,920	13.10.2023	500	(3)	(7)	0,00
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,018	20.10.2023	500	(3)	(1)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,018	20.10.2023	500	(3)	(6)	0,00
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,140	23.10.2023	600	(4)	(1)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,140	23.10.2023	600	(4)	(7)	0,00
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,190	23.10.2023	600	(4)	(1)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,190	23.10.2023	600	(4)	(7)	0,00
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,225	23.10.2023	500	(3)	(1)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,225	23.10.2023	500	(3)	(6)	0,00
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,973	25.10.2023	600	(4)	(1)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,973	25.10.2023	600	(4)	(8)	0,00
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,841	27.10.2023	400	(3)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,841	27.10.2023	400	(3)	(6)	0,00
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,088	03.11.2023	300	(2)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,088	03.11.2023	300	(2)	(4)	0,00
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,910	10.11.2023	900	(6)	(1)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,910	10.11.2023	900	(6)	(12)	0,00
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,250	17.11.2023	1.600	(6)	(1)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	17.11.2023	1.600	(6)	(11)	0,00
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,150	20.11.2023	1.000	(4)	(1)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	20.11.2023	1.000	(4)	(8)	0,00
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,250	07.12.2023	900	(3)	(1)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	07.12.2023	900	(3)	(6)	0,00
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,697	02.04.2024	2.000	(16)	(6)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,697	02.04.2024	2.000	(16)	(25)	(0,01)
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,721	08.04.2024	600	(5)	(2)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,721	08.04.2024	600	(5)	(7)	0,00
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,550	05.04.2023	3.900	(7)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,100	05.04.2023	3.900	(7)	(60)	(0,02)
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,550	11.04.2023	6.800	(13)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,100	11.04.2023	6.800	(13)	(106)	(0,03)

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nennbetrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettvermögens
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,700 %	24.04.2023	1.300	\$ (1)	\$ 0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,250	24.04.2023	1.300	(4)	(18)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,700	26.04.2023	1.300	(2)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,250	26.04.2023	1.300	(2)	(18)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,550	15.05.2023	1.800	(3)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,100	15.05.2023	1.800	(3)	(29)	(0,01)
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,067	09.06.2023	1.100	(13)	(3)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	3,140	09.06.2023	1.100	(15)	(36)	(0,01)
	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,230	23.01.2023	900	(2)	0	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,730	23.01.2023	900	(2)	(5)	0,00
JPM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Erhalt	0,820	16.12.2024	4.600	(33)	(7)	0,00
	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,200	12.01.2023	600	(2)	0	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,800	12.01.2023	600	(2)	(2)	0,00
MYC	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,993	11.10.2023	400	(3)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,993	11.10.2023	400	(3)	(5)	0,00
							\$ (452)	\$ (1.125)	(0,27)

(1) Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZKAUF⁽¹⁾

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽²⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettvermögens	
BPS	South Korea Government International Bond	(1,000) %	20.06.2023	\$ 2.100	\$ (52)	\$ 44	\$ (8)	0,00	
BRC	China Government International Bond	(1,000)	20.06.2023	1.200	(23)	18	(5)	0,00	
	South Korea Government International Bond	(1,000)	20.06.2023	1.500	(39)	34	(5)	0,00	
GST	China Government International Bond	(1,000)	20.06.2023	2.200	(42)	34	(8)	(0,01)	
HUS	South Korea Government International Bond	(1,000)	20.06.2023	1.200	(30)	26	(4)	0,00	
JPM	South Korea Government International Bond	(1,000)	20.06.2023	1.700	(41)	35	(6)	0,00	
						\$ (227)	\$ 191	\$ (36)	(0,01)

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽²⁾

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽³⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettvermögens	
BOA	Italy Government International Bond	1,000 %	20.06.2025	\$ 500	\$ (12)	\$ 14	\$ 2	0,00	
BRC	Italy Government International Bond	1,000	20.06.2025	400	(10)	12	2	0,00	
CBK	Italy Government International Bond	1,000	20.06.2025	500	(12)	15	3	0,00	
GST	Abu Dhabi Government International Bond	1,000	20.12.2026	1.100	32	(6)	26	0,01	
						\$ (2)	\$ 35	\$ 33	0,01

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

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

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

CROSS-CURRENCY SWAPS

Kontrahent	Erhalt	Zahlung	Fälligkeits- datum	Nennbetrag erhaltener Währung	Nennbetrag gelieferter Währung	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettvermögens
ÄZD	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month AUD-LIBOR zzgl. 0,290 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	04.01.2031	AUD 700	\$ 527	\$ 3	\$ (2)	\$ 1	0,00
CBK	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month AUD-LIBOR zzgl. 0,420 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	31.07.2029	5.900	4.071	(1)	8	7	0,00
GLM	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month AUD-LIBOR zzgl. 0,423 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	01.08.2029	5.600	3.864	(11)	8	(3)	0,00
						\$ (9)	\$ 14	\$ 5	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen Global Bond Fund (Forts.)

ZINSSWAPS

Kontrahent	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fest- Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettovermögens
BOA	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,500 %	21.09.2027	MYR 8.300	\$ 3	\$ 18	\$ 21	0,01
	Erhalt	3-Month THB-THORON Compounded-OIS	2,000	21.09.2024	THB 89.900	(4)	(1)	(5)	0,00
	Erhalt	3-Month THB-THORON Compounded-OIS	2,250	21.12.2027	67.500	(10)	7	(3)	0,00
	Zahlung	6-Month THB-THBFX	2,000	15.06.2032	17.700	(2)	(21)	(23)	(0,01)
	Zahlung	6-Month THB-THBFX	2,750	15.06.2032	8.430	(3)	8	5	0,00
	Zahlung	6-Month THB-THBFX	2,750	21.09.2032	24.600	(1)	20	19	0,00
	Zahlung	6-Month THB-THBFX	3,250	15.06.2032	100	0	0	0	0,00
BPS	Zahlung	6-Month THB-THBFX	3,250	15.06.2032	3.400	1	5	6	0,00
CBK	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,500	16.03.2032	MYR 8.100	9	64	73	0,02
	Zahlung	6-Month THB-THBFX	2,480	18.05.2027	THB 4.000	0	1	1	0,00
	Zahlung	6-Month THB-THBFX	2,810	18.05.2037	32.000	0	(35)	(35)	(0,01)
GLM	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,500	21.09.2027	MYR 4.500	1	10	11	0,00
	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,750	21.09.2032	4.400	(3)	24	21	0,01
	Zahlung	6-Month THB-THBFX	2,000	15.06.2032	THB 13.800	(1)	(17)	(18)	0,00
	Zahlung	6-Month THB-THBFX	3,250	15.06.2032	800	0	1	1	0,00
GST	Erhalt	3-Month THB-THORON Compounded-OIS	2,000	21.09.2024	275.000	(29)	15	(14)	0,00
JPM	Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded- OIS	5,960	11.02.2029	COP 15.800	0	1	1	0,00
	Zahlung	6-Month THB-THBFX	2,000	15.06.2032	THB 24.400	(3)	(29)	(32)	(0,01)
SCX	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,500	21.09.2027	MYR 3.500	3	6	9	0,00
	Erhalt	3-Month THB-THORON Compounded-OIS	2,000	21.09.2024	THB 380.319	17	(36)	(19)	(0,01)
	Erhalt	3-Month THB-THORON Compounded-OIS	2,000	21.09.2027	2.828	0	1	1	0,00
	Erhalt	3-Month THB-THORON Compounded-OIS	2,250	21.09.2027	121.300	(22)	14	(8)	0,00
						\$ (44)	\$ 56	\$ 12	0,00

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	02.2023	\$ 421	AUD 629	\$ 6	\$ 0	\$ 6	0,00
BOA	01.2023	HUF 45.147	\$ 115	0	(5)	(5)	0,00
	01.2023	\$ 123	BRL 641	0	(2)	(2)	0,00
	01.2023	491	HUF 222.264	100	0	100	0,02
	01.2023	80	RON 404	7	0	7	0,00
	01.2023	1	THB 48	0	0	0	0,00
	01.2023	58	ZAR 1.033	2	0	2	0,00
	02.2023	€ 2.080	\$ 2.205	0	(22)	(22)	(0,01)
	02.2023	¥ 51.900	385	0	(10)	(10)	0,00
	02.2023	\$ 6.104	CAD 8.103	0	(121)	(121)	(0,03)
	02.2023	3.851	CHF 3.647	109	0	109	0,03
	02.2023	2.817	€ 2.667	37	0	37	0,01
	02.2023	1.252	¥ 167.500	27	(2)	25	0,01
	02.2023	2.140	NOK 21.243	20	0	20	0,01
	02.2023	2.378	SEK 24.631	0	(8)	(8)	0,00
	02.2023	86	ZAR 1.540	4	0	4	0,00
	03.2023	MYR 2.740	\$ 607	0	(22)	(22)	(0,01)
	03.2023	\$ 205	INR 17.114	1	0	1	0,00
	03.2023	403	ZAR 7.109	13	0	13	0,00
	05.2023	CNH 8.080	\$ 1.249	69	0	69	0,02
BPS	01.2023	HUF 175.855	449	0	(20)	(20)	0,00
	01.2023	TWD 22.286	728	1	0	1	0,00
	01.2023	\$ 5	THB 178	0	0	0	0,00
	02.2023	€ 16.663	\$ 17.278	0	(557)	(557)	(0,14)
	02.2023	2.588	784	49	0	49	0,01
	02.2023	\$ 243	IDR 3.814.182	4	0	4	0,00
	03.2023	MXN 40.466	\$ 2.006	0	(41)	(41)	(0,01)
	03.2023	MYR 56	12	0	(1)	(1)	0,00
	03.2023	TWD 4.135	137	2	0	2	0,00
	03.2023	\$ 461	COP 2.258.511	0	(2)	(2)	0,00
	03.2023	11.328	INR 939.722	0	(28)	(28)	(0,01)
	03.2023	100	MYR 443	1	0	1	0,00
	03.2023	35	TWD 1.046	0	0	0	0,00
	05.2023	MYR 406	\$ 87	0	(6)	(6)	0,00
BRC	01.2023	HUF 538.535	1.404	0	(31)	(31)	(0,01)
	01.2023	PEN 608	153	0	(6)	(6)	0,00
	01.2023	RON 617	124	0	(9)	(9)	0,00
	01.2023	\$ 4.014	CNH 27.990	36	0	36	0,01
	01.2023	1.482	MYR 6.929	102	0	102	0,03
	01.2023	995	PHP 55.524	5	0	5	0,00
	01.2023	1.736	SGD 2.338	8	0	8	0,00
	01.2023	35	THB 1.223	0	0	0	0,00
	02.2023	TWD 45.346	\$ 1.475	0	(7)	(7)	0,00
	02.2023	\$ 1.998	CHF 1.874	37	0	37	0,01

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens		
	03.2023	CNY	2.248	\$	325	\$ 0	\$ (2)	\$ (2)	0,00
	03.2023	INR	13.509		162	0	0	0	0,00
BSH	01.2023	\$	120	BRL	650	3	0	3	0,00
CBK	01.2023	CLP	659.214	\$	739	0	(33)	(33)	(0,01)
	01.2023	THB	21.529		623	0	0	0	0,00
	01.2023	\$	5.667	BRL	29.742	0	(34)	(34)	(0,01)
	01.2023		347	CLP	307.011	13	0	13	0,00
	01.2023		248	DKK	1.725	0	0	0	0,00
	01.2023		123	KRW	157.537	2	0	2	0,00
	01.2023		1.571	NZD	2.458	0	(16)	(16)	0,00
	01.2023		218	THB	7.581	1	0	1	0,00
	02.2023	AUD	6.021	\$	4.032	0	(58)	(58)	(0,01)
	02.2023	CLP	243.870		273	0	(12)	(12)	0,00
	02.2023	ILS	7.262		2.202	142	0	142	0,03
	02.2023	¥	50.000		362	0	(19)	(19)	0,00
	02.2023	\$	377	BRL	2.032	6	0	6	0,00
	02.2023		470	CAD	639	2	0	2	0,00
	02.2023		256	€	240	1	0	1	0,00
	03.2023	PEN	33.120	\$	8.239	0	(399)	(399)	(0,10)
	03.2023	\$	95	MXN	1.867	0	(1)	(1)	0,00
	04.2023	CLP	65.452	\$	74	0	(1)	(1)	0,00
	04.2023	ILS	6.456		1.967	128	0	128	0,03
	04.2023	\$	485	CLP	422.582	3	0	3	0,00
	05.2023	CNH	886	\$	137	8	0	8	0,00
	05.2023	ILS	7.735		2.354	146	0	146	0,04
	05.2023	MXN	214		11	0	0	0	0,00
	11.2023	ILS	5.907		1.765	56	0	56	0,01
CLY	01.2023	CNH	1.432		206	0	(2)	(2)	0,00
	01.2023	HUF	102.035		266	0	(6)	(6)	0,00
DUB	01.2023	DKK	33.412		4.709	0	(88)	(88)	(0,02)
	01.2023	TWD	8.990		294	0	0	0	0,00
GLM	01.2023	BRL	31.033		5.814	2	(65)	(63)	(0,02)
	01.2023	CLP	64.141		65	0	(10)	(10)	0,00
	01.2023	MYR	443		101	0	0	0	0,00
	01.2023	PEN	93		24	0	0	0	0,00
	01.2023	\$	4.169	CNH	29.001	28	0	28	0,01
	01.2023		287	HKD	2.236	0	(1)	(1)	0,00
	01.2023		219	MYR	967	2	0	2	0,00
	01.2023		129	PEN	505	3	0	3	0,00
	01.2023		2.073	PLN	10.473	314	0	314	0,08
	01.2023		2.336	THB	81.436	18	0	18	0,00
	01.2023		88	ZAR	1.573	4	0	4	0,00
	02.2023		287	BRL	1.507	0	(3)	(3)	0,00
	02.2023		14	COP	64.906	0	(1)	(1)	0,00
	03.2023	CLP	405.956	\$	446	0	(26)	(26)	(0,01)
	03.2023	CNH	9.735		1.507	92	0	92	0,02
	03.2023	COP	2.258.511		468	9	0	9	0,00
	03.2023	\$	468	COP	2.258.511	0	(8)	(8)	0,00
	03.2023		353	KZT	171.575	9	0	9	0,00
	03.2023		654	MXN	13.451	26	0	26	0,01
	04.2023		4.601	BRL	24.957	45	0	45	0,01
	05.2023		1.294	PEN	5.148	42	0	42	0,01
	05.2023		38	ZAR	630	0	(1)	(1)	0,00
	06.2023		998	VND	25.691.912	72	0	72	0,02
IND	05.2023	CNH	12.852	\$	1.987	110	0	110	0,03
JPM	01.2023	CAD	276		203	0	0	0	0,00
	01.2023	£	15.842		19.130	70	0	70	0,02
	01.2023	HUF	9		0	0	0	0	0,00
	01.2023	ILS	317		92	3	0	3	0,00
	01.2023	\$	12.473	CNY	86.810	100	0	100	0,02
	01.2023		209	THB	7.248	1	0	1	0,00
	02.2023	TWD	703	\$	23	0	0	0	0,00
	02.2023	\$	418	IDR	6.587.939	8	0	8	0,00
	02.2023		16.162	¥	2.227.350	813	0	813	0,20
	03.2023		22.400	CNY	154.967	129	0	129	0,03
	03.2023		122	IDR	1.915.694	1	0	1	0,00
	04.2023	ILS	7.351	\$	2.212	117	0	117	0,03
MBC	01.2023	DKK	30.314		4.282	0	(71)	(71)	(0,02)
	01.2023	£	433		528	7	0	7	0,00
	01.2023	\$	617	CNH	4.292	4	0	4	0,00
	01.2023		415	£	339	0	(7)	(7)	0,00
	01.2023		1.192	HKD	9.281	0	(3)	(3)	0,00
	01.2023		415	THB	14.373	1	0	1	0,00
	02.2023	€	1.348	\$	1.396	0	(46)	(46)	(0,01)
	03.2023	COP	553.586		114	1	0	1	0,00
	03.2023	\$	122	CLP	109.160	5	0	5	0,00
	03.2023		574	CNY	3.981	5	0	5	0,00
	03.2023		74	IDR	1.162.733	1	0	1	0,00
	05.2023		6.032	CNH	40.482	0	(125)	(125)	(0,03)
MYI	01.2023	€	2	\$	2	0	0	0	0,00
	01.2023	MYR	881		200	0	(2)	(2)	0,00
	01.2023	PLN	549		110	0	(15)	(15)	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen Global Bond Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
	01.2023	THB	250	\$ 7	\$ 0	\$ 0	0,00	
	01.2023	\$	25	€ 24	0	0	0,00	
	01.2023		55	MYR 258	5	0	0,00	
	01.2023		125	PEN 503	7	0	0,00	
	02.2023	AUD	557	\$ 378	0	0	0,00	
	02.2023	€	284	297	0	(7)	0,00	
	02.2023	TWD	1.300	43	0	0	0,00	
	02.2023	\$	517	SEK 5.340	0	(3)	0,00	
	02.2023		136	ZAR 2.481	10	0	0,00	
	03.2023		104	IDR 1.638.262	1	0	0,00	
	03.2023		164	INR 13.620	0	0	0,00	
RBC	02.2023		3.246	NOK 32.390	48	0	0,01	
	03.2023		5.250	MXN 105.002	70	0	0,02	
RYL	01.2023		86	£ 70	0	(2)	0,00	
	01.2023		71	HUF 26.781	0	0	0,00	
SCX	01.2023	NZD	5.359	\$ 3.338	0	(52)	(0,01)	
	01.2023	PEN	1.119	278	0	(15)	0,00	
	01.2023	TWD	59.547	1.893	0	(47)	(0,01)	
	01.2023	\$	415	CLP 412.784	69	0	0,02	
	01.2023		206	CNH 1.431	1	0	0,00	
	01.2023		3.112	KRW 4.111.804	157	0	0,04	
	01.2023		199	MYR 881	2	0	0,00	
	01.2023		175	THB 6.088	1	0	0,00	
	02.2023		6.055	AUD 8.963	34	0	0,01	
	02.2023		966	€ 907	4	0	0,00	
	02.2023		440	IDR 6.931.990	8	0	0,00	
	02.2023		508	¥ 68.000	10	0	0,00	
	02.2023		2.786	TWD 85.718	17	0	0,00	
	03.2023	INR	2.331	\$ 28	0	0	0,00	
	03.2023	MYR	13.768	2.948	0	(213)	(0,05)	
	03.2023	\$	1.406	CNH 9.735	9	0	0,00	
	05.2023	CNH	31.552	\$ 4.565	0	(40)	(0,01)	
	05.2023	\$	3.157	CNH 21.817	29	0	0,01	
SOG	01.2023		806	RON 4.094	77	0	0,02	
TOR	01.2023		129	PEN 516	6	0	0,00	
UAG	01.2023	HUF	314.638	\$ 801	0	(38)	(0,01)	
	01.2023	\$	900	CZK 22.880	111	0	0,03	
	02.2023	TWD	467	\$ 15	0	0	0,00	
	02.2023	\$	648	IDR 10.288.146	17	0	0,00	
	03.2023		74	ZAR 1.326	3	0	0,00	
	05.2023	CNH	6.736	\$ 972	0	(11)	0,00	
	09.2023	\$	447	ZAR 7.833	4	0	0,00	
					\$ 3.893	\$ (2.383)	\$ 1.510	0,37

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilsklasse Institutional CHF (Partially Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
BOA	01.2023	\$	38.361	CHF 36.287	\$ 885	\$ 885	0,22	
BOM	01.2023	CAD	1.067	\$ 795	7	0	0,00	
BRC	01.2023	NOK	5.368	539	0	(6)	0,00	
	01.2023	SEK	8.409	803	0	(5)	0,00	
CBK	01.2023		192	18	0	0	0,00	
	01.2023	\$	46.687	CHF 44.106	1.015	0	0,25	
JPM	01.2023	£	3.540	\$ 4.274	16	0	0,00	
MBC	01.2023	AUD	93	62	0	(1)	0,00	
	01.2023	CAD	1.295	965	10	0	0,00	
	01.2023	CHF	613	665	2	0	0,00	
	01.2023	DKK	3.643	509	0	(14)	0,00	
	01.2023	€	23.405	24.530	0	(460)	(0,11)	
	01.2023	£	177	216	3	0	0,00	
	01.2023	¥	209.608	1.526	0	(64)	(0,02)	
	01.2023	NOK	573	59	0	0	0,00	
	01.2023	\$	191	€ 179	0	0	0,00	
MYI	01.2023	AUD	2.936	\$ 1.972	0	(20)	(0,01)	
	01.2023	¥	862.825	6.294	0	(250)	(0,06)	
RBC	01.2023	AUD	34	23	0	0	0,00	
SCX	01.2023		197	133	0	(1)	0,00	
	01.2023	CAD	931	693	6	0	0,00	
	01.2023	NZD	652	406	0	(6)	0,00	
UAG	01.2023	SEK	536	51	0	0	0,00	
					\$ 1.944	\$ (827)	\$ 1.117	0,27

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Partially Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Partially Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
BOA	01.2023	CHF	218	\$ 231	\$ 0	\$ (5)	0,00	
	01.2023	£	144	174	1	0	0,00	
	01.2023	¥	42.058	319	0	0	0,00	
BOM	01.2023	\$	4	€ 3	0	0	0,00	
	01.2023	CAD	1.946	\$ 1.449	13	0	0,00	
	01.2023	NOK	9.824	987	0	(10)	0,00	
BRC	01.2023	SEK	15.646	1.494	0	(8)	0,00	
	01.2023	CHF	1.812	1.919	0	(41)	(0,01)	
	01.2023	€	28	30	0	0	0,00	
CBK	01.2023	SEK	358	34	0	0	0,00	
	01.2023	\$	241	€ 228	2	0	0,00	
	01.2023	£	6.440	\$ 7.777	28	0	0,01	
JPM	01.2023	AUD	552	374	1	(1)	0,00	
	01.2023	CAD	2.360	1.759	17	0	0,01	
	01.2023	DKK	6.779	948	0	(25)	(0,01)	
MBC	01.2023	€	31	32	0	0	0,00	
	01.2023	£	282	343	4	0	0,00	
	01.2023	¥	339.498	2.466	0	(109)	(0,03)	
MYI	01.2023	NOK	1.049	107	1	0	0,00	
	01.2023	\$	76.360	€ 72.824	1.393	0	1,393	0,34
	01.2023	AUD	4.996	\$ 3.355	0	(34)	(34)	(0,01)
RBC	01.2023	¥	1.610.117	11.744	0	(466)	(466)	(0,11)
	01.2023	AUD	58	39	0	(1)	(1)	0,00
	01.2023	CAD	501	369	0	(1)	(1)	0,00
SCX	01.2023	AUD	335	226	0	(2)	(2)	0,00
	01.2023	CAD	1.697	1.263	11	0	11	0,00
	01.2023	NZD	817	509	0	(8)	(8)	0,00
UAG	01.2023	\$	38.724	€ 37.205	999	0	999	0,24
	01.2023	SEK	998	\$ 95	0	(1)	(1)	0,00
				\$ 2.470	\$ (712)	\$ 1.758	0,43	

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilsklasse Institutional GBP (Partially Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
BOA	01.2023	CHF	0	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00	
	01.2023	\$	11	¥ 1.488	0	0	0,00	
	01.2023	1	NOK	8	0	0	0,00	
BOM	01.2023	1	SEK	11	0	0	0,00	
	01.2023	CAD	1	\$ 1	0	0	0,00	
	01.2023	\$	3	CAD	5	0	0	0,00
BRC	01.2023	NOK	7	\$ 1	0	0	0,00	
	01.2023	SEK	11	1	0	0	0,00	
	01.2023	CHF	2	2	0	0	0,00	
CBK	01.2023	SEK	0	0	0	0	0,00	
	01.2023	\$	2	CHF 2	0	0	0,00	
	01.2023	35	€	32	0	0	0,00	
JPM	01.2023	55	£	46	0	0	0,00	
	01.2023	AUD	0	\$ 0	0	0	0,00	
	01.2023	CAD	2	1	0	0	0,00	
MBC	01.2023	DKK	5	1	0	0	0,00	
	01.2023	€	32	34	0	(1)	(1)	0,00
	01.2023	¥	303	2	0	0	0,00	
MYI	01.2023	NOK	1	0	0	0	0,00	
	01.2023	\$	4	£ 3	0	0	0,00	
	01.2023	AUD	4	\$ 3	0	0	0,00	
RBC	01.2023	¥	1.185	9	0	0	0,00	
	01.2023	\$	1	DKK 5	0	0	0,00	
	01.2023	AUD	0	\$ 0	0	0	0,00	
SCX	01.2023	0	0	0	0	0	0,00	
	01.2023	CAD	1	1	0	0	0,00	
	01.2023	£	94	115	2	0	2	0,00
TOR	01.2023	NZD	1	1	0	0	0,00	
	01.2023	\$	3	AUD 5	0	0	0,00	
	01.2023	55	£	46	0	0	0,00	
UAG	01.2023	1	NZD	1	0	0	0,00	
	01.2023	SEK	1	\$ 0	0	0	0,00	
				\$ 2	\$ (1)	\$ 1	0,00	

Aufstellung der Wertpapieranlagen Global Bond Fund (Forts.)

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilsklasse Institutional NOK (Partially Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
BOA	01.2023	CHF	55	\$	58	\$	(1)	0,00	
BOM	01.2023	CAD	542		404		4	0,00	
BRC	01.2023	SEK	3.888		371		(2)	0,00	
	01.2023	\$	17.474	NOK	173.874		181	0,04	
CBK	01.2023	CHF	457	\$	483		(11)	0,00	
	01.2023	SEK	89		9		0	0,00	
	01.2023	\$	18.978	NOK	187.121		122	0,03	
JPM	01.2023	£	1.740	\$	2.101		8	0,00	
MBC	01.2023	AUD	44		29		0	0,00	
	01.2023	CAD	657		490		5	0,00	
	01.2023	DKK	1.799		252		(7)	0,00	
	01.2023	€	11.530		12.085		(225)	(0,06)	
	01.2023	£	78		95		1	0,00	
	01.2023	¥	91.438		664		(29)	(0,01)	
	01.2023	\$	1.296	NOK	12.682		(9)	0,00	
MYI	01.2023	AUD	1.389	\$	933		(9)	0,00	
	01.2023	¥	433.656		3.163		(126)	(0,03)	
RBC	01.2023	AUD	16		11		0	0,00	
RYL	01.2023	\$	7	NOK	70		0	0,00	
SCX	01.2023	AUD	93	\$	63		(1)	0,00	
	01.2023	CAD	473		352		3	0,00	
	01.2023	NZD	253		158		(3)	0,00	
	01.2023	\$	4.620	NOK	45.843		35	0,01	
UAG	01.2023	SEK	248	\$	24		0	0,00	
							\$	(423)	
							\$	(64)	
							\$	(0,02)	
Summe Freiverkehrsfinanzderivate							\$	3.739	0,91

LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖGENS
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN			
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA	\$ 7.000	\$ (6.227)	(1,52)
2,000 % fällig am 01.01.2038	27.750	(22.586)	(5,51)
2,000 % fällig am 01.01.2053			
Summe Leerverkaufte Wertpapiere		\$ (28.813)	(7,03)
Summe Anlagen		\$ 439.080	106,97
Sonstige Aktiva und Passiva		\$ (28.621)	(6,97)
Nettovermögen		\$ 410.459	100,00

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

- * Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt
- ^ Das Wertpapier ist in Verzug.
- (a) Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.
- (b) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.
- (c) Nullkuponwertpapier.
- (d) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.
- (e) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.
- (f) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.
- (g) Mit dem Fonds verbunden.
- (h) Bedingt wandelbares Wertpapier.
- (i) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2021: 0,20 %):

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeits- datum	Kauf- datum	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
Citigroup, Inc.	3,785 %	17.03.2033	10.03.2022	\$ 1.300	\$ 1.115	0,27
Deutsche Bank AG	3,035	28.05.2032	21.06.2021	1.063	798	0,19
				\$ 2.363	\$ 1.913	0,46

- (j) Wertpapier mit einem Gesamtmarktwert von 1.525 USD (31. Dezember 2021: 35.097 USD) wurden gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen zum 31. Dezember 2022 als Sicherheiten verpfändet.

Barmittel in Höhe von 13.884 USD (31. Dezember 2021: 7.202 USD) wurden zum 31. Dezember 2022 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 1.120 USD (31. Dezember 2021: 2.490 USD) wurden zum 31. Dezember 2022 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 442.801	\$ 831	\$ 443.632
Investmentfonds	18.242	0	0	18.242
Pensionsgeschäfte	0	1.408	0	1.408
Finanzderivate ⁽³⁾	4.652	(41)	0	4.611
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(28.813)	0	(28.813)
Summen	\$ 22.894	\$ 415.355	\$ 831	\$ 439.080

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

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 587.365	\$ 0	\$ 587.365
Investmentfonds	18.823	0	0	18.823
Pensionsgeschäfte	0	206	0	206
Finanzderivate ⁽³⁾	1.409	(154)	0	1.255
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(57.191)	0	(57.191)
Summen	\$ 20.232	\$ 530.226	\$ 0	\$ 550.458

⁽¹⁾ Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

⁽²⁾ Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

⁽³⁾ Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions- geschäften	% des Nettovermögens
MEI	0,500 %	24.11.2022	TBD ⁽¹⁾	€ (1.409)	\$ (1.504)	(0,37)
Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte					\$ (1.504)	(0,37)

⁽¹⁾ Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2021:

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2022			Zum 31. Dez. 2021		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement ⁽¹⁾	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement ⁽¹⁾
AZD	\$ 7	\$ 0	\$ 7	\$ (2)	\$ 0	\$ (2)
BOA	1.000	(730)	270	(436)	580	144
BOM	24	0	24	k. A.	k. A.	k. A.
BPS	(629)	560	(69)	(1.083)	840	(243)
BRC	272	0	272	(31)	230	199
BSH	3	0	3	k. A.	k. A.	k. A.
CBK	1.063	(1.120)	(57)	23	0	23
CLY	(8)	0	(8)	k. A.	k. A.	k. A.
DUB	(125)	20	(105)	64	0	64
FBF	k. A.	k. A.	k. A.	8	0	8
GLM	150	(370)	(220)	(90)	310	220
GSC	k. A.	k. A.	k. A.	(1)	0	(1)
GST	4	0	4	(11)	0	(11)
HUS	(4)	0	(4)	(190)	260	70
IND	110	0	110	k. A.	k. A.	k. A.
JPM	1.248	(760)	488	88	0	88
MBC	264	(90)	174	k. A.	k. A.	k. A.
MYC	(5)	0	(5)	(36)	(560)	(596)
MYI	(909)	540	(369)	1.066	(1.080)	(14)
NAB	k. A.	k. A.	k. A.	274	(270)	4
RBC	116	0	116	9	(10)	(1)
RYL	(2)	0	(2)	(293)	270	(23)
SCX	992	(910)	82	1.310	(1.270)	40
SOG	77	(70)	7	2	0	2
TOR	6	0	6	385	(400)	(15)
UAG	85	0	85	556	(280)	276
WST	k. A.	k. A.	k. A.	(1)	0	(1)

⁽¹⁾ Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Aufstellung der Wertpapieranlagen Global Bond Fund (Forts.)

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2022:

	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	65,89	86,42
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	41,33	25,84
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,88	0,47
Investmentfonds	4,44	3,61
Pensionsgeschäfte	0,34	0,04
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	1,08	0,29
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,87)	(0,36)
Freiverkehrsfinanzderivate	0,91	0,31
Leerverkaufte Wertpapiere	(7,03)	(10,98)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(0,37)	(6,80)

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2022 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
Argentinien	0,02	0,03
Australien	1,74	3,10
Brasilien	0,76	1,12
Kanada	0,73	0,79
Cayman-Inseln	5,78	2,41
Chile	0,56	0,46
China	k. A.	5,11
Kolumbien	0,02	0,02
Tschechische Republik	0,10	0,09
Dänemark	2,67	3,92
Dominikanische Republik	0,16	0,16
Frankreich	2,83	2,73
Deutschland	2,33	2,82
Guatemala	0,10	0,09
Hongkong	0,21	0,27
Ungarn	0,03	0,09
Indien	k. A.	0,35
Indonesien	1,10	1,02
Irland	5,34	4,54
Israel	0,98	1,15
Italien	7,32	6,69
Elfenbeinküste	0,35	k. A.
Japan	4,40	9,32
Kuwait	k. A.	0,82
Luxemburg	0,67	1,01
Malaysia	0,98	1,14
Mexiko	0,28	0,31
Marokko	0,37	k. A.
Multinational	0,25	0,25
Niederlande	1,59	1,58
Neuseeland	0,07	0,07
Norwegen	0,20	0,13
Peru	1,68	1,80
Philippinen	0,08	0,09
Polen	0,03	k. A.
Portugal	0,09	0,10
Katar	0,08	0,50
Rumänien	0,63	0,81
Russland	0,20	0,90
Saudi-Arabien	k. A.	0,86
Serbien	0,88	0,91
Singapur	0,20	1,56
Slowenien	0,18	0,31
Südafrika	0,09	0,25
Südkorea	0,78	0,78
Spanien	1,04	1,42
Supranational	0,71	0,67
Schweiz	1,64	1,23
Thailand	0,26	k. A.
Vereinigte Arabische Emirate	0,05	0,41
Großbritannien	9,05	12,51
USA	45,54	35,04
Kurzfristige Instrumente	2,95	0,99
Investmentfonds	4,44	3,61
Pensionsgeschäfte	0,34	0,04
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	1,09	0,29
Verkaufsoptionen		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	(0,01)	k. A.
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen - Schutzkauf	k. A.	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen - Schutzverkauf	0,00	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes - Schutzkauf	(0,15)	(0,01)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes - Schutzverkauf	k. A.	0,00
Zinsswaps - Basisswaps	0,01	0,01
Zinsswaps	(0,73)	(0,36)

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Zinsswapoptionen	0,05	0,01
Optionen auf Wertpapiere	0,08	0,02
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaptions auf Kreditindizes	0,00	0,00
Devisenoptionen	k. A.	0,00
Zinsswapoptionen	(0,27)	(0,15)
Zinscaps	k. A.	0,00
Optionen auf Wertpapiere	k. A.	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen - Schutzkauf	(0,01)	(0,03)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen - Schutzverkauf	0,01	0,00
Cross-Currency Swaps	0,00	0,00
Zinsswaps	0,00	0,04
Devisenterminkontrakte	0,37	(0,14)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,68	0,56
Leerverkaufte Wertpapiere	(7,03)	(10,98)
Sonstige Aktiva und Passiva	(6,97)	(5,64)
Nettovermögen	100,00	100,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond Fund

BESCHREIBUNG	PARI	MARKT-	% DES	BESCHREIBUNG	PARI	MARKT-	% DES	BESCHREIBUNG	PARI	MARKT-	% DES		
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE	(000S)	WERT	NETTO-	ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE	(000S)	WERT	NETTO-	ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE	(000S)	WERT	NETTO-		
AUSTRALIEN	(000S)	(000S)	VERMÖ-	AUSTRALIEN	(000S)	(000S)	GENS	DÄNEMARK	(000S)	(000S)	GENS		
FÖRDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE			GENS	FÖRDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
Pepper SPARKZ Trust No.3 4,062 % fällig am 17.08.2028	AUD	5.573	\$	3.769	0,03			Jyske Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK	508.210	\$	51.544	0,45
								1,500 % fällig am 01.10.2037		0		0	0,00
								1,500 % fällig am 01.10.2050		0		0	0,00
								2,000 % fällig am 01.10.2047		0		0	0,00
								2,000 % fällig am 01.10.2050		0		0	0,00
								2,500 % fällig am 01.10.2047		0		0	0,00
								Nordea Kredit Realkreditaktieselskab 1,000 % fällig am 01.10.2050	624.300	63.107		0,55	
								1,500 % fällig am 01.10.2037		0		0	0,00
								1,500 % fällig am 01.10.2050		0		0	0,00
								1,500 % fällig am 01.10.2053	40.991	4.540		0,04	
								2,000 % fällig am 01.10.2037		0		0	0,00
								2,000 % fällig am 01.10.2047		0		0	0,00
								2,000 % fällig am 01.10.2050		0		0	0,00
								2,500 % fällig am 01.10.2037		0		0	0,00
								2,500 % fällig am 01.10.2047		0		0	0,00
								2,500 % fällig am 01.10.2050		0		0	0,00
								Nykredit Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.10.2050	1.274.732	132.270		1,16	
								1,000 % fällig am 01.10.2053		0		0	0,00
								1,500 % fällig am 01.10.2037		0		0	0,00
								1,500 % fällig am 01.10.2050		0		0	0,00
								1,500 % fällig am 01.10.2053	8.276	916		0,01	
								2,000 % fällig am 01.10.2047		0		0	0,00
								2,000 % fällig am 01.10.2050		0		0	0,00
								2,500 % fällig am 01.10.2036		0		0	0,00
								2,500 % fällig am 01.10.2047		0		0	0,00
								3,000 % fällig am 01.10.2047		0		0	0,00
								Realkredit Danmark A/S 1,000 % fällig am 01.10.2050	119.791	12.682		0,11	
								1,000 % fällig am 01.10.2053	35.648	3.734		0,03	
								1,500 % fällig am 01.10.2053	8.675	960		0,01	
								2,000 % fällig am 01.10.2050		0		0	0,00
								2,500 % fällig am 01.04.2036		0		0	0,00
								2,500 % fällig am 01.04.2047		0		0	0,00
								3,000 % fällig am 01.07.2046		0		0	0,00
								3,797 % fällig am 01.01.2038		0		0	0,00
								Summe Dänemark		269.753		2,36	
								FINNLAND					
								UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
								Nordea Kiinnitysluottopankki Oyj 0,625 % fällig am 23.05.2025	€	1.000	1.002		0,01
								FRANKREICH					
								UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
								BNP Paribas S.A. 1,675 % fällig am 30.06.2027	\$	16.200	14.118		0,12
								2,219 % fällig am 09.06.2026	5.200	4.779		0,04	
								2,591 % fällig am 20.01.2028	19.553	17.224		0,15	
								2,871 % fällig am 19.04.2032	14.000	10.980		0,10	
								4,400 % fällig am 14.08.2028	200	189		0,00	
								Dexia Credit Local S.A. 0,000 % fällig am 21.01.2028 (c)	€	9.100	8.252		0,07
								0,500 % fällig am 17.01.2025	2.300	2.320		0,02	
								0,750 % fällig am 25.01.2023	24.200	25.811		0,23	
								3,250 % fällig am 26.09.2023	\$	6.100	6.029		0,05
								Mutuelle Assurance Des Commerçants et Industriels de France et Des Cadres et Sal 0,625 % fällig am 21.06.2027	€	7.000	6.175		0,05
								Societe Generale S.A. 1,488 % fällig am 14.12.2026	\$	21.700	18.883		0,17
								2,226 % fällig am 21.01.2026	24.200	22.275		0,20	
								2,797 % fällig am 19.01.2028	17.500	15.335		0,13	
								6,221 % fällig am 15.06.2033	20.600	19.323		0,17	
								Summe Finnland		171.693		1,50	
								STAATSEMISSIONEN					
								Bpifrance Financement S.A. 3,000 % fällig am 10.09.2026	€	12.500	13.233		0,11
								France Government International Bond 0,500 % fällig am 25.06.2044	6.750	4.163		0,04	
								0,500 % fällig am 25.05.2072	15.250	6.069		0,05	
								0,750 % fällig am 25.05.2052	115.450	65.069		0,57	
								2,000 % fällig am 25.05.2048	73.081	60.293		0,53	

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS			
JAPAN				MULTINATIONAL				NORWEGEN						
Japan Finance Organization for Municipalities				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Norway Government International Bond						
0,625 % fällig am 02.09.2025	\$	1.400	1,255	0,01	1,125 % fällig am 12.01.2032	€	300	267	0,00	1,250 % fällig am 17.09.2031	NOK	1.900	165	0,00
3,000 % fällig am 12.03.2024		13.100	12.814	0,11	Cooperative Rabobank UA		2.300	1.966	0,02	1,750 % fällig am 13.03.2025		86.700	8.553	0,07
3,375 % fällig am 27.09.2023		20.000	19.750	0,17	CTP NV		10.500	8.637	0,07	1,750 % fällig am 17.02.2027		1.100	106	0,00
Japan Government International Bond				5,169 % fällig am 22.12.2036	\$	9.039	8.407	0,07	2,000 % fällig am 26.04.2028		7.300	702	0,01	
0,100 % fällig am 10.03.2028 (e)	¥	10.531.194	82.569	0,72	5,625 % fällig am 06.04.2033		3.264	3.042	0,03				25.891	0,23
0,200 % fällig am 20.06.2036		362.750	2.506	0,02	NIEDERLANDE						30.449	0,27		
0,500 % fällig am 20.09.2046		8.768.000	54.166	0,47	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL									
0,500 % fällig am 20.03.2049		11.468.000	68.068	0,60	ABN AMRO Bank NV									
0,700 % fällig am 20.12.2048		8.081.650	50.767	0,45	1,125 % fällig am 12.01.2032	€	300	267	0,00					
0,700 % fällig am 20.06.2051		202.000	1.230	0,01	Cooperative Rabobank UA		2.300	1.966	0,02					
1,000 % fällig am 20.03.2052		70.000	460	0,00	0,625 % fällig am 27.09.2026	€	10.500	8.637	0,07					
1,300 % fällig am 20.06.2052		500.000	3.565	0,03	0,875 % fällig am 20.01.2026		14.100	12.265	0,11					
Tokyo Metropolitan Government				1,500 % fällig am 27.09.2031		6.500	4.171	0,04						
0,750 % fällig am 16.07.2025	\$	18.600	16.757	0,15	E.ON International Finance BV		€	400	484	0,00				
2,625 % fällig am 29.05.2024		4.100	3.964	0,04	5,625 % fällig am 06.12.2033	£								
			342.724	3,00	Enel Finance International NV									
Summe Japan			691.842	6,06	0,000 % fällig am 28.05.2026	€	5.300	4.997	0,04					
JERSEY, KANALINSELN				1,875 % fällig am 12.07.2028	\$	2.500	1.990	0,02						
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				2,250 % fällig am 12.07.2031		400	292	0,00						
Titan Europe Ltd.				2,650 % fällig am 10.09.2024		25.800	24.702	0,22						
4,250 % fällig am 11.09.2025	€	10.000	8.964	0,08	IMCD NV									
LUXEMBURG				2,500 % fällig am 26.03.2025	€	200	207	0,00						
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				ING Groep NV										
Aroundtown S.A.				4,100 % fällig am 02.10.2023	\$	2.600	2.580	0,02						
0,000 % fällig am 16.07.2026 (c)		11.000	8.378	0,07	5,750 % fällig am 16.11.2026		800	711	0,01					
0,375 % fällig am 15.04.2027		1.700	1.203	0,01	5,754 % fällig am 02.10.2023		2.400	2.406	0,02					
5,375 % fällig am 21.03.2029	\$	2.700	2.047	0,02	LeasePlan Corp. NV									
CBRE Global Investors Open-Ended Fund S.C.A. SICAV-SIF Pan European Core Fund				1,000 % fällig am 02.05.2023	€	300	318	0,00						
0,900 % fällig am 12.10.2029	€	200	156	0,00	Sagax Euro MTN NL BV		11.900	11.181	0,10					
CPI Property Group S.A.				2,250 % fällig am 24.02.2026										
1,625 % fällig am 23.04.2027		14.500	11.055	0,10	Volkswagen Financial Services NV		£	2.800	3.045	0,03				
1,750 % fällig am 14.01.2030		10.400	6.772	0,06	0,875 % fällig am 20.02.2025		9.600	11.268	0,10					
2,750 % fällig am 12.05.2026		1.400	1.177	0,01	1,125 % fällig am 18.09.2023									
Logicor Financing SARL							91.487			0,80				
0,625 % fällig am 17.11.2025		4.600	4.204	0,04	NON-AGENCY-MBS									
0,750 % fällig am 15.07.2024		10.900	10.690	0,09	Domi BV									
2,250 % fällig am 13.05.2025		2.000	1.954	0,02	2,896 % fällig am 15.06.2051	€	136	144	0,00					
Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.				Dutch Property Finance BV										
5,125 % fällig am 29.10.2022 ^	\$	500	58	0,00	2,208 % fällig am 28.04.2051		229	243	0,00					
			47.694	0,42	2,228 % fällig am 28.07.2054		296	313	0,00					
NON-AGENCY-MBS				2,228 % fällig am 28.07.2058		14.870	15.668	0,14						
Miravet SARL				Eurosail BV										
2,758 % fällig am 26.05.2065	€	14.356	14.812	0,13	2,878 % fällig am 17.10.2040		59	63	0,00					
Summe Luxemburg			62.506	0,55	Jubilee Place BV									
MALAYSIA				2,208 % fällig am 17.07.2058		10.805	11.363	0,10						
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				2,378 % fällig am 17.10.2057		6.241	6.608	0,06						
Petronas Capital Ltd.							34.402			0,30				
2,480 % fällig am 28.01.2032	\$	5.500	4.560	0,04	Summe Niederlande			125.889			1,10			
3,500 % fällig am 21.04.2030		8.600	7.865	0,07	NEUSEELAND									
4,550 % fällig am 21.04.2050		6.100	5.470	0,05	STAATSEMISSIONEN									
4,800 % fällig am 21.04.2060		5.000	4.604	0,04	Auckland Council									
			22.499	0,20	1,000 % fällig am 19.01.2027		5.800	5.659	0,05					
STAATSEMISSIONEN				New Zealand Government International Bond										
Malaysia Government International Bond				1,500 % fällig am 15.05.2031	NZD	22.600	11.382	0,10						
3,480 % fällig am 15.03.2023	MYR	200.400	45.539	0,40	2,000 % fällig am 20.09.2025		1.930	780	0,01					
Summe Malaysia			68.038	0,60	5,500 % fällig am 15.04.2023		9.063	5.745	0,05					
MEXIKO				Summe Neuseeland			23.566			0,21				
STAATSEMISSIONEN				NORWEGEN										
Mexico Government International Bond				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL										
4,000 % fällig am 15.03.2115	€	800	602	0,01	DNB Boligkredit A/S									
5,000 % fällig am 27.04.2051	\$	7.800	6.358	0,05	3,250 % fällig am 28.06.2023	\$	4.600	4.558	0,04					
10,000 % fällig am 05.12.2024	MXN	130.573	6.715	0,06	STAATSEMISSIONEN									
Summe Mexiko			13.675	0,12	Kommunalbanken A/S									
				0,625 % fällig am 20.04.2026	€	600	588	0,01						
				1,900 % fällig am 19.01.2027	AUD	22.000	13.503	0,12						
				5,250 % fällig am 15.07.2024		3.300	2.274	0,02						

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
SLOWENIEN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Nova Kreditna Banka Maribor d.d. 1,875 % fällig am 27.01.2025	€ 11.200	10.843	0,09
Nova Ljubljanska Banka d.d. 3,400 % fällig am 05.02.2030 3,650 % fällig am 19.11.2029	3.500 8.300	3.100 7.441	0,03 0,07
Summe Slowenien		21.384	0,19
SÜDAFRIKA			
STAATSEMISSIONEN			
South Africa Government International Bond 7,750 % fällig am 28.02.2023 8,750 % fällig am 28.02.2048	ZAR 4.275 2.125	251 98	0,00 0,00
Summe Südafrika		349	0,00
SÜDKOREA			
STAATSEMISSIONEN			
South Korea Government International Bond 2,125 % fällig am 10.06.2027 2,375 % fällig am 10.12.2027 2,375 % fällig am 10.12.2028 2,625 % fällig am 10.06.2028 5,500 % fällig am 10.03.2028	KRW 16.365.000 14.900.000 69.980.000 32.730.000 14.900.000	12.071 11.038 51.329 24.438 12.728	0,11 0,10 0,45 0,21 0,11
Summe Südkorea		111.604	0,98
SPANIEN			
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE			
BBVA Consumer Auto 0,270 % fällig am 20.07.2031	€ 8.115	8.469	0,08
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. 5,875 % fällig am 24.09.2023 (f)(h)	10.400	10.694	0,09
Banco Santander S.A. 1,849 % fällig am 25.03.2026 4,175 % fällig am 24.03.2028 4,375 % fällig am 14.01.2026 (f)(h)	\$ 5.800 7.800 € 1.400	5.126 7.246 1.274	0,05 0,06 0,01
CaixaBank S.A. 1,750 % fällig am 24.10.2023 5,875 % fällig am 09.10.2027 (f)(h)	10.400 2.800	10.977 2.745	0,10 0,02
		38.062	0,33
NON-AGENCY-MBS			
Fondo de Titulacion de Activos Santander Hipotecario 1,553 % fällig am 18.01.2049	463	484	0,00
Fondo de Titulacion de Activos UCI 2,186 % fällig am 15.09.2041	866	884	0,01
IM Pastor Fondo de Titulacion Hipotecaria 2,261 % fällig am 22.09.2041	0	0	0,00
		1.368	0,01
STAATSEMISSIONEN			
Autonomous Community of Catalonia 4,220 % fällig am 26.04.2035	3.900	4.044	0,03
Autonomous Community of Madrid 1,571 % fällig am 30.04.2029	1.300	1.239	0,01
Spain Government International Bond 1,450 % fällig am 31.10.2071 1,900 % fällig am 31.10.2052 3,450 % fällig am 30.07.2066 5,250 % fällig am 06.04.2029	7.375 2.700 53.300 € 800	3.611 1.836 50.311 990	0,03 0,02 0,44 0,01
		62.031	0,54
Summe Spanien		109.930	0,96
SUPRANATIONAL			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Europäische Bank für Wiederaufbau und Entwicklung 0,500 % fällig am 01.09.2023 0,500 % fällig am 21.12.2023	AUD 5.400 4.000	3.579 2.617	0,03 0,02

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
SCHWEDEN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Molnycke Holding AB 1,875 % fällig am 28.02.2025	€ 400	407	0,00
SCHWEIZ			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Credit Suisse AG 0,250 % fällig am 05.01.2026 6,500 % fällig am 08.08.2023 (h)	11.800 \$ 30.906	10.718 30.001	0,10 0,26
Credit Suisse Group AG 2,193 % fällig am 05.06.2026 2,875 % fällig am 02.04.2032 3,091 % fällig am 14.05.2032 3,800 % fällig am 09.06.2023 3,869 % fällig am 12.01.2029 4,194 % fällig am 01.04.2031 4,550 % fällig am 17.04.2026 6,442 % fällig am 11.08.2028 6,537 % fällig am 12.08.2033 7,250 % fällig am 12.09.2025 (f)(h) 7,375 % fällig am 07.09.2033 7,750 % fällig am 01.03.2029	400 € 19.700 \$ 16.700 4.750 12.550 1.600 400 20.600 5.700 € 1.200 € 14.900 € 7.900	342 15.255 11.572 4.626 10.078 1.245 353 18.791 5.015 863 16.365 8.400	0,00 0,13 0,10 0,04 0,09 0,01 0,00 0,17 0,04 0,01 0,14 0,07
UBS AG 5,125 % fällig am 15.05.2024 (h)	\$ 1.700	1.682	0,02
UBS Group AG 4,488 % fällig am 12.05.2026 4,703 % fällig am 05.08.2027 4,751 % fällig am 12.05.2028	1.500 4.100 2.600	1.467 3.968 2.492	0,01 0,04 0,02
Summe Schweiz		143.233	1,25
THAILAND			
STAATSEMISSIONEN			
Thailand Government International Bond 3,390 % fällig am 17.06.2037 3,450 % fällig am 17.06.2043	THB 333.598 793.970	10.034 23.273	0,09 0,20
Summe Thailand		33.307	0,29
VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
MDGH GMTN RSC Ltd. 5,500 % fällig am 28.04.2033	\$ 7.000	7.411	0,07
GROSSBRITANNIEN			
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE			
PCL Funding PLC 4,076 % fällig am 15.10.2025	£ 400	480	0,00
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Astrazeneca PLC 5,315 % fällig am 17.08.2023	\$ 400	400	0,00
Barclays PLC 3,125 % fällig am 17.01.2024 4,338 % fällig am 16.05.2024 4,375 % fällig am 12.01.2026 5,396 % fällig am 26.06.2024 6,024 % fällig am 16.05.2024 6,375 % fällig am 15.12.2025 (f)(h) 7,750 % fällig am 15.09.2023 (f)(h)	£ 800 \$ 1.200 2.200 AUD 4.000 \$ 6.800 £ 4.300 \$ 2.100	941 1.192 2.131 2.730 6.800 4.755 2.055	0,01 0,01 0,02 0,02 0,06 0,04 0,02
GSK Consumer Healthcare Capital UK PLC 3,125 % fällig am 24.03.2025	16.600	15.800	0,14
HSBC Holdings PLC 1,500 % fällig am 04.12.2024 2,848 % fällig am 04.06.2031 2,999 % fällig am 10.03.2026 3,950 % fällig am 18.05.2024	€ 500 \$ 9.900 1.300 800	524 7.923 1.223 794	0,00 0,07 0,01 0,01

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
3,973 % fällig am 22.05.2030 4,041 % fällig am 13.03.2028 4,150 % fällig am 16.02.2024 4,583 % fällig am 19.06.2029 4,755 % fällig am 09.06.2028 5,210 % fällig am 11.08.2028 5,674 % fällig am 18.05.2024	\$ 21.700 7.300 AUD 4.000 \$ 19.600 11.200 19.400 6.900	19.037 6.738 2.710 18.080 10.604 18.748 6.875	0,17 0,06 0,02 0,16 0,09 0,16 0,06
Jaguar Land Rover Automotive PLC 6,875 % fällig am 15.11.2026	€ 3.800	3.618	0,03
John Lewis PLC 6,125 % fällig am 21.01.2025	£ 100	116	0,00
Lloyds Banking Group PLC 4,650 % fällig am 24.03.2026 4,947 % fällig am 27.06.2025 (f)(h)	\$ 1 € 300	0 307	0,00 0,00
Nationwide Building Society 1,700 % fällig am 13.02.2023 2,972 % fällig am 16.02.2028 3,766 % fällig am 08.03.2024 4,363 % fällig am 01.08.2024 5,750 % fällig am 20.06.2027 (f)(h)	\$ 11.700 8.800 400 11.200 £ 2.500	11.663 7.747 398 11.056 2.706	0,10 0,07 0,00 0,10 0,02
Natwest Group PLC 4,445 % fällig am 08.05.2030 5,076 % fällig am 27.01.2030	\$ 4.775 19.200	4.334 18.126	0,04 0,16
NatWest Markets PLC 1,000 % fällig am 28.05.2024	€ 7.721	7.951	0,07
Prudential PLC 2,950 % fällig am 03.11.2033	\$ 24.600	20.178	0,18
Rolls-Royce PLC 3,625 % fällig am 14.10.2025	200	185	0,00
Santander UK Group Holdings PLC 3,373 % fällig am 05.01.2024 4,750 % fällig am 15.09.2025 4,796 % fällig am 15.11.2024	7.000 600 20.100	7.000 572 19.769	0,06 0,01 0,17
Santander UK PLC 3,782 % fällig am 12.02.2027	£ 16.900	20.301	0,18
Standard Chartered PLC 0,991 % fällig am 12.01.2025 1,822 % fällig am 23.11.2025 2,608 % fällig am 12.01.2028 2,678 % fällig am 29.06.2032	\$ 13.400 28.100 12.700 600	12.665 25.684 11.032 454	0,11 0,23 0,10 0,00
Tesco Corporate Treasury Services PLC 1,375 % fällig am 24.10.2023	€ 8.900	9.376	0,08
TP ICAP Finance PLC 2,625 % fällig am 18.11.2028	£ 9.800	8.689	0,08
Virgin Money UK PLC 0,375 % fällig am 27.05.2024	€ 6.500	6.809	0,06
		340.796	2,98
NON-AGENCY-MBS			
Alba PLC 2,206 % fällig am 15.12.2038 3,692 % fällig am 15.12.2038	104 £ 4.740	102 5.307	0,00 0,05
Ferguson Finance PLC 4,331 % fällig am 20.09.2048	22.037	26.007	0,23
Brass PLC 3,965 % fällig am 16.11.2066	4.961	5.977	0,05
Business Mortgage Finance PLC 4,359 % fällig am 15.02.2041	14	17	0,00
Canada Square Funding PLC 4,205 % fällig am 17.06.2058 4,375 % fällig am 17.06.2058 4,675 % fällig am 17.12.2057	19.163 301 4.768	22.188 355 5.666	0,19 0,00 0,05
Eurohome UK Mortgages PLC 3,946 % fällig am 15.06.2044	164	189	0,00
Eurosaif PLC 2,165 % fällig am 13.03.2045 2,245 % fällig am 13.03.2045 2,286 % fällig am 15.12.2044 3,661 % fällig am 13.03.2045 4,211 % fällig am 13.09.2045 4,461 % fällig am 13.06.2045	€ 23 400 191 £ 68 947 53	25 412 195 80 1.099 62	0,00 0,00 0,00 0,00 0,01 0,00
Finsbury Square PLC 4,209 % fällig am 16.03.2070 4,419 % fällig am 16.12.2069 4,709 % fällig am 16.06.2070	740 2.996 4.546	887 3.602 5.458	0,01 0,03 0,05

BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖGENS
INVESTMENTFONDS				ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN			
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund (g)	5.290.441	\$ 53.010	0,46	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (g)	6.338.731	\$ 63.096	0,55
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO European High Yield Bond Fund (g)	1.355.380	14.292	0,13	PIMCO Specialty Funds Ireland p.l.c. - PIMCO China Bond Fund (g)	345.274	4.599	0,04
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Global Bond Ex-US Fund (g)	10.956.929	104.748	0,92		322.306	2,82	
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - UK Corporate Bond Fund (g)	7.715.431	79.259	0,69	BÖRSENGEHANDELTE FONDS			
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - US Short-Term Fund (g)	330.807	3.302	0,03	PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (g)	3.455.880	356.374	3,12
				PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (g)	4.464.740	442.299	3,88
					798.673	7,00	
				Summe Investmentfonds	\$ 1.120.979	9,82	

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft ⁽¹⁾	% des Nettovermögens
BPS	4,200 %	03.01.2023	04.01.2023	\$ 660.000	U.S. Treasury Notes 0,125 % - 1,375 % fällig am 15.01.2024 - 15.11.2031	\$ (674.208)	\$ 660.000	\$ 660.077	5,77
CIB	4,260	30.12.2022	03.01.2023	562.700	U.S. Treasury Bonds 2,000 % fällig am 15.08.2051	(307.187)	562.700	562.966	4,93
FICC	1,900	30.12.2022	03.01.2023	11.570	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.10.2024	(269.857)			
	4,280	30.12.2022	03.01.2023	112.700	U.S. Treasury Notes 0,125 % fällig am 15.05.2023	(11.801)	11.570	11.571	0,10
					U.S. Treasury Notes 2,000 % - 4,275 % fällig am 30.11.2022 - 30.04.2024	(114.954)	112.700	112.754	0,99
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (1.378.007)	\$ 1.346.970	\$ 1.347.368	11,79

⁽¹⁾ Umfasst aufgelaufene Zinsen.**AN EINEM GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*, außer Anzahl der Kontrakte)**

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
3-Month Euribor December Futures	Short	03.2024	10.716	\$ 4.303	0,04
3-Month Euribor June Futures	Long	09.2023	6.398	(4.390)	(0,04)
3-Month Euribor June Futures	Long	09.2024	5.358	(1.709)	(0,02)
Australia Government 3-Year Note March Futures	Short	03.2023	1.037	995	0,01
Australia Government 10-Year Bond March Futures	Long	03.2023	1.225	(5.388)	(0,05)
Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 146,000 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond March 2023 Futures ⁽¹⁾	Short	01.2023	131	105	0,00
Canada Government 10-Year Bond March Futures	Short	03.2023	1.057	1.743	0,02
Euro-Bobl March Futures	Short	03.2023	3.178	12.301	0,11
Euro-BTP Italy Government Bond March Futures	Short	03.2023	3.157	7.146	0,06
Euro-Bund 10-Year Bond March Futures	Short	03.2023	394	3.204	0,03
Euro-Buxl 30-Year Bond March Futures	Long	03.2023	17	(464)	0,00
Euro-OAT France Government 10-Year Bond March Futures	Short	03.2023	4.842	47.543	0,42
Japan Government 10-Year Bond March Futures	Long	03.2023	95	(1.985)	(0,02)
Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 138,500 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond September 2023 Futures ⁽¹⁾	Short	01.2023	131	(670)	(0,01)
U.S. Treasury 2-Year Note March Futures	Short	03.2023	42	(11)	0,00
U.S. Treasury 5-Year Note March Futures	Long	03.2023	10.307	(1.967)	(0,02)
U.S. Treasury 10-Year Note March Futures	Long	03.2023	2.308	(2.149)	(0,02)
U.S. Treasury 30-Year Bond March Futures	Short	03.2023	11	(1)	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond March Futures	Long	03.2023	5	4	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond March Futures	Short	03.2023	5.440	4.096	0,04
United Kingdom Long Gilt March Futures	Short	03.2023	1.352	8.947	0,08
				\$ 71.653	0,63

⁽¹⁾ Future-Style-Option.

Aufstellung der Wertpapieranlagen Global Bond Fund (Forts.)

VERKAUFSOPTIONEN

OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
Call - CME Call Options Strike @ USD 98.000 on 3-Month SOFR December Futures	\$ 98,000	15.12.2023	222	\$ 0	\$ (19)	0,00
Put - CME Put Options Strike @ USD 96.500 on 3-Month SOFR December Futures	96,500	15.12.2023	222	0	(673)	(0,01)
				\$ 0	\$ (692)	(0,01)

Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate

\$ 70.961 0,62

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nennbetrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AT&T, Inc.	1,000 %	20.12.2023	\$ 5.900	\$ (65)	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20.12.2027	€ 5.700	(80)	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20.06.2028	5.700	(168)	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20.06.2026	\$ 800	17	0,00
Jaguar Land Rover Automotive PLC	5,000	20.06.2026	€ 17.500	(3.378)	(0,03)
Rolls-Royce PLC	1,000	20.12.2024	7.400	(112)	0,00
Tesco PLC	1,000	20.06.2025	2.900	105	0,00
				\$ (3.681)	(0,03)

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF⁽²⁾

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nennbetrag ⁽³⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.IG-38 10-Year Index	(1,000) %	20.06.2032	\$ 23.125	\$ (224)	0,00
CDX.IG-39 10-Year Index	(1,000)	20.12.2032	785.500	(9.983)	(0,09)
iTraxx Europe Main 37 10-Year Index	(1,000)	20.06.2032	€ 72.400	(1.021)	(0,01)
iTraxx Europe Main 38 10-Year Index	(1,000)	20.12.2032	116.900	(2.764)	(0,03)
				\$ (13.992)	(0,13)

ZINSSWAPS - BASISSWAPS

Zahlung variabler Zinssatzindex	Erhalt variabler Zinssatzindex	Fälligkeits- datum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
3-Month USD-LIBOR	1-Month USD-LIBOR + 0,070 %	07.03.2024	\$ 110.900	\$ 92	0,00
3-Month USD-LIBOR	1-Month USD-LIBOR + 0,073 %	27.04.2023	339.800	229	0,00
3-Month USD-LIBOR	1-Month USD-LIBOR + 0,086 %	12.04.2023	400	0	0,00
3-Month USD-LIBOR	1-Month USD-LIBOR + 0,088 %	06.09.2024	611.900	462	0,01
3-Month USD-LIBOR	1-Month USD-LIBOR + 0,102 %	04.10.2024	300.600	59	0,00
3-Month USD-LIBOR	1-Month USD-LIBOR + 0,105 %	27.09.2024	350.000	118	0,00
				\$ 960	0,01

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	0,010 %	07.02.2023	£ 579.800	\$ (11.587)	(0,10)
Zahlung ⁽⁴⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	2,000	15.03.2033	289.700	(3.846)	(0,03)
Zahlung ⁽⁴⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	2,000	15.03.2053	32.000	(1.366)	(0,01)
Zahlung ⁽⁴⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	2,250	15.03.2028	65.700	(2.324)	(0,02)
Erhalt ⁽⁴⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	2,500	15.03.2025	118.200	1.500	0,01
Erhalt	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	5,750	16.03.2027	INR 17.547.860	(3.564)	(0,03)
Zahlung	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	6,250	21.09.2023	41.579.150	(1.664)	(0,01)
Zahlung	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	6,250	21.09.2024	6.508.260	(201)	0,00
Erhalt	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	6,250	16.03.2032	1.797.200	(858)	(0,01)
Zahlung	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	6,500	21.09.2024	8.580.695	421	0,00
Erhalt	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	6,500	21.09.2027	4.115.600	(497)	0,00
Zahlung	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	6,750	21.09.2024	19.925.550	1.250	0,01
Erhalt	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	7,000	21.09.2027	4.391.900	(1.051)	(0,01)
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000	17.03.2031	¥ 14.710.000	(6.406)	(0,06)
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,050	15.12.2031	18.270.000	(5.407)	(0,05)
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,200	19.06.2029	6.440.000	(2.885)	(0,03)
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,400	19.06.2039	13.160.000	12.134	0,11
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,800	15.06.2052	3.460.000	3.227	0,03
Zahlung	1-Day SGD-MIBOR Compounded-OIS	1,250	15.09.2031	SGD 510	(19)	0,00
Erhalt	1-Day SGD-MIBOR Compounded-OIS	1,250	15.09.2031	510	11	0,00
Zahlung	1-Day SGD-MIBOR Compounded-OIS	2,500	21.09.2027	75.800	(1.367)	(0,01)
Zahlung	1-Day SGD-MIBOR Compounded-OIS	2,750	15.06.2027	120.300	(1.452)	(0,01)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	1-Day SGD-MIBOR Compounded-OIS	2,750 %	21.09.2027	SGD 172.226	\$ (1.025)	(0,01)
Zahlung	1-Day SGD-MIBOR Compounded-OIS	3,000	15.06.2027	45.600	(179)	0,00
Zahlung	1-Day SGD-MIBOR Compounded-OIS	3,250	21.12.2027	25.280	(113)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,000	15.06.2029	\$ 145.400	(12.495)	(0,11)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,250	15.12.2028	58.224	(7.790)	(0,07)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,430	31.03.2024	256.050	(12.537)	(0,11)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,488	15.08.2031	25.600	(4.095)	(0,04)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,618	09.02.2029	21.600	(2.394)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,695	15.11.2031	422.100	(60.175)	(0,53)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2024	610.261	103	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2025	6.500	43	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2027	1.265.781	38.297	0,34
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2029	78.470	3.749	0,03
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2032	375.550	(829)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2052	1,750	(1.103)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,888	22.03.2029	63.800	(6.178)	(0,05)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,175	21.04.2029	61.700	(5.008)	(0,04)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,750	30.04.2029	39.400	2.087	0,02
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,817	30.04.2029	74.000	3.627	0,03
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,818	30.04.2029	66.900	3.275	0,03
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,819	30.04.2029	65.800	3.220	0,03
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,886	15.05.2032	641.100	(37.781)	(0,33)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,965	30.11.2026	1.256.200	41.945	0,37
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,050	08.09.2029	11.300	(336)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,100	09.09.2029	31.000	(826)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,454	30.06.2029	82.000	(902)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,898	30.06.2029	66.300	957	0,01
Erhalt ⁽⁴⁾	3-Month AUD-BBR-BBSW	3,750	15.03.2024	AUD 1.327.300	1.245	0,01
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,235	04.03.2025	CAD 57.400	(3.283)	(0,03)
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,250	16.06.2031	37.200	(548)	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,500	17.06.2025	84.100	(3.492)	(0,03)
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,500	17.06.2030	207.300	(20.404)	(0,18)
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,713	02.10.2029	81.100	(7.464)	(0,07)
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,900	18.12.2029	107.300	(10.115)	(0,09)
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	2,500	28.01.2052	14.500	(2.316)	(0,02)
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	3,028	25.03.2052	21.700	(1.878)	(0,02)
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	0,283	14.02.2027	CHF 47.000	(2.838)	(0,03)
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	0,294	10.02.2027	19.900	(1.142)	(0,01)
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	0,343	16.05.2027	31.300	(2.021)	(0,02)
Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,500	16.03.2027	CNY 382.500	(779)	(0,01)
Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,500	21.12.2027	21.700	(3)	0,00
Erhalt	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,500	21.12.2027	21.700	32	0,00
Zahlung	3-Month EUR-ESTRON Compounded-OIS	1,000	23.11.2024	€ 259.600	(2.687)	(0,02)
Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	3,000	21.09.2027	KRW 225.110.930	(4.196)	(0,04)
Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	3,000	15.06.2032	38.248.600	(1.222)	(0,01)
Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	3,250	15.06.2032	14.534.600	(278)	0,00
Zahlung	3-Month NZD-BBR	0,110	16.12.2023	NZD 600	(18)	0,00
Zahlung	3-Month NZD-BBR	0,528	17.03.2024	10.000	(364)	0,00
Zahlung	3-Month NZD-BBR	3,000	01.11.2023	324.700	(4.441)	(0,04)
Zahlung	3-Month NZD-BBR	3,000	15.12.2023	370.050	(5.428)	(0,05)
Zahlung	3-Month NZD-BBR	3,750	15.06.2027	102.300	(2.101)	(0,02)
Zahlung ⁽⁴⁾	3-Month NZD-BBR	4,000	14.06.2024	624.400	(4.305)	(0,04)
Zahlung	3-Month SEK-STIBOR	0,500	19.06.2024	SEK 260.100	(1.618)	(0,01)
Zahlung	3-Month SEK-STIBOR	1,000	19.06.2029	56.700	(884)	(0,01)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,250	30.03.2023	\$ 63.900	(737)	(0,01)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,400	15.01.2028	578.050	(93.042)	(0,81)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,750	15.12.2024	1.200	(82)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,249	31.08.2024	179.400	10.370	0,09
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,250	15.12.2026	444.500	52.798	0,46
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,298	25.08.2024	155.100	8.882	0,08
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,360	17.09.2024	53.950	2.976	0,03
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,500	15.12.2028	233.690	(33.821)	(0,30)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,518	20.01.2029	17.800	(2.304)	(0,02)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,545	20.01.2029	3.000	(383)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,630	20.01.2029	63.600	(7.817)	(0,07)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,630	26.01.2029	14.700	(1.801)	(0,02)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	2,000	15.12.2051	66.000	(24.075)	(0,21)
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	7,250	20.06.2023	ZAR 263.900	(107)	0,00
Erhalt	6-Month AUD-BBR-BBSW	1,250	17.06.2030	AUD 128.300	20.590	0,18
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	1,750	16.03.2027	92.600	(5.944)	(0,05)
Zahlung ⁽⁴⁾	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,250	15.09.2032	40.100	(591)	(0,01)
Zahlung ⁽⁴⁾	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,250	15.03.2033	34.000	(405)	0,00
Zahlung ⁽⁴⁾	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,500	15.09.2032	899.000	(9.221)	(0,08)
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	1,913	30.01.2029	CZK 158.300	(1.232)	(0,01)
Erhalt ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	0,054	27.05.2050	€ 7.450	3.256	0,03
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,064	17.11.2052	17.650	9.405	0,08
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,550	10.08.2024	12.500	(538)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,650	12.04.2027	34.400	(3.528)	(0,03)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,650	11.05.2027	24.400	(2.492)	(0,02)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,700	11.04.2027	19.200	(1.926)	(0,02)
Zahlung ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	1,000	30.03.2024	76.900	(1.806)	(0,02)

Aufstellung der Wertpapieranlagen Global Bond Fund (Forts.)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,000 %	13.05.2027	€ 41.000	\$ (3.625)	(0,03)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,000	18.05.2027	18.100	(1.599)	(0,01)
Zahlung ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	1,500	15.03.2025	74.200	(1.766)	(0,02)
Zahlung ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	1,500	15.03.2028	773.100	(14.908)	(0,13)
Erhalt ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	1,500	15.03.2053	164.000	11.180	0,10
Zahlung ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	1,750	15.03.2033	1.197.800	(39.697)	(0,35)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,250	21.09.2037	55.870	(3.911)	(0,03)
Zahlung ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	19.03.2027	183.870	(221)	0,00
Erhalt ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	15.03.2033	96.410	290	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIE	4,870	07.07.2025	MXN 393.200	(2.123)	(0,02)
					\$ (304.917)	(2,67)
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					\$ (321.630)	(2,82)

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

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

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

⁽⁴⁾ Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

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

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

OPTIONSKAUF

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
BOA	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,180 %	11.01.2024	49.700	\$ 1.420	\$ 5.267	0,05

OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
BPS	Put - OTC France Government International Bond 0,750 % fällig am 25.05.2052	€ 97,000	23.05.2025	26.800	\$ 2.027	\$ 10.947	0,09

VERKAUFSOPTIONEN

CREDIT DEFAULT SWAPPTIONS AUF KREDITINDIZES

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/ -verkauf	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
GST	Put - OTC iTraxx Europe 37 5-Year Index	Verkauf	3,000 %	15.03.2023	26.300	\$ (46)	\$ (5)	0,00

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
BOA	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,150 %	01.12.2023	31.200	\$ (97)	\$ (22)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	01.12.2023	31.200	(97)	(236)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,310	11.01.2024	441.600	(1.425)	(7.299)	(0,07)
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,000	19.01.2023	9.300	(40)	(4)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,500	19.01.2023	9.300	(40)	(113)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,550	11.04.2023	47.000	(47)	0	0,00
BPS	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,100	11.04.2023	47.000	(143)	(731)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,700	28.04.2023	32.900	(57)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,250	28.04.2023	32.900	(57)	(467)	(0,01)
	Put - OTC 25-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,451	23.05.2025	26.800	(2.027)	(10.239)	(0,09)
	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,150	09.01.2023	19.200	(68)	0	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	09.01.2023	19.200	(68)	(116)	0,00
	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,270	23.01.2023	7.000	(18)	(4)	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,770	23.01.2023	7.000	(18)	(36)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,000	19.01.2023	5.500	(23)	(2)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,500	19.01.2023	5.500	(23)	(67)	0,00
BRC	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,200	12.01.2023	8.300	(26)	(1)	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,800	12.01.2023	8.300	(26)	(28)	0,00

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nennbetrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
CBK	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,690 %	02.04.2024	33.700	\$ (265)	\$ (100)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,690	02.04.2024	33.700	(265)	(423)	(0,01)
	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,150	09.01.2023	12.500	(44)	0	0,00
DUB	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	09.01.2023	12.500	(44)	(75)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,920	13.10.2023	19.700	(119)	(20)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,920	13.10.2023	19.700	(119)	(270)	0,00
FAR	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,790	08.04.2024	39.000	(300)	(127)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,790	08.04.2024	39.000	(300)	(459)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,688	02.04.2024	14.400	(113)	(43)	0,00
GLM	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,688	02.04.2024	14.400	(113)	(181)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,920	13.10.2023	12.100	(74)	(12)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,920	13.10.2023	12.100	(74)	(166)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,018	20.10.2023	13.000	(84)	(16)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,018	20.10.2023	13.000	(84)	(166)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,140	23.10.2023	14.200	(100)	(20)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,140	23.10.2023	14.200	(100)	(168)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,190	23.10.2023	13.700	(95)	(21)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,190	23.10.2023	13.700	(95)	(156)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,225	23.10.2023	14.200	(98)	(22)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,225	23.10.2023	14.200	(98)	(158)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,973	25.10.2023	17.400	(120)	(21)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,973	25.10.2023	17.400	(120)	(228)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,841	27.10.2023	14.900	(102)	(16)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,841	27.10.2023	14.900	(102)	(209)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,088	03.11.2023	10.800	(78)	(16)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,088	03.11.2023	10.800	(78)	(129)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,910	10.11.2023	25.900	(172)	(35)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,910	10.11.2023	25.900	(172)	(341)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,250	17.11.2023	38.900	(141)	(27)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	17.11.2023	38.900	(141)	(278)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,150	20.11.2023	24.600	(86)	(15)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	20.11.2023	24.600	(86)	(191)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,250	07.12.2023	22.800	(71)	(19)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	07.12.2023	22.800	(71)	(158)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,697	02.04.2024	6.300	(49)	(19)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,697	02.04.2024	6.300	(49)	(79)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,721	08.04.2024	15.300	(115)	(47)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,721	08.04.2024	15.300	(115)	(187)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,550	05.04.2023	103.300	(192)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,100	05.04.2023	103.300	(192)	(1.595)	(0,02)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,550	11.04.2023	171.700	(334)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,100	11.04.2023	171.700	(334)	(2.669)	(0,02)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,700	24.04.2023	32.200	(35)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,250	24.04.2023	32.200	(91)	(454)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,700	26.04.2023	38.500	(68)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,250	26.04.2023	38.500	(68)	(545)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,550	15.05.2023	55.200	(97)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,100	15.05.2023	55.200	(97)	(876)	(0,01)
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,067	09.06.2023	26.900	(315)	(69)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	3,140	09.06.2023	26.900	(372)	(880)	(0,01)
	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,230	23.01.2023	26.200	(65)	(13)	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,730	23.01.2023	26.200	(65)	(156)	0,00
JPM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Erhalt	0,820	16.12.2024	123.600	(873)	(187)	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,200	12.01.2023	16.400	(51)	(2)	0,00
	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,800	12.01.2023	16.400	(51)	(55)	0,00
MYC	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,993	11.10.2023	9.500	(64)	(13)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,993	11.10.2023	9.500	(64)	(129)	0,00
							\$ (12.181)	\$ (31.626)	(0,28)

⁽¹⁾ Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZKAUF⁽¹⁾

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nennbetrag ⁽³⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BPS	South Korea Government International Bond	(1,000) %	20.06.2023	\$ 22.300	\$ (544)	\$ 465	\$ (79)	0,00
BRC	China Government International Bond	(1,000)	20.06.2023	37.000	(706)	567	(139)	0,00
	South Korea Government International Bond	(1,000)	20.06.2023	48.550	(1.225)	1.054	(171)	(0,01)
GST	China Government International Bond	(1,000)	20.06.2023	10.700	(207)	167	(40)	0,00
HUS	South Korea Government International Bond	(1,000)	20.06.2023	34.100	(851)	731	(120)	0,00
JPM	South Korea Government International Bond	(1,000)	20.06.2023	11.200	(268)	229	(39)	0,00
					\$ (3.801)	\$ 3.213	\$ (588)	(0,01)

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽²⁾

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nennbetrag ⁽³⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Italy Government International Bond	1,000 %	20.06.2025	\$ 11.810	\$ (285)	\$ 342	\$ 57	0,00
BRC	Italy Government International Bond	1,000	20.06.2025	17.350	(421)	505	84	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen Global Bond Fund (Forts.)

Kontrahent	Referenzzeit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽³⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
CBK	Italy Government International Bond	1,000 %	20.06.2025	\$ 4.020	\$ (97)	\$ 116	\$ 19	0,00
FBF	Italy Government International Bond	1,000	20.06.2025	8.200	(200)	240	40	0,00
GST	Abu Dhabi Government International Bond	1,000	20.12.2026	7.400	217	(42)	175	0,00
					\$ (786)	\$ 1.161	\$ 375	0,00

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

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

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

CROSS-CURRENCY SWAPS

Kontrahent	Erhalt	Zahlung	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag erhaltener Währung	Nennbetrag gelieferter Währung	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
AZD	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month AUD-LIBOR zzgl. 0,290 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	04.01.2031	AUD 106.300	\$ 80.086	\$ 526	\$ (307)	\$ 219	0,00
CBK	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month AUD-LIBOR zzgl. 0,420 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	31.07.2029	105.500	72.795	(26)	142	116	0,00
GLM	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month AUD-LIBOR zzgl. 0,423 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	01.08.2029	101.200	69.828	(205)	144	(61)	0,00
MYC	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month AUD-LIBOR zzgl. 0,298 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	14.10.2030	65.900	47.343	287	(180)	107	0,00
						\$ 582	\$ (201)	\$ 381	0,00

ZINSSWAPS

Kontrahent	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Erhalt/Erhalt variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,250 %	16.03.2032	MYR 34.402	\$ 76	\$ 395	\$ 471	0,00
	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,500	16.03.2032	1.100	0	10	10	0,00
	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	4,000	21.09.2027	317.504	366	(1.202)	(836)	(0,01)
	Erhalt	3-Month THB-THORON Compounded-OIS	2,000	21.09.2024	THB 2.127.400	(91)	(18)	(109)	0,00
	Erhalt	3-Month THB-THORON Compounded-OIS	2,250	21.12.2027	1.831.500	(265)	173	(92)	0,00
	Zahlung	6-Month THB-THBFX	2,000	16.03.2032	196.200	29	(255)	(226)	0,00
	Zahlung	6-Month THB-THBFX	2,000	15.06.2032	634.000	(72)	(762)	(834)	(0,01)
	Zahlung	6-Month THB-THBFX	2,750	15.06.2032	164.740	(57)	150	93	0,00
	Zahlung	6-Month THB-THBFX	2,750	21.09.2032	646.700	(17)	513	496	0,01
	Zahlung	6-Month THB-THBFX	3,250	15.06.2032	218.700	33	364	397	0,00
BPS	Zahlung	6-Month THB-THBFX	2,000	15.06.2032	10.000	(3)	(10)	(13)	0,00
	Zahlung	6-Month THB-THBFX	3,250	15.06.2032	12.700	2	21	23	0,00
CBK	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,500	16.03.2032	MYR 11.200	(19)	119	100	0,00
	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,750	21.09.2032	150.400	(124)	854	730	0,01
GLM	Zahlung	6-Month THB-THBFX	2,000	15.06.2032	THB 318.300	(19)	(400)	(419)	0,00
	Zahlung	6-Month THB-THBFX	3,250	15.06.2032	128.500	23	209	232	0,00
GST	Erhalt	3-Month THB-THORON Compounded-OIS	2,000	21.09.2024	8.147.650	(858)	441	(417)	0,00
	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,500	21.09.2027	MYR 93.900	72	168	240	0,00
JPM	Zahlung	6-Month THB-THBFX	2,000	15.06.2032	THB 637.000	(69)	(770)	(839)	(0,01)
	Zahlung	6-Month THB-THBFX	2,000	15.06.2032	176.300	(47)	(185)	(232)	0,00
MBC	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,500	21.09.2027	MYR 73.400	55	133	188	0,00
	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,500	16.03.2032	29.600	(92)	357	265	0,00
SCX	Erhalt	3-Month THB-THORON Compounded-OIS	1,750	21.09.2024	THB 1.457.000	69	40	109	0,00

Kontrahent	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
	Erhalt	3-Month THB-THORON Compounded-OIS	2,000 %	21.09.2024	THB 9.165.197	\$ 421	\$ (890)	\$ (469)	0,00
	Erhalt	3-Month THB-THORON Compounded-OIS	2,000	21.09.2027	68.911	3	15	18	0,00
	Erhalt	3-Month THB-THORON Compounded-OIS	2,250	21.09.2027	2.142.700	(381)	250	(131)	0,00
						\$ (965)	\$ (280)	\$ (1.245)	(0,01)

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	01.2023	NZD 208.769	\$ 130.258	\$ 0	\$ (1.787)	\$ (1.787)	(0,02)
BOA	01.2023	£ 2.556	3.090	15	0	15	0,00
	01.2023	HUF 1.106.517	2.825	0	(124)	(124)	0,00
	01.2023	¥ 47.435.610	332.135	0	(27.668)	(27.668)	(0,24)
	01.2023	PEN 7.634	1.985	0	(14)	(14)	0,00
	01.2023	RON 121	24	0	(2)	(2)	0,00
	01.2023	\$ 6.724	CHF 6.354	149	0	149	0,00
	01.2023	5.723	DKK 39.935	11	0	11	0,00
	01.2023	7.262	€ 7.233	458	0	458	0,00
	01.2023	21.437	£ 17.789	0	(35)	(35)	0,00
	01.2023	339	THB 11.769	1	0	1	0,00
	02.2023	¥ 48.890.000	\$ 334.548	0	(37.901)	(37.901)	(0,33)
	02.2023	\$ 1.985	PEN 7.657	13	0	13	0,00
	02.2023	ZAR 7.525	\$ 420	0	(21)	(21)	0,00
	03.2023	MYR 461.740	102.302	0	(3.672)	(3.672)	(0,03)
	03.2023	\$ 8.884	ZAR 156.865	282	0	282	0,00
BPS	05.2023	CNH 208.936	\$ 32.298	1.787	0	1.787	0,02
	01.2023	£ 6.779	7.784	0	(371)	(371)	0,00
	01.2023	HUF 6.203.065	16.229	0	(303)	(303)	0,00
	01.2023	ILS 83.155	24.259	679	0	679	0,01
	01.2023	NZD 1.837	1.169	7	0	7	0,00
	01.2023	SGD 1.889	1.401	0	(8)	(8)	0,00
	01.2023	THB 569	16	0	0	0	0,00
	01.2023	TWD 135.140	4.415	9	0	9	0,00
	01.2023	\$ 3.427	BRL 18.343	47	0	47	0,00
	02.2023	IDR 309.927	\$ 20	0	0	0	0,00
	02.2023	ILS 60.216	18.238	1.148	0	1.148	0,01
	03.2023	CNH 57.650	8.930	552	0	552	0,00
	03.2023	MYR 1.534	328	0	(24)	(24)	0,00
	03.2023	PEN 24.024	6.179	0	(79)	(79)	0,00
	03.2023	TWD 117.026	3.880	44	0	44	0,00
	03.2023	\$ 335	MXN 6.740	6	0	6	0,00
	03.2023	38.694	MYR 170.925	535	0	535	0,00
	03.2023	ZAR 156.865	\$ 8.622	0	(544)	(544)	(0,01)
BRC	07.2023	ILS 8.989	2.820	243	0	243	0,00
	01.2023	CNH 27.269	3.911	0	(35)	(35)	0,00
	01.2023	£ 7.442	8.962	9	0	9	0,00
	01.2023	HUF 5.600.129	14.605	0	(320)	(320)	0,00
	01.2023	PEN 12.768	3.206	0	(135)	(135)	0,00
	01.2023	SEK 24.424	2.332	0	(13)	(13)	0,00
	01.2023	SGD 1.789	1.327	0	(8)	(8)	0,00
	01.2023	\$ 319	CZK 7.476	11	0	11	0,00
	01.2023	2.560	£ 2.110	0	(21)	(21)	0,00
	01.2023	35.628	MYR 167.502	2.686	0	2.686	0,02
	01.2023	90.920	NOK 904.706	943	0	943	0,01
	01.2023	973	THB 33.580	0	(2)	(2)	0,00
	02.2023	TWD 1.234.069	\$ 40.147	0	(200)	(200)	0,00
CBK	03.2023	¥ 10.290.000	76.609	0	(2.167)	(2.167)	(0,02)
	01.2023	AUD 26.342	17.855	36	(49)	(13)	0,00
	01.2023	CAD 4.511	3.334	4	0	4	0,00
	01.2023	CLP 2.481.643	2.604	0	(30)	(306)	0,00
	01.2023	DKK 47.180	6.690	0	(84)	(84)	0,00
	01.2023	NZD 2.180	1.389	10	0	10	0,00
	01.2023	PEN 16.726	4.165	0	(212)	(212)	0,00
	01.2023	SEK 1.830	176	0	0	0	0,00
	01.2023	THB 769.963	22.266	3	0	3	0,00
	01.2023	\$ 37.197	AUD 54.975	133	(40)	93	0,00
	01.2023	48.949	CHF 46.235	1.056	0	1.056	0,01
	01.2023	7.120	CLP 6.247.674	205	0	205	0,00
	01.2023	8.446	DKK 58.810	0	(2)	(2)	0,00
	01.2023	11.890	€ 11.216	85	0	85	0,00
	01.2023	42.554	¥ 5.659.400	367	0	367	0,00
	01.2023	16	KRW 21.275	1	0	1	0,00
	01.2023	9.674	NOK 95.889	62	0	62	0,00
	01.2023	42.088	NZD 65.849	0	(439)	(439)	0,00
	01.2023	7.799	THB 270.689	28	0	28	0,00
	02.2023	CLP 2.496.154	\$ 2.791	0	(123)	(123)	0,00
	02.2023	COP 20.000.000	4.118	37	0	37	0,00
	02.2023	ILS 450.207	134.564	6.786	0	6.786	0,06
	02.2023	PEN 185.581	46.258	0	(2.239)	(2.239)	(0,02)

Aufstellung der Wertpapieranlagen Global Bond Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
	02.2023	TWD	632	\$	21	\$	0	0,00
	02.2023	\$	18.915	BRL	102.084		314	0,00
	03.2023	MXN	471.348	\$	23.457		(425)	0,00
	03.2023	\$	6.031	MXN	118.410		(42)	0,00
	04.2023	CLP	3.822.121	\$	4.329		(86)	0,00
	04.2023	ILS	65.101		19.947		1.398	0,01
	05.2023	CNH	17.100		2.644		147	0,00
	05.2023	ILS	104.895		32.168		2.225	0,02
	05.2023	PEN	41.264		10.237		(476)	0,00
	05.2023	\$	84.424	CNH	596.562		2.657	0,02
	07.2023	ILS	9.431	\$	2.966		262	0,00
	11.2023		101.207		30.243		967	0,01
CLY	01.2023	HUF	4.036.207		10.319		(438)	0,00
DUB	01.2023	THB	116.595		3.379		8	0,00
	01.2023	TWD	510.539		16.671		25	0,00
	05.2023	CNH	6.227		963		54	0,00
GLM	01.2023	BRL	192.451		37.063		612	0,01
	01.2023	CLP	3.745.583		3.801		(589)	(0,01)
	01.2023	CNH	28.304		4.069		(27)	0,00
	01.2023	HUF	2.650.699		6.786		(278)	0,00
	01.2023	MYR	22.072		5.025		(24)	0,00
	01.2023	PEN	10.000		2.581		(36)	0,00
	01.2023	THB	261.000		7.488		(58)	0,00
	01.2023	\$	17.833	MYR	78.637		165	0,00
	01.2023		3.298	PEN	13.255		170	0,00
	01.2023		643	PLN	3.262		100	0,00
	01.2023	ZAR	7.687	\$	430		(21)	0,00
	02.2023	COP	108.663		24		2	0,00
	02.2023	\$	36.836	BRL	192.451		(584)	(0,01)
	03.2023	CNH	123.686	\$	19.153		1.179	0,01
	03.2023	MXN	462		23		0	0,00
	03.2023	\$	9.730	CLP	8.864.315		578	0,01
	03.2023		15.184	MXN	312.136		614	0,01
IND	05.2023	CNH	330.343	\$	51.075		2.835	0,02
JPM	01.2023	\$	32.856	BRL	174.108		120	0,00
	01.2023		857	CNY	5.968		7	0,00
	01.2023		1.592	NZD	2.485		(20)	0,00
	01.2023		6.080	THB	210.822		16	0,00
	02.2023	IDR	535.360	\$	34		(1)	0,00
	02.2023	TWD	130.605		4.302		35	0,00
	03.2023	IDR	24.388.806		1.558		(18)	0,00
	03.2023	\$	35.436	CNH	251.872		1.166	0,01
	03.2023		1.540	CNY	10.653		9	0,00
	03.2023		445	MXN	8.850		2	0,00
	04.2023	ILS	109.354	\$	32.969		1.812	0,02
	05.2023	\$	44.851	CNH	316.296		1.337	0,01
MBC	01.2023	AUD	19.197	\$	12.904		(131)	0,00
	01.2023	CAD	10.184		7.592		75	0,00
	01.2023	CHF	381		412		0	0,00
	01.2023	DKK	911.644		128.777		(2.120)	(0,02)
	01.2023	€	123.612		130.385		(1.597)	(0,01)
	01.2023	£	33.217		40.498		535	0,00
	01.2023	¥	10.035.390		73.122		(2.993)	(0,03)
	01.2023	NZD	1.441		910		(2)	0,00
	01.2023	PEN	3.232		845		(1)	0,00
	01.2023	\$	8.533	AUD	12.668		60	0,00
	01.2023		4.612	CAD	6.229		(27)	0,00
	01.2023		12.596	€	11.827		32	0,00
	01.2023		1.926	£	1.574		(33)	0,00
	01.2023		120.433	¥	16.062.200		1.383	0,01
	01.2023		1.526	NOK	14.910		(12)	0,00
	01.2023		1.061	NZD	1.669		(5)	0,00
	01.2023		3.380	PEN	13.625		185	0,00
	01.2023		11.400	THB	395.000		22	0,00
	02.2023	\$	67.460.000	\$	476.577		(37.521)	(0,33)
	02.2023	\$	2.563	MXN	52.732		127	0,00
	02.2023		844	PEN	3.232		1	0,00
	03.2023	IDR	14.802.750	\$	946		(11)	0,00
	05.2023	CNH	350.028		52.157		1.077	0,01
MYI	01.2023	AUD	177.153		118.967		(1.199)	(0,01)
	01.2023	€	2.322		2.478		0	0,00
	01.2023	£	92		111		0	0,00
	01.2023	¥	41.314.724		301.356		(11.978)	(0,10)
	01.2023	MYR	46.246		10.478		(100)	0,00
	01.2023	NOK	4		0		0	0,00
	01.2023	SEK	2		0		0	0,00
	01.2023	SGD	52.723		39.138		(172)	0,00
	01.2023	THB	9.218		267		0	0,00
	01.2023	\$	80	CHF	74		0	0,00
	01.2023		195	€	184		1	0,00
	01.2023		6.151	£	5.011		(123)	0,00
	01.2023		1	HKD	5		0	0,00
	01.2023		8.169	MYR	38.662		675	0,01

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
	02.2023	TWD 241.461	\$ 7.920	\$ 32	\$ 0	\$ 32	0,00
	03.2023	IDR 20.856.822	1.330	0	(18)	(18)	0,00
RBC	01.2023	AUD 2.040	1.368	0	(16)	(16)	0,00
	01.2023	CAD 4.660	3.424	0	(16)	(16)	0,00
	01.2023	SGD 1.651	1.222	0	(9)	(9)	0,00
	01.2023	\$ 1.105	CAD 1.483	0	(11)	(11)	0,00
	01.2023	1.223	SGD 1.657	13	0	13	0,00
	03.2023	33	MXN 654	0	0	0	0,00
	04.2023	MXN 154.230	\$ 7.440	0	(321)	(321)	0,00
RYL	01.2023	SGD 735	544	0	(4)	(4)	0,00
	01.2023	\$ 2.149	HUF 809.813	3	0	3	0,00
SCX	01.2023	CAD 9.199	\$ 6.847	58	0	58	0,00
	01.2023	CHF 1.019	1.100	0	(2)	(2)	0,00
	01.2023	CLP 1.809.844	1.819	0	(301)	(301)	0,00
	01.2023	€ 2.251.559	2.343.535	0	(60.469)	(60.469)	(0,52)
	01.2023	¥ 481.800	£ 3.582	0	(72)	(72)	0,00
	01.2023	KRW 143.217.576	108.382	0	(5.455)	(5.455)	(0,05)
	01.2023	TWD 1.397.721	44.436	0	(1.101)	(1.101)	(0,01)
	01.2023	\$ 5.277	€ 5.000	61	0	61	0,00
	01.2023	2.579	£ 2.083	0	(73)	(73)	0,00
	01.2023	10.471	MYR 46.246	107	0	107	0,00
	01.2023	5.209	PEN 20.141	63	0	63	0,00
	01.2023	4.149	THB 144.119	18	0	18	0,00
	02.2023	IDR 563.327	\$ 36	0	(1)	(1)	0,00
	02.2023	\$ 514	TWD 15.822	3	0	3	0,00
	03.2023	CNH 70.401	\$ 10.906	675	0	675	0,01
	03.2023	MYR 322.260	69.865	0	(4.097)	(4.097)	(0,04)
	03.2023	TWD 103.032	3.423	46	0	46	0,00
SOG	01.2023	RON 1.227	241	0	(23)	(23)	0,00
	01.2023	SGD 542	399	0	(5)	(5)	0,00
	01.2023	\$ 2.445	SGD 3.308	23	0	23	0,00
SSB	01.2023	30.214	MYR 142.034	2.274	0	2.274	0,02
TOR	01.2023	AUD 9.756	\$ 6.585	0	(33)	(33)	0,00
	01.2023	CAD 23.385	17.396	136	0	136	0,00
	01.2023	£ 763.414	917.843	0	(613)	(613)	(0,01)
	01.2023	¥ 16.200.000	111.394	0	(11.676)	(11.676)	(0,10)
	01.2023	NZD 614	396	8	0	8	0,00
	01.2023	\$ 61.281	¥ 8.079.500	0	(5)	(5)	0,00
UAG	01.2023	CZK 51.685	\$ 2.032	0	(250)	(250)	0,00
	01.2023	DKK 1.012.490	141.721	0	(3.656)	(3.656)	(0,03)
	01.2023	HUF 12.340.756	31.576	0	(1.308)	(1.308)	(0,01)
	01.2023	TWD 290.915	9.505	20	0	20	0,00
	01.2023	\$ 294	CAD 400	1	0	1	0,00
	02.2023	IDR 835.992	\$ 53	0	(1)	(1)	0,00
	02.2023	ILS 102.811	29.994	814	0	814	0,01
	02.2023	¥ 23.470.000	166.992	0	(12.002)	(12.002)	(0,11)
	02.2023	TWD 228.455	7.426	0	(37)	(37)	0,00
				\$ 45.828	\$ (241.682)	\$ (195.854)	(1,70)

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 31. Dezember 2022 standen fur die Anteilsklasse Institutional CAD (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
BOA	01.2023	\$ 13.532	CAD 18.297	\$ 0	\$ (28)	\$ (28)	0,00
CBK	01.2023	\$ 12.544	CAD 16.951	0	(33)	(33)	0,00
MBC	01.2023	CAD 67	\$ 49	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 14.657	CAD 19.836	0	(17)	(17)	0,00
MYI	01.2023	CAD 317	\$ 234	0	0	0	0,00
				\$ 0	\$ (78)	\$ (78)	0,00

Zum 31. Dezember 2022 standen fur die Anteilsklassen Institutional CHF (Hedged) thesaurierend, Institutional CHF (Hedged) ausschuttend, Investor CHF (Hedged) thesaurierend, Class E CHF (Hedged) thesaurierend, Class W CHF (Hedged) thesaurierend und Class W CHF (Hedged) ausschuttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
BOA	01.2023	\$ 316.831	CHF 299.621	\$ 7.222	\$ 0	\$ 7.222	0,07
BRC	01.2023	CHF 131	\$ 141	0	(1)	(1)	0,00
	01.2023	\$ 64	CHF 59	0	0	0	0,00
CBK	01.2023	CHF 226	\$ 241	0	(3)	(3)	0,00
	01.2023	\$ 528.800	CHF 499.623	11.564	0	11.564	0,10
MBC	01.2023	CHF 1.117	\$ 1.209	3	(1)	2	0,00
	01.2023	\$ 428	CHF 395	0	(1)	(1)	0,00
MYI	01.2023	CHF 304	\$ 325	0	(4)	(4)	0,00
	01.2023	\$ 126	CHF 118	1	0	1	0,00
SCX	01.2023	CHF 1.180	\$ 1.275	0	(1)	(1)	0,00
UAG	01.2023	\$ 88	CHF 81	0	0	0	0,00
				\$ 18.790	\$ (11)	\$ 18.779	0,17

Aufstellung der Wertpapieranlagen Global Bond Fund (Forts.)

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Currency Exposure) thesaurierend, Institutional GBP (Currency Exposure) thesaurierend, Institutional USD (Currency Exposure) thesaurierend, Institutional USD (Currency Exposure) ausschüttend, Investor USD (Currency Exposure) thesaurierend, Class E USD (Currency Exposure) thesaurierend und Class E USD (Currency Exposure) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens			
BOA	01.2023	€	5.664	\$	5.973	\$	0	0,00		
	01.2023	¥	144.227		1.055		0	0,00		
	01.2023	\$	343	CHF	325		8	0,00		
	01.2023		769	IDR	11.980.923		6	0,00		
	01.2023		927	¥	122.272		0	0,00		
	01.2023		1.522	MXN	29.822		8	0,00		
	01.2023		1.106	SGD	1.518		26	0,00		
BPS	01.2023	CNY	30.303	\$	4.352		0	(35)	0,00	
	01.2023	KRW	433.876		330		0	(15)	0,00	
	01.2023	\$	673	CNY	4.690		6	0,00		
	01.2023		7.201	€	6.754		11	0,00		
	01.2023		9.957	£	8.259		0	(21)	0,00	
BRC	01.2023		81	SGD	111		2	0,00		
	01.2023	CNY	17.982	\$	2.592		0	(11)	0,00	
	01.2023	MYR	2.829		641		0	(1)	0,00	
	01.2023	\$	22.131	CNY	154.730		268	0,00		
	01.2023		1.025	£	852		0	0,00		
CBK	01.2023		641	MYR	2.829		2	0,00		
	01.2023		551	NOK	5.480		6	0,00		
	01.2023		2.299	SEK	24.075		13	0,00		
	01.2023	AUD	623	\$	420		0	(3)	0,00	
	01.2023	COP	2.356.671		494		8	0,00		
	01.2023	€	385		406		0	(4)	0,00	
	01.2023	MXN	44.770		2.302		5	0,00		
	01.2023	TWD	4.044		132		0	0,00		
	01.2023	\$	4.056	AUD	6.017		25	0,00		
	01.2023		6.707	CAD	9.076		0	(9)	0,00	
GLM	01.2023		2.857	CHF	2.698		62	0,00		
	01.2023		2.128	CNY	14.818		17	0,00		
	01.2023		54.467	€	51.241		243	0,00		
	01.2023		2.686	IDR	42.290.510		54	0,00		
	01.2023		1.022	¥	139.309		34	0,00		
	01.2023		53	SEK	550		0	0,00		
	02.2023		492	COP	2.356.671		0	(8)	0,00	
	02.2023		2.290	MXN	44.770		0	(5)	0,00	
	01.2023	MYR	12.836	\$	2.906		0	(8)	0,00	
	01.2023	\$	472	COP	2.356.671		14	0,00		
	01.2023		454	CZK	10.681		17	0,00		
	01.2023		2.771	MYR	12.836		143	0,00		
	01.2023		1.143	PLN	5.197		41	0,00		
	02.2023		280	CLP	241.516		3	0,00		
	02.2023		2.910	MYR	12.836		29	0,00		
JPM	01.2023		27.191	£	22.518		0	(100)	0,00	
MBC	01.2023	CAD	2.235	\$	1.637		0	(12)	0,00	
	01.2023	€	9.401		9.929		0	(108)	0,00	
	01.2023	£	1.308		1.596		22	0,00		
	01.2023	¥	1.189.595		8.727		0	(295)	0,00	
	01.2023	\$	270	AUD	402		3	0,00		
	01.2023		560	CAD	751		0	(6)	0,00	
	01.2023		2	CZK	50		0	0,00		
	01.2023		1.594	DKK	11.336		34	0,00		
	01.2023		149.978	€	143.066		2.775	0,03		
	01.2023		1.424	£	1.168		0	(18)	0,00	
	01.2023		874	ILS	2.990		0	(26)	0,00	
	01.2023		48.603	¥	6.513.843		798	0,01		
	01.2023		60	NOK	585		0	0,00		
	01.2023		408	NZD	647		1	0,00		
	02.2023		291	PEN	1.112		0	0,00		
MYI	01.2023	£	1.033	\$	1.259		16	0,00		
RBC	01.2023	\$	8.569	AUD	12.760		86	0,00		
	01.2023		68.920	¥	9.448.766		2.740	0,02		
	01.2023	AUD	604	\$	404		0	(6)	0,00	
	01.2023	\$	99	AUD	147		1	0,00		
	01.2023		684	CAD	930		2	0,00		
	01.2023		313	¥	41.868		4	0,00		
	RYL	01.2023		576	AUD	856		4	0,00	
	SCX	01.2023		5.259	CAD	7.065		0	(44)	0,00
		01.2023		926	CHF	860		4	0,00	
		01.2023		59.837	CNY	426.733		1.939	0,02	
01.2023			2.665	KRW	3.431.775		62	0,00		
01.2023			881	NZD	1.414		14	0,00		
SOG	01.2023		7.448	KRW	9.873.510		399	0,00		
TOR	01.2023		13.361	CAD	17.960		0	(105)	0,00	
UAG	01.2023	KRW	22.789	\$	17		0	(1)	0,00	
	01.2023	\$	482	CZK	10.949		2	0,00		
	01.2023		259	HUF	102.338		14	0,00		
	01.2023		2	IDR	32.686		0	0,00		
	01.2023		767	MXN	14.948		0	(1)	0,00	
01.2023		860	SEK	8.985		3	0,00			

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
	01.2023	\$ 531	SGD 716	\$ 3	\$ 0	\$ 3	0,00
	01.2023	1.988	THB 69.976	34	0	34	0,00
				\$ 10.011	\$ (955)	\$ 9.056	0,08

Zum 31. Dezember 2022 standen fur die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschuttend, Investor EUR (Hedged) thesaurierend, Class E EUR (Hedged) thesaurierend, Class E EUR (Hedged) ausschuttend, G Retail EUR (Hedged) ausschuttend, Class R EUR (Hedged) thesaurierend, Class T EUR (Hedged) thesaurierend, Class W EUR (Hedged) thesaurierend und Class W EUR (Hedged) ausschuttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
BOA	01.2023	\$ 5.762	€ 5.463	\$ 71	\$ 0	\$ 71	0,00
BPS	01.2023	5.922	€ 5.552	6	0	6	0,00
CBK	01.2023	€ 13.041	\$ 13.767	0	(157)	(157)	0,00
	01.2023	\$ 1.118.837	€ 1.078.571	32.759	0	32.759	0,29
JPM	01.2023	6.585	€ 6.333	176	0	176	0,00
MBC	01.2023	€ 8.342	\$ 8.865	0	(41)	(41)	0,00
	01.2023	\$ 1.258.804	€ 1.200.923	23.429	0	23.429	0,20
SCX	01.2023	1.181.712	1.135.334	30.490	0	30.490	0,27
				\$ 86.931	\$ (198)	\$ 86.733	0,76

Zum 31. Dezember 2022 standen fur die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend, Institutional GBP (Hedged) ausschuttend, Investor GBP (Hedged) thesaurierend, Class W GBP (Hedged) thesaurierend und Class W GBP (Hedged) ausschuttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
BOA	01.2023	£ 2.165	\$ 2.630	\$ 25	\$ 0	\$ 25	0,00
	01.2023	\$ 457	£ 377	0	(4)	(4)	0,00
BPS	01.2023	£ 49	\$ 59	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 384	£ 318	0	(2)	(2)	0,00
BRC	01.2023	£ 565	\$ 681	1	0	1	0,00
	01.2023	\$ 163	£ 135	0	0	0	0,00
JPM	01.2023	127.140	105.290	0	(467)	(467)	0,00
MBC	01.2023	£ 3.793	\$ 4.621	58	0	58	0,00
	01.2023	\$ 127.540	£ 106.339	518	(123)	395	0,00
MYI	01.2023	1.616	1.315	0	(34)	(34)	0,00
TOR	01.2023	126.740	105.416	85	0	85	0,00
UAG	01.2023	£ 597	\$ 734	16	0	16	0,00
				\$ 703	\$ (630)	\$ 73	0,00

Zum 31. Dezember 2022 standen fur die Anteilsklassen Institutional NOK (Hedged) thesaurierend, Investor NOK (Hedged) thesaurierend und Class E NOK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
BRC	01.2023	\$ 88.986	NOK 885.458	\$ 923	\$ 0	\$ 923	0,01
CBK	01.2023	NOK 159	\$ 16	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 98.363	NOK 974.976	634	0	634	0,01
MBC	01.2023	NOK 990	\$ 100	0	(1)	(1)	0,00
	01.2023	\$ 7.582	NOK 74.221	0	(46)	(46)	(0,01)
MYI	01.2023	2.960	29.739	60	0	60	0,00
RYL	01.2023	21	209	0	0	0	0,00
SCX	01.2023	NOK 2.122	\$ 218	3	0	3	0,00
	01.2023	\$ 98.364	NOK 976.035	741	0	741	0,01
TOR	01.2023	3.118	30.871	17	0	17	0,00
				\$ 2.378	\$ (47)	\$ 2.331	0,02

Zum 31. Dezember 2022 standen fur die Anteilsklasse Institutional NZD (Hedged) ausschuttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
AZD	01.2023	\$ 32.715	NZD 52.433	\$ 449	\$ 0	\$ 449	0,00
BPS	01.2023	20	31	0	0	0	0,00
CBK	01.2023	NZD 585	\$ 372	2	0	2	0,00
	01.2023	\$ 34.969	NZD 56.010	457	0	457	0,00
JPM	01.2023	NZD 551	\$ 353	4	0	4	0,00
	01.2023	\$ 1.159	NZD 1.830	0	(2)	(2)	0,00
MBC	01.2023	2.503	3.937	0	(13)	(13)	0,00
MYI	01.2023	22	35	0	0	0	0,00
SCX	01.2023	35.102	56.356	543	0	543	0,01
				\$ 1.455	\$ (15)	\$ 1.440	0,01

Aufstellung der Wertpapieranlagen Global Bond Fund (Forts.)

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional SEK (Hedged) thesaurierend und Administrative SEK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2023	SEK 330	\$ 32	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	01.2023	\$ 652	SEK 6.653	0	(13)	(13)	0,00
BRC	01.2023	35.967	376.690	199	0	199	0,00
CBK	01.2023	3.012	31.376	2	(1)	1	0,00
MBC	01.2023	SEK 60	\$ 6	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 331	SEK 3.431	1	(3)	(2)	0,00
MYI	01.2023	11.682	122.876	115	0	115	0,00
SCX	01.2023	245	2.525	0	(2)	(2)	0,00
UAG	01.2023	66.936	702.240	485	0	485	0,01
				\$ 802	\$ (19)	\$ 783	0,01

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilsklasse Institutional SGD (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	01.2023	\$ 51	SGD 69	\$ 1	\$ 0	\$ 1	0,00
BOA	01.2023	37.333	51.260	892	0	892	0,01
BPS	01.2023	41.315	56.642	924	0	924	0,01
BRC	01.2023	16.501	22.253	94	0	94	0,00
GLM	01.2023	SGD 937	\$ 686	0	(13)	(13)	(0,01)
	01.2023	\$ 2.580	SGD 3.526	50	0	50	0,00
MBC	01.2023	40.348	55.163	788	0	788	0,01
RBC	01.2023	70	95	0	0	0	0,00
RYL	01.2023	22.993	30.832	0	(1)	(1)	0,00
SCX	01.2023	112	152	1	0	1	0,00
UAG	01.2023	SGD 265	\$ 194	0	(4)	(4)	0,00
	01.2023	\$ 173	SGD 234	1	0	1	0,00
				\$ 2.751	\$ (18)	\$ 2.733	0,02

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ (90.498) (0,79)

LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖGENS
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN			
Ginnie Mae, TBA 4,000 % fällig am 01.01.2053	\$ 7.500	\$ (7.098)	(0,06)
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.01.2038	198.400	(176.485)	(1,55)
2,000 % fällig am 01.02.2038	1.000	(891)	(0,01)
2,000 % fällig am 01.01.2053	263.150	(214.186)	(1,88)
2,000 % fällig am 01.02.2053	396.000	(322.656)	(2,82)
Summe Leerverkaufte Wertpapiere		\$ (721.316)	(6,32)
Summe Anlagen		\$ 12.766.563	111,79
Sonstige Aktiva und Passiva		\$ (1.346.451)	(11,79)
Nettovermögen		\$ 11.420.112	100,00

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

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

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

- (a) Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.
- (b) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.
- (c) Nullkuponwertpapier.
- (d) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.
- (e) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.
- (f) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.
- (g) Mit dem Fonds verbunden.
- (h) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(i) Eingeschränkte Wertpapiere: (31. Dezember 2021: 0,41 %):

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeitsdatum	Kaufdatum	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
Citigroup, Inc.	3,290 %	17.03.2026	10.03.2022	\$ 33.100	\$ 31.491	0,28
Citigroup, Inc.	3,785	17.03.2033	11.03.2022	14.521	12.441	0,11
Deutsche Bank AG	3,729	14.01.2032	21.01.2021	2.005	1.470	0,01
Oracle Corp.	2,875	25.03.2031	08.11.2021	515	416	0,00
Oracle Corp.	3,950	25.03.2051	08.11.2021	109	72	0,00
				\$ 50.250	\$ 45.890	0,40

(j) Wertpapier mit einem Gesamtmarktwert von 1.610 USD (31. Dezember 2021: 1.160.107 USD) wurden gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen zum 31. Dezember 2022 als Sicherheiten verpfändet.

Barmittel in Höhe von 312.124 USD (31. Dezember 2021: 214.183 USD) wurden zum 31. Dezember 2022 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 142.980 USD (31. Dezember 2021: 50.920 USD) wurden zum 31. Dezember 2022 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 11.352.524	\$ 8.573	\$ 11.361.097
Investmentfonds	322.306	798.673	0	1.120.979
Pensionsgeschäfte	0	1.346.970	0	1.346.970
Finanzderivate ⁽³⁾	73.477	(414.644)	0	(341.167)
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(721.316)	0	(721.316)
Summen	\$ 395.783	\$ 12.362.207	\$ 8.573	\$ 12.766.563

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

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 15.285.257	\$ 4.396	\$ 15.289.653
Investmentfonds	1.197.100	0	0	1.197.100
Pensionsgeschäfte	0	3.378	0	3.378
Finanzderivate ⁽³⁾	31.388	(30.588)	0	800
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(1.368.631)	0	(1.368.631)
Summen	\$ 1.228.488	\$ 13.889.416	\$ 4.396	\$ 15.122.300

⁽¹⁾ Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

⁽²⁾ Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

⁽³⁾ Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kreditbetrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensionsgeschäften	% des Nettovermögens
FBF	0,750 %	21.12.2022	TBD ⁽¹⁾	€ (1.576)	\$ (1.682)	(0,01)
Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte					\$ (1.682)	(0,01)

⁽¹⁾ Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2021:

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2022			Zum 31. Dez. 2021		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement ⁽¹⁾	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement ⁽¹⁾
AZD	\$ (1.118)	\$ 1.920	\$ 802	\$ (55)	\$ 370	\$ 315
BOA	(61.601)	51.870	(9.731)	1.028	(1.820)	(792)
BPS	2.102	(1.850)	252	1.820	(1.950)	(130)
BRC	1.917	(1.260)	657	14.065	(8.810)	5.255
CBK	57.544	(56.500)	1.044	(8.733)	8.950	217
CIB	k. A.	k. A.	k. A.	101	(400)	(299)
CLY	(438)	0	(438)	k. A.	k. A.	k. A.
DUB	(789)	220	(569)	(2.755)	1.630	(1.125)
FAR	(224)	0	(224)	k. A.	k. A.	k. A.

Aufstellung der Wertpapieranlagen Global Bond Fund (Forts.)

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2022			Zum 31. Dez. 2021		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement ⁽¹⁾	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement ⁽¹⁾
FBF	\$ 40	\$ 0	\$ 40	\$ 91	\$ 0	\$ 91
GLM	(7.627)	6.700	(927)	(4.717)	6.480	1.763
GST	(287)	280	(7)	(169)	180	11
HUS	(120)	140	20	(1.480)	1.180	(300)
IND	2.835	(2.760)	75	(21)	0	(21)
JPM	3.194	(3.600)	(406)	(2.880)	350	(2.530)
MBC	(13.437)	11.460	(1.977)	k. A.	k. A.	k. A.
MYC	(35)	350	315	(1.019)	980	(39)
MYI	(9.902)	7.130	(2.772)	15.700	(15.810)	(110)
RBC	(363)	320	(43)	(25.881)	13.290	(12.591)
RYL	2	0	2	(9.305)	9.630	325
SAL	k. A.	k. A.	k. A.	(170)	0	(170)
SCX	(36.806)	34.940	(1.866)	23.520	(16.790)	6.730
SOG	394	(300)	94	k. A.	k. A.	k. A.
SSB	2.274	(1.930)	344	k. A.	k. A.	k. A.
TOR	(12.186)	12.810	624	15.709	(9.950)	5.759
UAG	(15.867)	14.840	(1.027)	(10.130)	7.260	(2.870)
WST	k. A.	k. A.	k. A.	(54)	0	(54)

⁽¹⁾ Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2022:

	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	67,82	83,24
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	30,98	24,75
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,69	0,92
Investmentfonds	9,82	8,53
Pensionsgeschäfte	11,79	0,02
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,62	0,27
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(2,82)	(0,29)
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,79)	0,03
Leerverkaufte Wertpapiere	(6,32)	(9,75)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(0,01)	(8,31)

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2022 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
Argentinien	k. A.	0,00
Australien	1,53	2,40
Österreich	0,07	0,08
Brasilien	0,00	0,02
Kanada	0,68	2,16
Cayman-Inseln	2,31	3,35
China	0,01	6,68
Tschechische Republik	0,00	0,00
Dänemark	2,36	3,91
Finnland	0,01	0,01
Frankreich	2,98	3,07
Deutschland	2,15	2,65
Hongkong	0,25	0,40
Ungarn	0,04	0,06
Indien	k. A.	0,10
Irland	5,70	4,63
Israel	0,46	1,47
Italien	1,23	2,46
Japan	6,06	14,06
Jersey, Kanalinseln	0,08	0,08
Kasachstan	k. A.	0,01
Kuwait	k. A.	0,29
Litauen	k. A.	0,07
Luxemburg	0,55	0,75
Malaysia	0,60	1,60
Mauritius	k. A.	0,04
Mexiko	0,12	0,12
Multinational	0,10	0,13
Niederlande	1,10	2,11
Neuseeland	0,21	0,20
Norwegen	0,27	0,14
Peru	0,52	1,07
Polen	0,03	k. A.
Portugal	0,01	0,01
Katar	0,13	0,66
Rumänien	0,51	0,44
Russland	k. A.	0,08
Saudi-Arabien	0,14	0,47
Serbien	0,22	0,27
Singapur	k. A.	0,97

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
Slowenien	0,19	0,38
Südafrika	0,00	0,08
Südkorea	0,98	0,95
Spanien	0,96	3,23
Supranational	0,20	0,11
Schweden	0,00	0,00
Schweiz	1,25	1,00
Thailand	0,29	k. A.
Vereinigte Arabische Emirate	0,07	0,35
Großbritannien	8,24	12,71
USA	39,76	31,58
Kurzfristige Instrumente	17,12	1,50
Investmentfonds	9,82	8,53
Pensionsgeschäfte	11,79	0,02
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,63	0,27
Verkaufsoptionen		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	(0,01)	k. A.
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	(0,03)	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	(0,13)	0,00
Zinsswaps — Basisswaps	0,01	0,00
Zinsswaps	(2,67)	(0,29)
Freiverkehrsfinauzderivate		
Optionskauf		
Zinsswapoptionen	0,05	0,01
Optionen auf Wertpapiere	0,09	0,03
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaptions auf Kreditindizes	0,00	0,00
Devisenoptionen	k. A.	(0,01)
Zinsswapoptionen	(0,28)	(0,17)
Zinsscaps	k. A.	0,00
Optionen auf Wertpapiere	k. A.	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen - Schutzkauf	(0,01)	(0,02)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,00	0,00
Cross-Currency Swaps	0,00	0,00
Zinsswaps	(0,01)	0,01
Total Return Swaps auf Wertpapiere	k. A.	0,00
Devisenterminkontrakte	(1,70)	(0,38)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	1,07	0,56
Leerverkaufte Wertpapiere	(6,32)	(9,75)
Sonstige Aktiva und Passiva	(11,79)	(7,72)
Nettovermögen	100,00	100,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond ESG Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Ripon Mortgage PLC 4,011 % fällig am 28.08.2056	£ 15.587	\$ 18.402	0,59	BlueMountain Fuji EUR CLO DAC 2,098 % fällig am 15.01.2031	€ 1.999	\$ 2.076	0,07	Laurelin DAC 2,176 % fällig am 20.10.2031	€ 1.500	\$ 1.552	0,05
RMAC PLC 4,206 % fällig am 12.06.2046	783	938	0,03	2,288 % fällig am 15.01.2033	2.850	2.930	0,09	Long Beach Mortgage Loan Trust 4,989 % fällig am 25.01.2036	\$ 711	636	0,02
4,476 % fällig am 12.06.2046	423	507	0,02	BNPP AM Euro CLO DAC 2,322 % fällig am 22.07.2032	4.800	4.964	0,16	Madison Park Euro Funding DAC 2,128 % fällig am 15.01.2032	€ 3.200	3.307	0,11
RMAC Securities PLC 3,676 % fällig am 12.06.2044	36	40	0,00	Bridgepoint CLO DAC 2,588 % fällig am 15.01.2034	3.400	3.551	0,11	2,178 % fällig am 15.07.2032	5.200	5.378	0,17
Sequoia Mortgage Trust 3,194 % fällig am 20.07.2037	\$ 206	166	0,01	Cairn CLO BV 2,158 % fällig am 15.10.2031	1.300	1.358	0,04	Madison Park Funding Ltd. 0,000 % fällig am 29.07.2030	\$ 2.000	1.971	0,06
Stratton Mortgage Funding PLC 3,826 % fällig am 20.07.2060	€ 3.391	4.045	0,13	Cairn CLO DAC 2,688 % fällig am 20.10.2028	121	126	0,00	Man GLG Euro CLO DAC 2,188 % fällig am 15.10.2032	€ 5.197	5.366	0,17
4,287 % fällig am 12.03.2052	2.179	2.611	0,08	Carlyle Euro CLO DAC 2,078 % fällig am 15.01.2031	2.199	2.290	0,07	Marathon CLO Ltd. 5,545 % fällig am 21.11.2027	\$ 10	10	0,00
4,292 % fällig am 25.09.2051	2.846	3.379	0,11	2,688 % fällig am 15.08.2032	3.000	3.110	0,10	MASTR Asset-Backed Securities Trust 4,709 % fällig am 25.08.2036	12.561	4.496	0,14
Structured Asset Securities Corp. 4,669 % fällig am 25.01.2036	\$ 141	135	0,00	Carlyle Global Market Strategies CLO Ltd. 5,049 % fällig am 17.04.2031	\$ 3.290	3.246	0,10	Merrill Lynch Mortgage Investors Trust 4,629 % fällig am 25.02.2037	646	197	0,01
Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust 4,679 % fällig am 25.10.2036	297	260	0,01	Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd. 2,548 % fällig am 15.11.2031	€ 1.500	1.551	0,05	5,109 % fällig am 25.05.2036	252	248	0,01
TBW Mortgage-Backed Trust 5,965 % fällig am 25.07.2037	2.394	771	0,03	5,259 % fällig am 15.01.2030	\$ 3.650	3.605	0,12	Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust 4,459 % fällig am 25.10.2036	831	399	0,01
Towd Point Mortgage Funding PLC 3,826 % fällig am 20.07.2045	€ 1.209	1.439	0,05	Catamaran CLO Ltd. 5,425 % fällig am 16.11.2030	4.278	4.217	0,14	4,489 % fällig am 25.11.2036	6.033	3.012	0,10
4,071 % fällig am 20.10.2051	797	953	0,03	Cedar Funding CLO Ltd. 5,179 % fällig am 17.07.2031	4.400	4.327	0,14	4,639 % fällig am 25.07.2036	62	53	0,00
Towd Point Mortgage Trust 5,389 % fällig am 25.10.2059	\$ 4.310	4.268	0,14	CIFC Funding Ltd. 5,259 % fällig am 16.11.2030	4.700	4.656	0,15	4,989 % fällig am 25.12.2034	478	417	0,01
Tower Bridge Funding PLC 4,801 % fällig am 20.09.2063	€ 1.864	2.241	0,07	5,279 % fällig am 17.10.2031	3.200	3.161	0,10	5,064 % fällig am 25.09.2035	3.300	3.092	0,10
Trinidad Mortgage Securities PLC 3,900 % fällig am 24.01.2059	166	199	0,01	5,418 % fällig am 27.04.2031	2.300	2.272	0,07	5,349 % fällig am 25.09.2034	730	694	0,02
Trinity Square PLC 3,729 % fällig am 15.07.2059	1.944	2.312	0,07	CIT Mortgage Loan Trust 5,739 % fällig am 25.10.2037	919	915	0,03	Morgan Stanley Structured Trust 4,689 % fällig am 25.06.2037	2.900	2.614	0,08
Twin Bridges PLC 4,237 % fällig am 12.03.2055	3.008	3.539	0,11	Countrywide Asset-Backed Certificates Trust 4,529 % fällig am 25.07.2037	2.117	1.911	0,06	Neuberger Berman Loan Advisers CLO Ltd. 5,283 % fällig am 20.04.2031	2.500	2.459	0,08
Uropa Securities PLC 3,266 % fällig am 10.10.2040	278	304	0,01	4,609 % fällig am 25.09.2037 ^	194	199	0,01	New Century Home Equity Loan Trust 5,124 % fällig am 25.06.2035	88	88	0,00
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust 3,048 % fällig am 25.02.2046	\$ 267	235	0,01	4,619 % fällig am 25.04.2047	5.700	5.141	0,17	5,154 % fällig am 25.02.2035	2.567	2.456	0,08
3,266 % fällig am 25.02.2037 ^	2.769	2.451	0,08	4,639 % fällig am 25.02.2036	622	559	0,02	Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust 5,019 % fällig am 25.02.2036	4.400	3.978	0,13
3,565 % fällig am 25.09.2036	60	51	0,00	5,364 % fällig am 25.01.2036	2.211	2.133	0,07	NovaStar Mortgage Funding Trust 4,489 % fällig am 25.01.2037	2.517	897	0,03
3,813 % fällig am 25.10.2035	84	77	0,00	CVC Cordatus Loan Fund DAC 2,278 % fällig am 27.01.2031	€ 5.689	5.951	0,19	4,929 % fällig am 25.05.2036	1.700	1.584	0,05
4,124 % fällig am 25.09.2033	43	40	0,00	Dryden Euro CLO DAC 2,622 % fällig am 15.05.2034	1.250	1.297	0,04	OCF CLO Ltd. 5,363 % fällig am 20.07.2029	2.908	2.882	0,09
Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust 4,839 % fällig am 25.04.2035	317	260	0,01	Encore Credit Receivables Trust 5,079 % fällig am 25.07.2035	\$ 519	504	0,02	OCF Euro CLO DAC 2,382 % fällig am 22.09.2034	€ 2.700	2.801	0,09
		121.939	3,93	Fremont Home Loan Trust 5,454 % fällig am 25.06.2035	148	141	0,00	Option One Mortgage Loan Trust 4,529 % fällig am 25.01.2037	\$ 262	175	0,01
				Gallatin CLO Ltd. 5,328 % fällig am 21.01.2028	301	299	0,01	4,529 % fällig am 25.03.2037	1.203	821	0,03
				Greenwood Park CLO Ltd. 5,089 % fällig am 15.04.2031	2.300	2.272	0,07	4,569 % fällig am 25.04.2037	3.068	1.481	0,05
FÖRDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				Griffith Park CLO DAC 2,522 % fällig am 21.11.2031	€ 1.000	1.033	0,03	OZLM Ltd. 5,089 % fällig am 17.07.2029	2.698	2.667	0,09
Accunia European CLO DAC 2,328 % fällig am 15.07.2030	€ 446	466	0,01	2,228 % fällig am 15.01.2032	4.700	4.860	0,16	5,665 % fällig am 30.10.2030	1.335	1.316	0,04
ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust 5,289 % fällig am 25.12.2034	\$ 109	97	0,00	2,433 % fällig am 18.11.2029	70	74	0,00	5,674 % fällig am 16.05.2030	3.677	3.622	0,12
5,289 % fällig am 25.08.2035	1.513	1.447	0,05	2,775 % fällig am 26.06.2030	3.088	3.223	0,10	Palmer Square CLO Ltd. 5,179 % fällig am 16.07.2031	3.500	3.456	0,11
Adagio CLO DAC 2,098 % fällig am 15.10.2031	€ 2.400	2.497	0,08	GSAMP Trust 4,889 % fällig am 25.05.2046	\$ 1.400	1.313	0,04	Palmer Square European Loan Funding DAC 2,098 % fällig am 15.10.2031	€ 5.672	5.870	0,19
Apidos CLO 5,253 % fällig am 20.04.2031	\$ 5.900	5.816	0,19	5,109 % fällig am 25.11.2035	4.500	3.574	0,12	2,108 % fällig am 15.07.2031	4.283	4.450	0,14
Aqueduct European CLO DAC 2,096 % fällig am 20.07.2030	€ 2.782	2.910	0,09	Harvest CLO DAC 2,018 % fällig am 15.10.2031	€ 3.200	3.320	0,11	Pepper SPARKZ Trust 4,062 % fällig am 17.08.2028	AU D 789	534	0,02
Ares European CLO DAC 2,158 % fällig am 15.10.2031	2.700	2.793	0,09	2,136 % fällig am 20.10.2031	1.200	1.244	0,04	Renaissance Home Equity Loan Trust 5,762 % fällig am 25.08.2036	\$ 708	285	0,01
2,306 % fällig am 20.04.2032	4.100	4.250	0,14	2,138 % fällig am 15.07.2031	3.300	3.401	0,11	Residential Asset Securities Corp. Trust 5,049 % fällig am 25.12.2035	4.997	4.746	0,15
Argent Securities Trust 4,749 % fällig am 25.04.2036	\$ 5.106	1.700	0,05	2,228 % fällig am 15.01.2032	4.700	4.860	0,16	Saxon Asset Securities Trust 1,799 % fällig am 25.05.2035	3.177	2.965	0,10
Atlas Senior Loan Fund Ltd. 5,229 % fällig am 16.01.2030	3.619	3.581	0,12	2,433 % fällig am 18.11.2029	70	74	0,00	Sculptor European CLO DAC 2,153 % fällig am 14.01.2032	€ 4.900	5.089	0,16
Aurium CLO DAC 2,108 % fällig am 16.01.2031	€ 4.798	5.008	0,16	2,775 % fällig am 26.06.2030	3.088	3.223	0,10	Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust 5,109 % fällig am 25.10.2035	\$ 5.600	4.877	0,16
Bain Capital Euro CLO DAC 2,196 % fällig am 20.01.2032	2.000	2.080	0,07	Home Equity Asset Trust 3,826 % fällig am 25.02.2036	\$ 883	850	0,03	Segovia European CLO DAC 2,336 % fällig am 20.07.2032	€ 2.700	2.790	0,09
Bayview Financial Asset Trust 5,889 % fällig am 25.03.2037	\$ 104	103	0,00	Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust 6,339 % fällig am 25.03.2035	270	209	0,01	Soundview Home Loan Trust 4,794 % fällig am 25.12.2036	\$ 1.500	1.450	0,05
Benefit Street Partners CLO Ltd. 5,343 % fällig am 20.01.2031	2.600	2.565	0,08	HSI Asset Securitization Corp. Trust 4,529 % fällig am 25.01.2037	1.534	1.207	0,04	4,889 % fällig am 25.11.2036	988	916	0,03
Black Diamond CLO DAC 2,778 % fällig am 15.05.2032	€ 4.700	4.863	0,16	IndyMac Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust 4,069 % fällig am 25.03.2035	2.070	1.971	0,06	Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust 4,914 % fällig am 25.07.2036	1.227	1.146	0,04
				Jubilee CLO DAC 2,846 % fällig am 15.12.2029	€ 623	652	0,02	Terwin Mortgage Trust 5,329 % fällig am 25.11.2033	5	4	0,00
				KKR CLO Ltd. 5,259 % fällig am 15.01.2031	\$ 3.000	2.954	0,10				

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond ESG Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
(0,151) % fällig am 23.01.2023 (a)(b)	¥ 1.483.000	\$ 11.241	0,36	U.S. TREASURY BILLS			
(0,149) % fällig am 30.01.2023 (a)(b)	741.100	5.617	0,18	4,386 % fällig am 30.03.2023 (a)(b)	\$ 2.200	\$ 2.178	0,07
(0,146) % fällig am 06.02.2023 (a)(b)	12.949.000	98.156	3,16	4,389 % fällig am 30.03.2023 (a)(b)	209.500	207.356	6,68
(0,142) % fällig am 06.03.2023 (a)(b)	3.677.000	27.876	0,90			209.534	6,75
(0,138) % fällig am 06.02.2023 (a)(b)	741.000	5.617	0,18	Summe kurzfristige Instrumente		1.100.517	35,42
(0,131) % fällig am 06.03.2023 (a)(b)	1.348.000	10.219	0,33	Summe Übertragbare Wertpapiere		\$ 2.913.880	93,79
(0,129) % fällig am 13.02.2023 (a)(b)	5.707.300	43.264	1,39				
(0,118) % fällig am 13.02.2023 (a)(b)	8.662.700	65.668	2,11	AKTIEN			
(0,117) % fällig am 20.02.2023 (a)(b)	740.000	5.610	0,18	INVESTMENTFONDS ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN			
(0,111) % fällig am 20.02.2023 (a)(b)	10.140.000	76.869	2,47	PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Global Investment Grade Credit ESG Fund (e)	580.000	5.649	0,18
		697.055	22,43	Summe Investmentfonds		\$ 5.649	0,18

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft ⁽¹⁾	% des Netto- vermögens
BPS	4,200 %	03.01.2023	04.01.2023	\$ 275.900	U.S. Treasury Notes 2,500 % fällig am 31.05.2024	\$ (281.796)	\$ 275.900	\$ 275.932	8,88
BRC	4,310	03.01.2023	04.01.2023	313.900	U.S. Treasury Bonds 3,750 % – 4,750 % fällig am 15.02.2041 – 15.08.2041	(320.650)	313.900	313.938	10,11
FICC	1,900	30.12.2022	03.01.2023	8.047	U.S. Treasury Notes 0,125 % fällig am 15.05.2023	(8.208)	8.047	8.048	0,26
	4,280	30.12.2022	03.01.2023	560.000	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,375 % fällig am 15.01.2027 U.S. Treasury Notes 0,250 % – 4,125 % fällig am 31.10.2025 – 30.09.2027	(36.147) (535.053)	560.000	560.266	18,03
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (1.181.854)	\$ 1.157.847	\$ 1.158.184	37,28

⁽¹⁾ Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
3-Month SOFR December Futures	Short	03.2024	3.030	\$ 1.239	0,04
3-Month SOFR June Futures	Long	09.2023	1.703	(1.020)	(0,03)
3-Month SOFR June Futures	Long	09.2024	1.515	(517)	(0,02)
Australia Government 3-Year Note March Futures	Short	03.2023	73	67	0,00
Australia Government 10-Year Bond March Futures	Long	03.2023	528	(2.322)	(0,07)
Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 146,000 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond February 2023 Futures ⁽¹⁾	Short	01.2023	32	26	0,00
Canada Government 10-Year Bond March Futures	Short	03.2023	102	162	0,01
Euro-Bobl March Futures	Short	03.2023	833	3.224	0,10
Euro-BTP Italy Government Bond March Futures	Short	03.2023	794	1.591	0,05
Euro-Bund 10-Year Bond March Futures	Short	03.2023	286	2.462	0,08
Euro-Buxl 30-Year Bond March Futures	Short	03.2023	15	409	0,01
Euro-OAT France Government 10-Year Bond March Futures	Short	03.2023	308	2.986	0,10
Japan Government 10-Year Bond March Futures	Long	03.2023	5	(103)	0,00
Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 138,500 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond September 2023 Futures ⁽¹⁾	Short	01.2023	32	(164)	(0,01)
U.S. Treasury 2-Year Note March Futures	Long	03.2023	104	(1)	0,00
U.S. Treasury 5-Year Note March Futures	Long	03.2023	2.808	(662)	(0,02)
U.S. Treasury 10-Year Note March Futures	Long	03.2023	558	(484)	(0,02)
U.S. Treasury 30-Year Bond March Futures	Long	03.2023	8	(7)	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond March Futures	Long	03.2023	232	(834)	(0,03)
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond March Futures	Short	03.2023	1.597	1.457	0,05
United Kingdom Long Gilt March Futures	Short	03.2023	289	1.937	0,06
				\$ 9.446	0,30

⁽¹⁾ Future-Style-Option.

VERKAUFSOPTIONEN

OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
Call – CME Kaufoptionen mit Ausübungskurs von USD 98,000 auf 3-Month SOFR December Futures	\$ 98,000	15.12.2023	47	\$ 0	\$ (4)	0,00
Put – CME Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von USD 96,500 auf 3-Month SOFR December Futures	96,500	15.12.2023	47	0	(143)	0,00
				\$ 0	\$ (147)	0,00
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate					\$ 9.299	0,30

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Valeo S.A.	1,000 %	20.06.2026	€ 4.500	\$ 54	0,00

ZINSSWAPS - BASISWAPS

Zahlung variabler Zinssatzindex	Erhalt variabler Zinssatzindex	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
3-Month USD-LIBOR	1-Month USD-LIBOR + 0,070 %	07.03.2024	\$ 6.300	\$ 15	0,00
3-Month USD-LIBOR	1-Month USD-LIBOR + 0,073 %	27.04.2023	13.700	6	0,00
3-Month USD-LIBOR	1-Month USD-LIBOR + 0,088 %	06.09.2024	46.500	20	0,00
3-Month USD-LIBOR	1-Month USD-LIBOR + 0,102 %	04.10.2024	13.400	0	0,00
3-Month USD-LIBOR	1-Month USD-LIBOR + 0,105 %	27.09.2024	14.200	2	0,00
				\$ 43	0,00

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fest-Zinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	0,010 %	07.02.2023	£ 52.050	\$ (371)	(0,01)
Zahlung ⁽³⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	2,000	15.03.2033	79.700	(1.250)	(0,04)
Zahlung ⁽³⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	2,000	15.03.2053	11.000	(235)	(0,01)
Zahlung ⁽³⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	2,250	15.03.2028	23.000	(791)	(0,03)
Erhalt ⁽³⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	2,500	15.03.2025	29.700	362	0,01
Erhalt	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	5,750	16.03.2027	INR 3.054.760	(1.240)	(0,04)
Zahlung	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	6,250	21.09.2023	7.259.000	(294)	(0,01)
Zahlung	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	6,250	21.09.2024	23.690	(1)	0,00
Erhalt	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	6,250	16.03.2032	316.000	(214)	(0,01)
Zahlung	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	6,500	21.09.2024	1.939.860	95	0,00
Erhalt	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	6,500	21.09.2027	878.100	(106)	0,00
Zahlung	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	6,750	21.09.2024	3.281.700	211	0,01
Erhalt	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	7,000	21.09.2027	800.600	(192)	(0,01)
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000	15.12.2028	¥ 180.000	(39)	0,00
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000	17.03.2031	1.500.000	(467)	(0,01)
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,035	29.11.2029	1.500.000	(399)	(0,01)
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,050	15.12.2031	3.600.000	(1.156)	(0,04)
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,200	19.06.2029	1.060.000	(262)	(0,01)
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,400	19.06.2039	430.000	258	0,01
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,450	15.12.2051	730.000	(174)	(0,01)
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,800	15.06.2052	360.000	265	0,01
Zahlung	1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS	2,500	21.09.2027	SGD 30.400	(552)	(0,02)
Zahlung	1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS	2,750	15.06.2027	11.500	(131)	0,00
Zahlung	1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS	2,750	21.09.2027	39.897	(246)	(0,01)
Zahlung	1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS	3,000	15.06.2027	17.600	(75)	0,00
Zahlung	1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS	3,250	21.12.2027	2.400	(11)	0,00
Erhalt	1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS	2,684	30.04.2025	\$ 900	21	0,00
Erhalt	1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS	2,696	30.04.2025	900	21	0,00
Erhalt	1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS	2,710	30.04.2025	1.000	24	0,00
Erhalt	1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS	2,714	30.04.2025	1.900	45	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,250	15.12.2023	28.500	(113)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,000	15.06.2029	28.500	(1.725)	(0,06)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,250	15.12.2028	16.500	(822)	(0,03)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,250	15.06.2032	43.200	(3.405)	(0,11)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,430	31.03.2024	33.000	(601)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,500	15.06.2052	13.400	(1.767)	(0,06)

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond ESG Fund (Forts.)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fest- Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,618 %	09.02.2029	\$ 6.900	\$ (370)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,695	15.11.2031	42.700	(3.128)	(0,10)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2024	139.200	11	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2027	48.120	(246)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2029	15.900	848	0,03
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2032	23.100	(569)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.12.2051	3.000	(391)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2052	23.280	63	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,175	21.04.2029	10.500	(599)	(0,02)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,750	30.04.2029	10.700	655	0,02
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,817	30.04.2029	30.000	1.837	0,06
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,818	30.04.2029	15.800	968	0,03
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,819	30.04.2029	12.600	772	0,03
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,886	15.05.2032	131.900	(10.519)	(0,34)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,965	30.11.2026	270.600	10.886	0,35
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,050	08.09.2029	14.000	(416)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,100	09.09.2029	2.400	(64)	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,224	30.06.2024	7.091	148	0,01
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,454	30.06.2029	17.400	(191)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,898	30.06.2029	15.600	225	0,01
Erhalt ⁽³⁾	3-Month AUD-BBR-BBSW	3,750	15.03.2024	AUD 284.400	268	0,01
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,000	16.06.2026	CAD 20.500	(134)	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,250	16.06.2031	34.000	(497)	(0,02)
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,500	17.06.2025	400	(2)	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,500	17.06.2030	27.900	(291)	(0,01)
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	2,500	28.01.2052	7.100	(419)	(0,01)
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	3,028	25.03.2052	2.500	(137)	0,00
Zahlung	3-Month CHF-SRFXON3 Compounded-OIS	0,283	14.02.2027	CHF 4.200	(149)	0,00
Zahlung	3-Month CHF-SRFXON3 Compounded-OIS	0,294	10.02.2027	15.500	(548)	(0,02)
Zahlung	3-Month CHF-SRFXON3 Compounded-OIS	0,343	16.05.2027	6.300	(255)	(0,01)
Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,500	16.03.2027	CNY 83.500	(193)	(0,01)
Zahlung	3-Month EUR-ESTRON Compounded-OIS	1,000	23.11.2024	€ 67.800	(717)	(0,02)
Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	3,000	21.09.2027	KRW 78.168.800	(1.531)	(0,05)
Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	3,000	15.06.2032	16.838.200	(618)	(0,02)
Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	3,250	21.09.2027	11.975.840	(232)	(0,01)
Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	3,250	15.06.2032	2.242.900	(81)	0,00
Zahlung	3-Month NZD-BBR	0,528	17.03.2024	NZD 950	(3)	0,00
Zahlung	3-Month NZD-BBR	3,000	01.11.2023	54.500	(394)	(0,01)
Zahlung	3-Month NZD-BBR	3,000	15.12.2023	53.500	(454)	(0,01)
Zahlung	3-Month NZD-BBR	3,750	15.06.2027	35.300	(1.240)	(0,04)
Zahlung ⁽³⁾	3-Month NZD-BBR	4,000	14.06.2024	93.500	(958)	(0,03)
Zahlung	3-Month SEK-STIBOR	1,000	19.06.2029	SEK 11.700	(45)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,250	16.06.2023	\$ 24.900	109	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,500	15.12.2023	39.400	(160)	(0,01)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,500	16.06.2028	5.300	(220)	(0,01)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,500	15.12.2028	20.200	(1.011)	(0,03)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,518	20.01.2029	12.300	(617)	(0,02)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,545	20.01.2029	8.200	(412)	(0,01)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,630	20.01.2029	10.300	(518)	(0,02)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,630	26.01.2029	2.300	(115)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	2,000	15.12.2051	26.100	(3.383)	(0,11)
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	7,250	20.06.2023	ZAR 11.400	(5)	0,00
Erhalt	6-Month AUD-BBR-BBSW	1,250	17.06.2030	AUD 4.800	99	0,00
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	1,750	16.03.2027	3.000	(41)	0,00
Erhalt	6-Month AUD-BBR-BBSW	1,750	16.06.2031	6.450	176	0,01
Zahlung ⁽³⁾	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,250	15.09.2032	5.700	(84)	0,00
Zahlung ⁽³⁾	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,250	15.03.2033	2.400	(26)	0,00
Zahlung ⁽³⁾	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,500	15.09.2032	241.400	(2.353)	(0,08)
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	1,913	30.01.2029	CZK 7.400	(14)	0,00
Erhalt ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	0,054	27.05.2050	€ 600	63	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,064	17.11.2052	1.300	200	0,01
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,250	15.09.2036	1.400	(187)	(0,01)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fest- Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,650 %	12.04.2027	€ 6.000	\$ (421)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,650	11.05.2027	4.300	(307)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,700	11.04.2027	3.300	(230)	(0,01)
Zahlung ⁽¹⁾	6-Month EUR-EURIBOR	1,000	30.03.2024	130.139	(2.836)	(0,09)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,000	13.05.2027	7.200	(508)	(0,02)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,000	18.05.2027	3.500	(247)	(0,01)
Zahlung ⁽²⁾	6-Month EUR-EURIBOR	1,500	15.03.2025	47.400	(985)	(0,03)
Zahlung ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	1,500	15.03.2028	163.100	(2.691)	(0,09)
Zahlung ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	1,500	15.03.2053	7.500	(677)	(0,02)
Zahlung ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	1,750	15.03.2033	152.500	(4.947)	(0,16)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,250	21.09.2037	11.890	(1.009)	(0,03)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,250	21.09.2042	6.060	(1.105)	(0,04)
Zahlung ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	19.03.2027	50.030	(60)	0,00
Erhalt ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	15.03.2033	22.470	68	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIE	4,870	07.07.2025	MXN 20.400	(8)	0,00
					\$ (48.509)	(1,56)
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					\$ (48.412)	(1,56)

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

⁽²⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert.

⁽³⁾ Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

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

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

OPTIONSKAUF

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
BOA	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,180 %	11.01.2024	8.600	\$ 246	\$ 911	0,03

OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
BPS	Put – OTC France Government International Bond 0,750 % fällig am 25.05.2052	€ 97,000	23.05.2025	2.200	\$ 166	\$ 899	0,03

VERKAUFSoPTIONEN

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Netto- vermögens
BOA	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,150 %	01.12.2023	6.200	\$ (19)	\$ (4)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	01.12.2023	6.200	(19)	(47)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,310	11.01.2024	76.400	(247)	(1.263)	(0,04)
	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,000	19.01.2023	2.600	(11)	(1)	0,00
BPS	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,500	19.01.2023	2.600	(11)	(31)	0,00
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,550	11.04.2023	9.400	(10)	0	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,100	11.04.2023	9.400	(29)	(146)	(0,01)
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,700	28.04.2023	6.400	(11)	0	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,250	28.04.2023	6.400	(11)	(91)	0,00
	Put – OTC 25-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,451	23.05.2025	2.200	(166)	(841)	(0,03)
	Call – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,150	09.01.2023	8.800	(31)	0	0,00
	Put – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	09.01.2023	8.800	(31)	(53)	0,00
	Call – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,270	23.01.2023	2.400	(6)	(1)	0,00
	Put – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,770	23.01.2023	2.400	(6)	(12)	0,00
BRC	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,000	19.01.2023	1.600	(7)	(1)	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,500	19.01.2023	1.600	(7)	(19)	0,00
	Call – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,200	12.01.2023	3.300	(10)	0	0,00
	Put – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,800	12.01.2023	3.300	(10)	(11)	0,00
CBK	Call – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,150	09.01.2023	1.700	(6)	0	0,00
	Put – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	09.01.2023	1.700	(6)	(10)	0,00
GLM	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,920	13.10.2023	5.600	(34)	(6)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,920	13.10.2023	5.600	(34)	(77)	0,00
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,018	20.10.2023	2.500	(16)	(3)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,018	20.10.2023	2.500	(16)	(32)	0,00
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,140	23.10.2023	2.500	(18)	(4)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,140	23.10.2023	2.500	(18)	(30)	0,00
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,190	23.10.2023	2.500	(17)	(4)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,190	23.10.2023	2.500	(17)	(4)	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond ESG Fund (Forts.)

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Netto- vermögens
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,190 %	23.10.2023	2.500	\$ (17)	\$ (29)	0,00
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,225	23.10.2023	2.600	(18)	(4)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,225	23.10.2023	2.600	(18)	(29)	0,00
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,841	27.10.2023	3.000	(21)	(3)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,841	27.10.2023	3.000	(21)	(42)	0,00
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,088	03.11.2023	5.400	(39)	(8)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,088	03.11.2023	5.400	(39)	(64)	0,00
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,910	10.11.2023	3.000	(20)	(4)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,910	10.11.2023	3.000	(20)	(39)	0,00
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,250	17.11.2023	5.100	(19)	(4)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	17.11.2023	5.100	(19)	(36)	0,00
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,150	20.11.2023	4.600	(16)	(3)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	20.11.2023	4.600	(16)	(36)	0,00
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,250	07.12.2023	5.200	(16)	(4)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	07.12.2023	5.200	(16)	(36)	0,00
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,697	02.04.2024	9.300	(73)	(28)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,697	02.04.2024	9.300	(73)	(116)	(0,01)
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,721	08.04.2024	2.800	(21)	(9)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,721	08.04.2024	2.800	(21)	(34)	0,00
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,550	05.04.2023	18.200	(34)	0	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,100	05.04.2023	18.200	(34)	(281)	(0,01)
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,550	11.04.2023	31.800	(62)	0	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,100	11.04.2023	31.800	(62)	(494)	(0,02)
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,700	24.04.2023	5.800	(6)	0	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,250	24.04.2023	5.800	(16)	(82)	0,00
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,700	26.04.2023	6.800	(12)	0	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,250	26.04.2023	6.800	(12)	(96)	0,00
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,550	15.05.2023	9.300	(16)	0	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,100	15.05.2023	9.300	(16)	(148)	(0,01)
	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,067	09.06.2023	8.000	(93)	(20)	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	3,140	09.06.2023	8.000	(111)	(262)	(0,01)
	Call – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,230	23.01.2023	6.500	(16)	(3)	0,00
	Put – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,730	23.01.2023	6.500	(16)	(39)	0,00
JPM	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Erhalt	0,820	16.12.2024	20.100	(142)	(30)	0,00
	Call – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,200	12.01.2023	4.100	(13)	(1)	0,00
	Put – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,800	12.01.2023	4.100	(13)	(14)	0,00
MYC	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,993	11.10.2023	9.600	(65)	(13)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,993	11.10.2023	9.600	(65)	(130)	(0,01)
							\$ (2.114)	\$ (4.828)	(0,15)

⁽¹⁾ Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZKAUF⁽¹⁾

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽³⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Netto- vermögens
BPS	South Korea Government International Bond	(1,000) %	20.06.2023	\$ 1.500	\$ (37)	\$ 32	\$ (5)	0,00
BRC	China Government International Bond	(1,000)	20.06.2023	600	(11)	9	(2)	0,00
	South Korea Government International Bond	(1,000)	20.06.2023	1.900	(48)	41	(7)	0,00
GST	China Government International Bond	(1,000)	20.06.2023	1.300	(25)	20	(5)	0,00
HUS	South Korea Government International Bond	(1,000)	20.06.2023	600	(15)	13	(2)	0,00
JPM	South Korea Government International Bond	(1,000)	20.06.2023	900	(22)	19	(3)	0,00
					\$ (158)	\$ 134	\$ (24)	0,00

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽²⁾

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽³⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Netto- vermögens
BRC	Italy Government International Bond	1,000 %	20.06.2025	\$ 1.700	\$ (41)	\$ 49	\$ 8	0,00
CBK	Italy Government International Bond	1,000	20.06.2025	1.100	(27)	32	5	0,00
GST	Abu Dhabi Government International Bond	1,000	20.12.2026	200	6	(1)	5	0,00
					\$ (62)	\$ 80	\$ 18	0,00

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

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

⁽³⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definieren.

CROSS-CURRENCY SWAPS

Kontrahent	Erhalt	Zahlung	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag erhaltener Währung	Nenn- Betrag zu zahlender Währung	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Netto- vermögens
AZD	Variable Zinssatz entspricht 3-Month AUD-LIBOR zzgl. 0,290 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variable Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	04.01.2031	AUD 14.600	\$ 11.000	\$ 73	\$ (43)	\$ 30	0,00
CBK	Variable Zinssatz entspricht 3-Month AUD-LIBOR zzgl. 0,420 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variable Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	31.07.2029	5.100	3.519	(1)	7	6	0,00
GLM	Variable Zinssatz entspricht 3-Month AUD-LIBOR zzgl. 0,423 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variable Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	01.08.2029	5.000	3.450	(10)	7	(3)	0,00
MYC	Variable Zinssatz entspricht 3-Month AUD-LIBOR zzgl. 0,298 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variable Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	14.10.2030	10.100	7.256	43	(27)	16	0,00
						\$ 105	\$ (56)	\$ 49	0,00

ZINSSWAPS

Kontrahent	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fest- Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Netto- vermögens
BOA	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,250 %	16.03.2032	MYR 4.998	\$ 13	\$ 55	\$ 68	0,00
	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,500	21.09.2027	6.900	3	15	18	0,00
	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	4,000	21.09.2027	76.338	88	(289)	(201)	(0,01)
	Erhalt	3-Month THB-THORON Compounded-OIS	2,000	21.09.2024	THB 480.600	(21)	(4)	(25)	0,00
	Erhalt	3-Month THB-THORON Compounded-OIS	2,250	21.12.2027	540.600	(78)	51	(27)	0,00
	Zahlung	6-Month THB-THBFIX	2,000	16.03.2032	50.200	8	(66)	(58)	0,00
	Zahlung	6-Month THB-THBFIX	2,000	15.06.2032	122.300	(14)	(148)	(162)	(0,01)
	Zahlung	6-Month THB-THBFIX	2,750	15.06.2032	10.310	(4)	10	6	0,00
	Zahlung	6-Month THB-THBFIX	2,750	21.09.2032	126.900	(3)	100	97	0,01
BPS	Zahlung	6-Month THB-THBFIX	2,000	15.06.2032	1.800	(1)	(1)	(2)	0,00
	Zahlung	6-Month THB-THBFIX	3,250	15.06.2032	47.400	7	79	86	0,00
CBK	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,500	16.03.2032	MYR 10.700	6	90	96	0,00
GLM	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,750	21.09.2032	19.500	(16)	111	95	0,00
	Zahlung	6-Month THB-THBFIX	2,000	15.06.2032	THB 53.000	(3)	(67)	(70)	0,00
	Zahlung	6-Month THB-THBFIX	3,250	15.06.2032	10.300	2	17	19	0,00
GST	Erhalt	3-Month THB-THORON Compounded-OIS	2,000	21.09.2024	1.437.600	(151)	78	(73)	0,00
	Zahlung	6-Month THB-THBFIX	2,500	21.09.2032	38.100	(6)	10	4	0,00
JPM	Zahlung	6-Month THB-THBFIX	2,000	15.06.2032	113.200	(12)	(138)	(150)	0,00
MBC	Zahlung	6-Month THB-THBFIX	2,000	15.06.2032	30.900	(8)	(33)	(41)	0,00
SCX	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,500	21.09.2027	MYR 33.800	25	61	86	0,00
	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,500	16.03.2032	5.400	(17)	65	48	0,00
	Erhalt	3-Month THB-THORON Compounded-OIS	2,000	21.09.2024	THB 1.934.802	127	(226)	(99)	0,00
	Erhalt	3-Month THB-THORON Compounded-OIS	2,000	21.09.2027	17.364	1	4	5	0,00
	Erhalt	3-Month THB-THORON Compounded-OIS	2,250	21.09.2027	522.370	(94)	62	(32)	0,00
						\$ (148)	\$ (164)	\$ (312)	(0,01)

DEWISENTERMIKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2023	£ 861	\$ 1.036	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	01.2023	HUF 1.031.181	2.633	0	(116)	(116)	0,00
	01.2023	¥ 20.798.000	145.501	0	(12.180)	(12.180)	(0,39)
	01.2023	\$ 1.453	CHF 1.375	34	0	34	0,00
	01.2023	1.801	€ 1.794	114	0	114	0,00
	01.2023	2.086	¥ 275.600	5	0	5	0,00
	01.2023	2	THB 70	0	0	0	0,00
	02.2023	¥ 14.370.000	\$ 98.332	0	(11.139)	(11.139)	(0,36)
	03.2023	MYR 81.190	17.988	0	(646)	(646)	(0,02)
	03.2023	\$ 2.796	ZAR 49.363	89	0	89	0,00
	05.2023	CNH 89.246	\$ 13.796	762	0	762	0,02
BOM	01.2023	CAD 10.174	7.577	68	0	68	0,00
BPS	01.2023	€ 2.482	2.646	0	(4)	(4)	0,00
	01.2023	£ 1.681	1.930	0	(92)	(92)	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond ESG Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	01.2023	HUF 2.908.783	\$ 7.597	\$ 0	\$ (156)	\$ (156)	(0,01)
	01.2023	ILS 8.769	2.558	72	0	72	0,00
	01.2023	THB 118	3	0	0	0	0,00
	01.2023	TWD 273.940	8.949	18	0	18	0,00
	01.2023	\$ 3.418	BRL 18.580	101	0	101	0,00
	01.2023	1.251	KRW 1.627.301	42	0	42	0,00
	03.2023	ILS 18.352	\$ 5.422	205	0	205	0,01
	03.2023	MXN 53.325	2.646	0	(53)	(53)	0,00
	03.2023	MYR 329	70	0	(5)	(5)	0,00
	03.2023	TWD 90.306	2.996	37	0	37	0,00
	03.2023	\$ 656	CLP 633.054	80	0	80	0,00
	03.2023	4.834	MYR 21.355	67	0	67	0,00
	03.2023	ZAR 46.688	\$ 2.566	0	(162)	(162)	(0,01)
	04.2023	MYR 2.716	582	0	(43)	(43)	0,00
	05.2023	3.862	828	0	(61)	(61)	0,00
BRC	01.2023	£ 1.450	1.746	2	0	2	0,00
	01.2023	HUF 2.015.548	5.256	0	(115)	(115)	0,00
	01.2023	SGD 468	347	0	(1)	(1)	0,00
	01.2023	\$ 601	CNH 4.193	5	0	5	0,00
	01.2023	6.094	MYR 28.830	501	0	501	0,02
	01.2023	26.103	NOK 259.736	271	0	271	0,01
	01.2023	161	THB 5.545	0	0	0	0,00
	02.2023	TWD 258.622	\$ 8.413	0	(42)	(42)	0,00
CBK	03.2023	¥ 8.880.000	66.112	0	(1.870)	(1.870)	(0,06)
	01.2023	AUD 4.837	3.268	0	(13)	(13)	0,00
	01.2023	CAD 1.054	779	1	0	1	0,00
	01.2023	CLP 901.527	946	0	(111)	(111)	0,00
	01.2023	ILS 28.695	9.086	952	0	952	0,03
	01.2023	KRW 1.160.828	921	0	(2)	(2)	0,00
	01.2023	NZD 49.113	30.663	0	(401)	(401)	(0,01)
	01.2023	THB 172.521	4.989	1	0	1	0,00
	01.2023	\$ 3.446	AUD 5.099	19	(6)	13	0,00
	01.2023	8.513	BRL 44.680	0	(50)	(50)	0,00
	01.2023	2.750	CAD 3.713	0	(10)	(10)	0,00
	01.2023	13.154	CHF 12.425	284	0	284	0,01
	01.2023	3.259	CLP 2.809.718	33	0	33	0,00
	01.2023	2.345	€ 2.235	41	0	41	0,00
	01.2023	12.649	¥ 1.682.200	109	0	109	0,00
	01.2023	2.777	NOK 27.529	18	0	18	0,00
	01.2023	11.141	NZD 17.430	0	(116)	(116)	0,00
	01.2023	1.527	THB 52.995	6	0	6	0,00
	02.2023	ILS 19.427	\$ 5.653	139	0	139	0,00
	02.2023	PEN 40.232	10.088	0	(431)	(431)	(0,01)
	02.2023	\$ 2.892	BRL 15.608	48	0	48	0,00
	03.2023	PEN 6.056	\$ 1.567	0	(10)	(10)	0,00
	04.2023	CLP 2.849.880	3.259	0	(33)	(33)	0,00
	04.2023	PEN 5.662	1.434	0	(37)	(37)	0,00
	05.2023	CNH 9.805	1.516	84	0	84	0,00
	05.2023	ILS 21.615	6.394	224	0	224	0,01
	05.2023	\$ 20.110	CNH 142.033	624	0	624	0,02
	07.2023	ILS 24.718	\$ 7.716	629	0	629	0,02
	11.2023	63.106	18.857	603	0	603	0,02
GLM	01.2023	BRL 68.281	12.812	0	(121)	(121)	0,00
	01.2023	CAD 11.875	8.671	0	(94)	(94)	0,00
	01.2023	CLP 795.119	807	0	(125)	(125)	(0,01)
	01.2023	HUF 184.094	471	0	(19)	(19)	0,00
	01.2023	MYR 4.479	1.020	0	(5)	(5)	0,00
	01.2023	PEN 601	155	0	(2)	(2)	0,00
	01.2023	THB 54.064	1.551	0	(12)	(12)	0,00
	01.2023	\$ 1.553	CNH 10.813	12	0	12	0,00
	01.2023	3.723	MYR 16.406	32	(3)	29	0,00
	03.2023	CNH 18.398	\$ 2.849	175	0	175	0,01
	03.2023	MXN 16.018	779	0	(31)	(31)	0,00
	03.2023	\$ 3.772	CLP 3.436.497	224	0	224	0,01
	04.2023	12.588	BRL 68.281	123	0	123	0,00
	05.2023	3.118	PEN 12.405	101	0	101	0,00
JPM	01.2023	CAD 4.200	\$ 3.090	0	(10)	(10)	0,00
	01.2023	CNY 4.312	620	0	(5)	(5)	0,00
	01.2023	£ 114.297	138.017	507	0	507	0,02
	01.2023	HUF 380.808	971	0	(44)	(44)	0,00
	01.2023	¥ 144.000	1.052	0	(42)	(42)	0,00
	01.2023	\$ 1.824	THB 63.254	5	0	5	0,00
	02.2023	TWD 92.249	\$ 3.038	25	0	25	0,00
	03.2023	CNY 7.698	1.113	0	(6)	(6)	0,00
	03.2023	IDR 1.500.481	96	0	(1)	(1)	0,00
	03.2023	\$ 6.395	CNH 45.450	210	0	210	0,01
	05.2023	2.875	20.268	85	0	85	0,00
MBC	01.2023	AUD 3.292	\$ 2.201	0	(32)	(32)	0,00
	01.2023	DKK 143.842	20.319	0	(335)	(335)	(0,01)
	01.2023	€ 515.810	540.787	0	(9.946)	(9.946)	(0,32)
	01.2023	£ 9.598	11.703	155	0	155	0,01
	01.2023	¥ 1.962.062	14.250	0	(631)	(631)	(0,02)
	01.2023	\$ 2.226	AUD 3.306	16	0	16	0,00

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	01.2023	\$ 1.296	CAD 1.740	\$ 0	\$ (12)	\$ (12)	0,00
	01.2023	3.572	€ 3.345	0	0	0	0,00
	01.2023	1.005	£ 821	0	(17)	(17)	0,00
	01.2023	32.272	¥ 4.289.600	261	0	261	0,01
	01.2023	1.546	NOK 15.310	9	0	9	0,00
	01.2023	3.194	THB 110.678	6	0	6	0,00
	02.2023	ILS 57.644	\$ 16.709	349	0	349	0,01
	02.2023	¥ 13.690.000	94.831	0	(9.359)	(9.359)	(0,30)
	03.2023	IDR 910.718	58	0	(1)	(1)	0,00
	03.2023	\$ 926	TWD 28.124	0	(4)	(4)	0,00
	03.2023	ZAR 520	\$ 28	0	(2)	(2)	0,00
	05.2023	CNH 63.213	9.419	195	0	195	0,01
MYI	01.2023	€ 1.115	1.187	0	(3)	(3)	0,00
	01.2023	£ 6	7	0	0	0	0,00
	01.2023	¥ 9.364.311	68.305	0	(2.715)	(2.715)	(0,09)
	01.2023	MYR 8.981	2.035	0	(19)	(19)	0,00
	01.2023	NOK 1.015	103	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 4.613	AUD 6.870	47	0	47	0,00
	01.2023	16	CHF 15	0	0	0	0,00
	01.2023	9.775	€ 9.201	44	0	44	0,00
	01.2023	321	£ 266	0	(1)	(1)	0,00
	01.2023	1.561	MYR 7.388	129	0	129	0,00
	02.2023	TWD 170.548	\$ 5.594	23	0	23	0,00
	03.2023	IDR 1.283.167	82	0	(1)	(1)	0,00
RBC	01.2023	CAD 752	552	0	(3)	(3)	0,00
	01.2023	\$ 53	AUD 79	1	0	1	0,00
RYL	01.2023	€ 3.898	\$ 4.132	0	(30)	(30)	0,00
	01.2023	\$ 671	HUF 252.989	1	0	1	0,00
SCX	01.2023	CAD 25.678	\$ 18.952	56	(57)	(1)	0,00
	01.2023	CLP 1.991.250	2.001	0	(332)	(332)	(0,01)
	01.2023	¥ 191.400	1.423	0	(29)	(29)	0,00
	01.2023	TWD 325.101	10.335	0	(256)	(256)	(0,01)
	01.2023	\$ 310	AUD 461	2	0	2	0,00
	01.2023	938	BRL 5.021	13	0	13	0,00
	01.2023	84	£ 70	0	0	0	0,00
	01.2023	2.033	MYR 8.981	21	0	21	0,00
	01.2023	588	PEN 2.264	5	0	5	0,00
	01.2023	1.567	THB 54.381	5	0	5	0,00
	02.2023	CAD 7.487	\$ 5.468	0	(59)	(59)	0,00
	03.2023	CNH 27.028	4.187	259	0	259	0,01
	03.2023	MYR 81.461	17.582	0	(1.114)	(1.114)	(0,04)
	01.2023	\$ 6.480	MYR 30.464	488	0	488	0,01
SSB	01.2023	CAD 27.005	\$ 19.961	72	(43)	29	0,00
TOR	01.2023	¥ 13.260.000	91.627	0	(9.083)	(9.083)	(0,29)
	01.2023	\$ 14.301	¥ 1.885.500	0	(1)	(1)	0,00
UAG	01.2023	CZK 1.783	\$ 70	0	(9)	(9)	0,00
	01.2023	DKK 159.754	22.361	0	(577)	(577)	(0,02)
	01.2023	HUF 2.527.024	6.425	0	(308)	(308)	(0,01)
	01.2023	THB 2.065	60	0	0	0	0,00
	02.2023	ILS 60.790	17.735	481	0	481	0,01
	02.2023	¥ 10.880.000	77.413	0	(5.564)	(5.564)	(0,18)
	02.2023	TWD 2.547	83	0	0	0	0,00
	03.2023	¥ 10.548.307	78.035	0	(2.591)	(2.591)	(0,08)
				\$ 10.425	\$ (71.559)	\$ (61.134)	(1,97)

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilsklasse Class Z AUD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Netto- vermögens
AZD	01.2023	\$ 52.241	AUD 77.551	\$ 363	\$ 0	\$ 363	0,01
BOA	01.2023	414	612	2	0	2	0,00
CBK	01.2023	22.806	34.022	273	(2)	271	0,01
MBC	01.2023	39.509	58.783	393	(28)	365	0,01
MYI	01.2023	60.564	90.186	610	0	610	0,02
RBC	01.2023	10.934	16.311	130	0	130	0,00
TOR	01.2023	54.851	81.267	274	0	274	0,01
				\$ 2.045	\$ (30)	\$ 2.015	0,06

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional CHF (Hedged) thesaurierend und Class E CHF (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Netto- vermögens
BOA	01.2023	\$ 189.831	CHF 179.532	\$ 4.340	\$ 0	\$ 4.340	0,14
BRC	01.2023	344	319	1	0	1	0,00
CBK	01.2023	325.349	307.409	7.127	0	7.127	0,23

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond ESG Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
MBC	01.2023	CHF 1.394	\$ 1.501	\$ 1	\$ (8)	\$ (7)	0,00
	01.2023	\$ 574	CHF 536	5	0	5	0,00
MYI	01.2023	1.165	1.089	13	0	13	0,00
SCX	01.2023	CHF 29.555	\$ 31.829	0	(137)	(137)	(0,01)
	01.2023	\$ 1.511	CHF 1.398	2	0	2	0,00
UAG	01.2023	CHF 106	\$ 114	0	0	0	0,00
				\$ 11.489	\$ (145)	\$ 11.344	0,36

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Currency Exposure) thesaurierend und Institutional EUR (Currency Exposure) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2023	\$ 5	AUD 8	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	01.2023	350	CAD 473	0	(1)	(1)	0,00
	01.2023	6	CHF 5	0	0	0	0,00
	01.2023	19	DKK 139	1	0	1	0,00
	01.2023	27	€ 26	0	0	0	0,00
	01.2023	531	£ 441	0	(1)	(1)	0,00
	01.2023	1.611	¥ 222.137	74	0	74	0,00
	01.2023	4	SEK 41	0	0	0	0,00
	01.2023	20	SGD 27	1	0	1	0,00
	02.2023	CLP 2.857	\$ 3	0	0	0	0,00
	02.2023	COP 23.574	5	0	0	0	0,00
CBK	01.2023	AUD 195	131	0	(1)	(1)	0,00
	01.2023	COP 34.442	7	0	0	0	0,00
	01.2023	€ 994	1.058	0	(4)	(4)	0,00
	01.2023	IDR 592.099	37	0	(1)	(1)	0,00
	01.2023	¥ 62	0	0	0	0	0,00
	01.2023	MXN 654	34	0	0	0	0,00
	01.2023	PEN 23	6	0	0	0	0,00
	01.2023	SEK 338	32	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 9	AUD 13	0	0	0	0,00
	01.2023	58	CHF 55	1	0	1	0,00
	01.2023	1.120	CNY 7.884	22	0	22	0,00
	01.2023	0	CZK 1	0	0	0	0,00
	01.2023	2.938	€ 2.830	84	0	84	0,01
	01.2023	27	£ 22	0	0	0	0,00
	01.2023	54	IDR 854.180	1	0	1	0,00
	01.2023	14	ILS 49	0	0	0	0,00
	01.2023	22	¥ 3.012	1	0	1	0,00
	01.2023	33	MXN 654	0	0	0	0,00
	01.2023	8	NOK 80	0	0	0	0,00
	01.2023	16	NZD 26	0	0	0	0,00
	01.2023	0	SEK 0	0	0	0	0,00
	02.2023	7	COP 34.442	0	0	0	0,00
	02.2023	33	MXN 654	0	0	0	0,00
	02.2023	5	PEN 20	0	0	0	0,00
GSC	01.2023	CNY 5.631	\$ 807	0	(8)	(8)	0,00
	01.2023	DKK 117	17	0	0	0	0,00
	01.2023	€ 2	2	0	0	0	0,00
	01.2023	KRW 128.225	101	0	(1)	(1)	0,00
	01.2023	MYR 321	73	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 9	CNY 63	0	0	0	0,00
	01.2023	7	COP 34.442	0	0	0	0,00
	01.2023	10	CZK 245	0	0	0	0,00
	01.2023	71	MYR 321	2	0	2	0,00
	01.2023	6	PEN 22	0	0	0	0,00
	01.2023	16	PLN 72	1	0	1	0,00
	01.2023	6	RON 30	0	0	0	0,00
	01.2023	2	SGD 2	0	0	0	0,00
	02.2023	MXN 446	\$ 23	0	0	0	0,00
	02.2023	MYR 131	30	0	0	0	0,00
	02.2023	PEN 13	3	0	0	0	0,00
	02.2023	\$ 43	MYR 190	0	0	0	0,00
UAG	01.2023	CAD 346	\$ 254	0	(1)	(1)	0,00
	01.2023	CHF 42	45	0	0	0	0,00
	01.2023	CLP 4.219	5	0	0	0	0,00
	01.2023	CZK 171	8	0	0	0	0,00
	01.2023	€ 994	1.058	0	(3)	(3)	0,00
	01.2023	£ 319	384	0	0	0	0,00
	01.2023	HUF 1.623	4	0	0	0	0,00
	01.2023	ILS 34	10	0	0	0	0,00
	01.2023	¥ 157.932	1.182	0	(16)	(16)	0,00
	01.2023	NOK 56	6	0	0	0	0,00
	01.2023	NZD 18	11	0	0	0	0,00
	01.2023	PLN 50	11	0	0	0	0,00
	01.2023	RON 21	5	0	0	0	0,00
	01.2023	SGD 24	18	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 177	AUD 262	1	0	1	0,00

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Netto- vermögens
	01.2023	\$ 19	CAD 25	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	01.2023	4	CLP 4.219	1	0	1	0,00
	01.2023	36	CNY 249	0	0	0	0,00
	01.2023	4	DKK 29	0	0	0	0,00
	01.2023	15	€ 14	0	0	0	0,00
	01.2023	6	HUF 2.354	0	0	0	0,00
	01.2023	0	IDR 593	0	0	0	0,00
	01.2023	0	ILS 0	0	0	0	0,00
	01.2023	13	¥ 1.753	0	0	0	0,00
	01.2023	142	KRW 186.268	6	0	6	0,00
	01.2023	43	SEK 448	0	0	0	0,00
	01.2023	4	SGD 6	0	0	0	0,00
	01.2023	24	THB 862	0	0	0	0,00
	02.2023	5	CLP 4.219	0	0	0	0,00
				\$ 196	\$ (37)	\$ 159	0,01

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend und Class E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Netto- vermögens
BOA	01.2023	€ 506	\$ 533	\$ 0	\$ (7)	\$ (7)	0,00
BPS	01.2023	\$ 888	€ 833	1	0	1	0,00
CBK	01.2023	€ 4.125	\$ 4.390	0	(15)	(15)	0,00
	01.2023	\$ 371.697	€ 357.833	10.364	0	10.364	0,33
JPM	01.2023	8.793	8.456	235	0	235	0,01
MBC	01.2023	€ 8.722	\$ 9.200	0	(113)	(113)	0,00
	01.2023	\$ 409.470	€ 390.504	7.474	0	7.474	0,24
SCX	01.2023	371.702	357.114	9.592	0	9.592	0,31
				\$ 27.666	\$ (135)	\$ 27.531	0,89

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend und Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Netto- vermögens
BOA	01.2023	£ 6	\$ 7	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	01.2023	\$ 2.308	£ 1.898	0	(25)	(25)	0,00
BPS	01.2023	1.023	848	0	(2)	(2)	0,00
BRC	01.2023	£ 264	\$ 318	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 5	£ 4	0	0	0	0,00
JPM	01.2023	34.369	28.462	0	(127)	(127)	0,00
MBC	01.2023	£ 318	\$ 388	6	0	6	0,00
	01.2023	\$ 34.229	£ 28.545	140	(27)	113	0,00
MYI	01.2023	£ 59	\$ 72	1	0	1	0,00
	01.2023	\$ 62	£ 50	0	(1)	(1)	0,00
TOR	01.2023	34.281	28.513	23	0	23	0,00
UAG	01.2023	£ 23	\$ 29	1	0	1	0,00
	01.2023	\$ 199	£ 162	0	(4)	(4)	0,00
				\$ 171	\$ (186)	\$ (15)	0,00

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilsklasse Institutional NOK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Netto- vermögens
BPS	01.2023	\$ 472	NOK 4.673	\$ 2	\$ 0	\$ 2	0,00
BRC	01.2023	165.068	1.642.498	1.710	(1)	1.709	0,05
CBK	01.2023	161.176	1.597.568	1.040	0	1.040	0,03
MBC	01.2023	NOK 1.094	\$ 110	0	(1)	(1)	0,00
	01.2023	\$ 20.544	NOK 201.161	7	(126)	(119)	0,00
MYI	01.2023	NOK 107.938	\$ 10.948	0	(12)	(12)	0,00
	01.2023	\$ 166	NOK 1.634	0	0	0	0,00
RYL	01.2023	23	227	0	0	0	0,00
SCX	01.2023	172.525	1.711.894	1.300	(1)	1.299	0,04
TOR	01.2023	36.872	365.088	199	0	199	0,01
				\$ 4.258	\$ (141)	\$ 4.117	0,13

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond ESG Fund (Forts.)

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilsklasse Institutional NZD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	01.2023	\$ 12.804	NZD 20.522	\$ 176	\$ 0	\$ 176	0,01
CBK	01.2023	14.414	23.062	177	(5)	172	0,01
SCX	01.2023	13.600	21.835	210	0	210	0,00
				\$ 563	\$ (5)	\$ 558	0,02

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilsklasse Institutional SEK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2023	SEK 48	\$ 5	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	01.2023	\$ 20	SEK 203	0	0	0	0,00
BRC	01.2023	14.804	155.044	82	0	82	0,00
CBK	01.2023	SEK 331	\$ 32	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 1.287	SEK 13.427	2	0	2	0,00
MBC	01.2023	SEK 217	\$ 21	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 155	SEK 1.628	1	0	1	0,00
MYI	01.2023	4.889	51.424	48	0	48	0,00
SCX	01.2023	SEK 120	\$ 12	0	0	0	0,00
UAG	01.2023	87	8	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 27.531	SEK 288.835	200	0	200	0,01
				\$ 333	\$ 0	\$ 333	0,01
						\$ (18.379)	(0,59)

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖGENS
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN			
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA			
2,000 % fällig am 01.01.2038	\$ 29.000	\$ (25.797)	(0,83)
2,000 % fällig am 01.01.2053	9.605	(7.818)	(0,25)
2,000 % fällig am 01.02.2053	104.945	(85.507)	(2,75)
Summe Leerverkaufte Wertpapiere		\$ (119.122)	(3,83)
Summe Anlagen		\$ 3.900.762	125,57
Sonstige Aktiva und Passiva		\$ (794.572)	(25,57)
Nettovermögen		\$ 3.106.190	100,00

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

- * Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt
- ^ Das Wertpapier ist in Verzug.
- (a) Nullkuponwertpapier.
- (b) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.
- (c) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.
- (d) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.
- (e) Mit dem Fonds verbunden.
- (f) Bedingt wandelbares Wertpapier.

Barmittel in Höhe von 78.217 USD (31. Dezember 2021: 31.504 USD) wurden zum 31. Dezember 2022 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 44.770 USD (31. Dezember 2021: 2.340 USD) wurden gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. zum 31. Dezember 2022 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 2.913.880	\$ 0	\$ 2.913.880
Investmentfonds	5.649	0	0	5.649
Pensionsgeschäfte	0	1.157.847	0	1.157.847
Finanzderivate ⁽³⁾	10.275	(67.767)	0	(57.492)
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(119.122)	0	(119.122)
Summen	\$ 15.924	\$ 3.884.838	\$ 0	\$ 3.900.762

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

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 2.374.485	\$ 0	\$ 2.374.485
Investmentfonds	6.595	0	0	6.595
Pensionsgeschäfte	0	38.254	0	38.254
Finanzderivate ⁽³⁾	3.264	14.315	0	17.579
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(197.580)	0	(197.580)
Summen	\$ 9.859	\$ 2.229.474	\$ 0	\$ 2.239.333

⁽¹⁾ Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

⁽²⁾ Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

⁽³⁾ Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung des Marktwerts der außerbörslich gehandelten Finanzderivate und (erhaltenen)/verpfändeten Sicherheiten nach Kontrahenten zum 31. Dezember 2022 und 31. Dezember 2021:

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2022			Zum 31. Dez. 2021		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾
AZD	\$ 569	\$ (270)	\$ 299	\$ (4)	\$ 70	\$ 66
BOA	(19.412)	16.030	(3.382)	515	(560)	(45)
BOM	68	0	68	k. A.	k. A.	k. A.
BPS	(119)	70	(49)	905	(960)	(55)
BRC	511	(350)	161	3.889	(4.120)	(231)
CBK	21.756	(21.180)	576	1.288	(1.340)	(52)
GLM	(1.813)	1.600	(213)	3.417	(3.830)	(413)
GSC	(6)	0	(6)	k. A.	k. A.	k. A.
GST	(69)	70	1	(21)	20	(1)
HUS	(2)	0	(2)	2.165	(2.040)	125
JPM	634	(560)	74	(552)	370	(182)
MBC	(11.665)	10.830	(835)	k. A.	k. A.	k. A.
MYC	(127)	50	(77)	(126)	(250)	(376)
MYI	(1.837)	1.310	(527)	6.997	(7.410)	(413)
RBC	128	0	128	2.371	(1.900)	471
RYL	(29)	0	(29)	(862)	750	(112)
SCX	9.488	(8.580)	908	636	(280)	356
SSB	488	(420)	68	6	0	6
TOR	(8.559)	7.570	(989)	(2.064)	1.040	(1.024)
UAG	(8.383)	7.240	(1.143)	1.135	(900)	235
WST	k. A.	k. A.	k. A.	(9)	0	(9)

⁽¹⁾ Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2022:

	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	34,52	70,78
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	58,42	31,15
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,85	1,18
Investmentfonds	0,18	0,29
Pensionsgeschäfte	37,28	1,66
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,30	0,20
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(1,56)	(0,29)
Freiverkehrsfinaanzderivate	(0,59)	0,85
Leerverkaufte Wertpapiere	(3,83)	(8,58)

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2022 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
Unternehmensanleihen und Wechsel	15,77	34,64
Kommunalanleihen und Wechsel	0,00	0,01
US-Regierungsbehörden	16,84	8,33
US-Schatzobligationen	3,33	3,74
Non-Agency-MBS	3,93	5,77
Forderungsbesicherte Wertpapiere	8,18	9,18
Staatsemissionen	10,32	28,50
Vorzugswertpapiere	0,00	0,01
Kurzfristige Instrumente	35,42	12,93
Investmentfonds	0,18	0,29
Pensionsgeschäfte	37,28	1,66
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,30	0,20
Verkaufsoptionen		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	0,00	k. A.
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf	0,00	0,00
Zinsswaps — Basisswaps	0,00	0,00
Zinsswaps	(1,56)	(0,29)
Freiverkehrfinanzderivate		
Optionskauf		
Zinsswapoptionen	0,03	0,01
Optionen auf Wertpapiere	0,03	0,01
Verkaufsoptionen		
Devisenoptionen	k. A.	0,00
Zinsswapoptionen	(0,15)	(0,12)
Zinsscaps	k. A.	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzkauf	0,00	(0,01)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf	0,00	0,00
Cross-Currency Swaps	0,00	0,00
Zinsswaps	(0,01)	0,01
Devisenterminkontrakte	(1,97)	(0,26)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	1,48	1,21
Leerverkaufte Wertpapiere	(3,83)	(8,58)
Sonstige Aktiva und Passiva	(25,57)	2,76
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE			
AUSTRALIEN			
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE			
Pepper SPARKZ Trust 4,062 % fällig am 17.08.2028	AUD 542	\$ 367	0,05
NON-AGENCY-MBS			
Pepper Residential Securities Trust 4,210 % fällig am 16.09.2059	327	221	0,03
RESIMAC Bastille Trust 5,102 % fällig am 05.09.2057	\$ 211	211	0,03
		432	0,06
STAATSEMISSIONEN			
Australia Government International Bond 0,500 % fällig am 21.09.2026	AUD 12.200	7.392	1,03
1,000 % fällig am 21.12.2030	1.100	596	0,08
1,000 % fällig am 21.11.2031	1.200	631	0,09
1,250 % fällig am 21.05.2032	900	479	0,07
1,750 % fällig am 21.06.2051	1.300	511	0,07
2,500 % fällig am 21.05.2030	800	493	0,07
4,500 % fällig am 21.04.2033	3.900	2.744	0,39
		12.846	1,80
Summe Australien		13.645	1,91
BRASILIEN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Banco Bradesco S.A. 2,850 % fällig am 27.01.2023	\$ 1.500	1.498	0,21
KANADA			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Fairfax Financial Holdings Ltd. 2,750 % fällig am 29.03.2028	€ 1.600	1.494	0,21
NON-AGENCY-MBS			
Real Estate Asset Liquidity Trust 3,072 % fällig am 12.08.2053	CAD 501	367	0,05
STAATSEMISSIONEN			
Canada Government International Bond 2,000 % fällig am 01.12.2051	6.800	3.816	0,53
2,750 % fällig am 01.12.2048	400	267	0,04
Canadian Government Real Return Bond 1,500 % fällig am 01.12.2044 (e)	931	715	0,10
Ontario Teachers' Finance Trust 0,900 % fällig am 20.05.2041	€ 700	482	0,07
1,850 % fällig am 03.05.2032	3.300	3.034	0,42
Province of Ontario 0,010 % fällig am 25.11.2030	2.300	1.880	0,26
		10.194	1,42
Summe Kanada		12.055	1,68
KAIMANINSELN			
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE			
Apidos CLO 5,253 % fällig am 20.04.2031	\$ 2.400	2.366	0,33
BlueMountain CLO Ltd. 5,159 % fällig am 15.07.2031	2.000	1.967	0,27
Catamaran CLO Ltd. 5,425 % fällig am 22.04.2030	2.587	2.550	0,36
CBAM CLO Ltd. 5,099 % fällig am 17.04.2031	2.000	1.964	0,27
LCM LP 5,283 % fällig am 20.10.2027	625	622	0,09
Marathon CLO Ltd. 5,545 % fällig am 21.11.2027	32	32	0,00
Regatta Funding Ltd. 5,329 % fällig am 17.10.2030	1.100	1.088	0,15
TIAA CLO Ltd. 5,443 % fällig am 20.07.2031	2.200	2.164	0,30
Venture CLO Ltd. 4,959 % fällig am 15.04.2027	342	341	0,05
5,293 % fällig am 20.07.2030	2.498	2.441	0,34

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Voya CLO Ltd. 5,289 % fällig am 15.10.2030	\$ 1.793	\$ 1.773	0,25
		17.308	2,41
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
KSA Sukuk Ltd. 5,268 % fällig am 25.10.2028	800	832	0,12
QNB Finance Ltd. 1,375 % fällig am 26.01.2026	200	179	0,02
S.A. Global Sukuk Ltd. 2,694 % fällig am 17.06.2031	600	514	0,07
Sands China Ltd. 5,625 % fällig am 08.08.2025	500	479	0,07
5,900 % fällig am 08.08.2028	900	844	0,12
Tencent Holdings Ltd. 3,595 % fällig am 19.01.2028	200	184	0,03
U.S. Capital Funding Ltd. 5,190 % fällig am 01.08.2034	174	172	0,02
		3.204	0,45
Summe Kaimaninseln		20.512	2,86
CHINA			
STAATSEMISSIONEN			
China Development Bank 4,040 % fällig am 10.04.2027	CNY 1.580	238	0,03
China Government Bond 2,370 % fällig am 20.01.2027	25.000	3.565	0,50
3,010 % fällig am 13.05.2028	13.300	1.942	0,27
3,530 % fällig am 18.10.2051	29.100	4.401	0,62
3,720 % fällig am 12.04.2051	9.300	1.450	0,20
3,810 % fällig am 14.09.2050	24.300	3.839	0,54
Summe China		15.435	2,16
DÄNEMARK			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Jyske Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK 39.762	4.014	0,56
1,500 % fällig am 01.10.2037	0	0	0,00
1,500 % fällig am 01.10.2050	0	0	0,00
1,500 % fällig am 01.10.2053	2.087	218	0,03
2,000 % fällig am 01.10.2047	0	0	0,00
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab 1,000 % fällig am 01.10.2050	51.169	5.271	0,74
1,500 % fällig am 01.10.2037	0	0	0,00
1,500 % fällig am 01.10.2050	0	0	0,00
1,500 % fällig am 01.10.2053	6.051	670	0,09
2,000 % fällig am 01.10.2047	0	0	0,00
2,500 % fällig am 01.10.2047	0	0	0,00
Nykredit Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.10.2050	41.076	4.330	0,60
1,500 % fällig am 01.10.2037	0	0	0,00
1,500 % fällig am 01.10.2050	0	0	0,00
1,500 % fällig am 01.10.2053	23.308	2.474	0,35
2,000 % fällig am 01.10.2047	0	0	0,00
2,000 % fällig am 01.10.2050	0	0	0,00
2,500 % fällig am 01.10.2036	0	0	0,00
2,500 % fällig am 01.10.2047	0	0	0,00
Realkredit Danmark A/S 1,000 % fällig am 01.10.2050	13.729	1.454	0,20
2,000 % fällig am 01.10.2047	0	0	0,00
2,000 % fällig am 01.10.2053	0	0	0,00
2,500 % fällig am 01.04.2036	0	0	0,00
2,500 % fällig am 01.04.2047	0	0	0,00
Summe Dänemark		18.431	2,57
FRANKREICH			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
BNP Paribas S.A. 1,675 % fällig am 30.06.2027	\$ 1.300	1.133	0,16
2,159 % fällig am 15.09.2029	1.300	1.062	0,15
2,591 % fällig am 20.01.2028	1.200	1.057	0,15
Societe Generale S.A. 1,488 % fällig am 14.12.2026	700	609	0,08
2,797 % fällig am 19.01.2028	700	613	0,09
3,337 % fällig am 21.01.2033	2.100	1.659	0,23
		6.133	0,86

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
STAATSEMISSIONEN			
Agence Francaise de Developpement 1,125 % fällig am 02.03.2037	€ 2.900	\$ 2.202	0,31
France Government International Bond 0,500 % fällig am 25.05.2072	900	358	0,05
0,750 % fällig am 25.05.2052	8.600	4.847	0,68
2,000 % fällig am 25.05.2048	11.500	9.488	1,32
3,250 % fällig am 25.05.2045	200	211	0,03
		17.106	2,39
Summe Frankreich		23.239	3,25
DEUTSCHLAND			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Deutsche Bank AG 0,050 % fällig am 20.11.2024	4.900	4.909	0,69
1,000 % fällig am 19.11.2025	200	199	0,03
1,375 % fällig am 03.09.2026	3.400	3.311	0,46
1,375 % fällig am 17.02.2032	1.500	1.168	0,16
1,625 % fällig am 20.01.2027	3.300	3.111	0,43
1,750 % fällig am 19.11.2030	1.000	840	0,12
3,729 % fällig am 14.01.2032 (j)	\$ 300	221	0,03
3,961 % fällig am 26.11.2025	900	861	0,12
IHO Verwaltungs GmbH (3,625 % bar oder 4,375 % PIK) 3,625 % fällig am 15.05.2025 (b)	€ 1.300	1.269	0,18
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 5,000 % fällig am 19.03.2024	AUD 100	69	0,01
Landwirtschaftliche Rentenbank 4,250 % fällig am 24.01.2023	1.500	1.018	0,14
5,375 % fällig am 23.04.2024	NZD 1.100	694	0,10
Summe Deutschland		17.670	2,47
HONGKONG			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Vanke Real Estate Hong Kong Co. Ltd. 6,307 % fällig am 25.05.2023	\$ 600	596	0,08
UNGARN			
STAATSEMISSIONEN			
Hungary Government International Bond 5,000 % fällig am 22.02.2027	€ 200	212	0,03
IRLAND			
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE			
Accunia European CLO DAC 2,328 % fällig am 15.07.2030	713	746	0,10
Armada Euro CLO DAC 2,098 % fällig am 15.07.2031	800	829	0,12
Aurium CLO DAC 2,108 % fällig am 16.01.2031	2.099	2.191	0,31
Black Diamond CLO DAC 2,778 % fällig am 15.05.2032	2.400	2.483	0,35
2,834 % fällig am 03.10.2029	57	61	0,01
BNPP AM Euro CLO DAC 2,322 % fällig am 22.07.2032	2.200	2.275	0,32
Cairn CLO DAC 2,158 % fällig am 15.10.2031	850	888	0,12
2,178 % fällig am 30.04.2031	1.579	1.644	0,23
Carlyle Euro CLO DAC 2,078 % fällig am 15.01.2031	1.499	1.561	0,22
Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC 2,338 % fällig am 16.01.2033	1.900	1.953	0,27
Dryden Euro CLO DAC 2,038 % fällig am 15.04.2033	1.200	1.243	0,17
2,622 % fällig am 15.05.2034	1.200	1.245	0,17
GoldenTree Loan Management EUR CLO DAC 2,356 % fällig am 20.01.2032	2.000	2.064	0,29
Griffith Park CLO DAC 2,522 % fällig am 21.11.2031	1.000	1.033	0,14
Harvest CLO DAC 2,136 % fällig am 20.10.2031	1.000	1.037	0,15
2,138 % fällig am 15.07.2031	2.100	2.164	0,30
2,228 % fällig am 15.01.2032	2.100	2.172	0,30
2,433 % fällig am 18.11.2029	337	355	0,05
Jubilee CLO DAC 1,978 % fällig am 15.04.2030	1.200	1.253	0,18

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond Ex-US Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
2,028 % fällig am 15.04.2031 €	800	\$ 814	0,11
2,128 % fällig am 12.07.2028	70	74	0,01
2,846 % fällig am 15.12.2029	311	326	0,05
Laurelin DAC 2,176 % fällig am 20.10.2031	2.100	2.173	0,30
Madison Park Euro Funding DAC 2,178 % fällig am 15.07.2032	2.200	2.275	0,32
Oak Hill European Credit Partners DAC 2,196 % fällig am 20.10.2031	2.200	2.278	0,32
Palmer Square European Loan Funding DAC 2,098 % fällig am 15.10.2031	2.494	2.581	0,36
Sculptor European CLO DAC 2,153 % fällig am 14.01.2032	2.100	2.181	0,30
Segovia European CLO DAC 2,336 % fällig am 20.07.2032	2.000	2.067	0,29
Toro European CLO DAC 2,572 % fällig am 15.02.2034	2.200	2.265	0,32
		44.231	6,18
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
AerCap Ireland Capital DAC 1,150 % fällig am 29.10.2023	\$ 600	577	0,08
1,650 % fällig am 29.10.2024	500	462	0,06
1,750 % fällig am 29.10.2024	500	460	0,06
Bank of Ireland Group PLC 1,875 % fällig am 05.06.2026	€ 900	893	0,13
		2.392	0,33
Summe Irland		46.623	6,51
ISRAEL STAATSEMISSIONEN			
Israel Government International Bond 0,150 % fällig am 31.07.2023	ILS 13.100	3.640	0,51
1,500 % fällig am 30.11.2023	11.000	3.059	0,43
2,000 % fällig am 31.03.2027	7.600	2.013	0,28
Summe Israel		8.712	1,22
ITALIEN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
AMCO - Asset Management Co. SpA 1,500 % fällig am 17.07.2023	€ 2.000	2.114	0,30
Atlantia SpA 1,875 % fällig am 12.02.2028	600	534	0,07
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 0,875 % fällig am 08.10.2027	200	190	0,03
2,000 % fällig am 29.01.2024	2.200	2.307	0,32
2,625 % fällig am 28.04.2025	100	97	0,01
UniCredit SpA 7,500 % fällig am 03.06.2026 (fj/h)	1.000	1.041	0,15
7,830 % fällig am 04.12.2023	\$ 2.800	2.829	0,39
		9.112	1,27
STAATSEMISSIONEN			
Italy Government International Bond 6,000 % fällig am 04.08.2028	£ 100	121	0,02
Summe Italien		9.233	1,29
JAPAN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Mizuho Financial Group, Inc. 3,922 % fällig am 11.09.2024	\$ 1.000	984	0,14
5,735 % fällig am 11.09.2024	1.500	1.496	0,21
Nissan Motor Co. Ltd. 3,522 % fällig am 17.09.2025	200	186	0,02
4,345 % fällig am 17.09.2027	1.400	1.272	0,18
4,810 % fällig am 17.09.2030	1.000	851	0,12
Sumitomo Mitsui Banking Corp. 0,409 % fällig am 07.11.2029	€ 1.800	1.551	0,22
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd. 0,010 % fällig am 15.10.2027	2.000	1.799	0,25
		8.139	1,14
STAATSEMISSIONEN			
Japan Finance Organization for Municipalities 3,375 % fällig am 27.09.2023	\$ 1.800	1.777	0,25

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Japan Government International Bond 0,100 % fällig am 01.03.2023	¥ 38.000	\$ 288	0,04
0,100 % fällig am 10.03.2028 (e)	806.868	6.326	0,88
0,500 % fällig am 20.03.2049	976.000	5.793	0,81
0,700 % fällig am 20.12.2048	1.118.000	7.023	0,98
0,700 % fällig am 20.09.2051	730.000	4.435	0,62
Tokyo Metropolitan Government 0,750 % fällig am 16.07.2025	\$ 800	721	0,10
2,625 % fällig am 29.05.2024	400	387	0,05
		26.750	3,73
Summe Japan		34.889	4,87
LUXEMBURG UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Aroundtown S.A. 0,000 % fällig am 16.07.2026 (c)	€ 700	533	0,07
0,375 % fällig am 15.04.2027	100	71	0,01
CPI Property Group S.A. 2,750 % fällig am 12.05.2026	2.100	1.765	0,25
Cromwell Ereit Lux Finco SARL 2,125 % fällig am 19.11.2025	500	431	0,06
Logicor Financing SARL 0,625 % fällig am 17.11.2025	1.400	1.280	0,18
		4.080	0,57
NON-AGENCY-MBS			
Miravet SARL 2,758 % fällig am 26.05.2065	967	998	0,14
Summe Luxemburg		5.078	0,71
MALAYSIA UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Petronas Capital Ltd. 2,480 % fällig am 28.01.2032	\$ 400	332	0,05
3,500 % fällig am 21.04.2030	400	366	0,05
4,550 % fällig am 21.04.2050	300	269	0,04
4,800 % fällig am 21.04.2060	300	276	0,04
		1.243	0,18
STAATSEMISSIONEN			
Malaysia Government International Bond 3,480 % fällig am 15.03.2023	MYR 22.800	5.181	0,72
Malaysia Government Investment Issue 3,151 % fällig am 15.05.2023	600	136	0,02
		5.317	0,74
Summe Malaysia		6.560	0,92
MEXIKO STAATSEMISSIONEN			
Mexico Government International Bond 4,000 % fällig am 15.03.2115	€ 400	301	0,04
MULTINATIONAL UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Preferred Term Securities Ltd. 5,138 % fällig am 23.06.2035	\$ 855	811	0,11
NIEDERLANDE UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Coöperatieve Rabobank UA 3,758 % fällig am 06.04.2033	600	513	0,07
CTP NV 0,625 % fällig am 27.09.2026	€ 600	493	0,07
0,875 % fällig am 20.01.2026	900	783	0,11
1,500 % fällig am 27.09.2031	600	385	0,05
Enel Finance International NV 1,875 % fällig am 12.07.2028	\$ 800	637	0,09
2,650 % fällig am 10.09.2024	1.100	1.053	0,15
ING Groep NV 2,125 % fällig am 23.05.2026	€ 400	407	0,06

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Volkswagen Financial Services NV 1,125 % fällig am 18.09.2023	£ 200	\$ 235	0,03
		4.506	0,63
NON-AGENCY-MBS			
Jubilee Place BV 2,378 % fällig am 17.10.2057	€ 986	1.044	0,14
Summe Niederlande		5.550	0,77
NEUSEELAND STAATSEMISSIONEN			
New Zealand Government International Bond 1,500 % fällig am 15.05.2031	NZD 1.300	655	0,09
NORWEGEN STAATSEMISSIONEN			
Kommunalbanken A/S 1,900 % fällig am 19.01.2027	AUD 1.600	982	0,14
Norway Government International Bond 1,750 % fällig am 13.03.2025	NOK 6.300	622	0,08
Summe Norwegen		1.604	0,22
PERU UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Banco de Credito del Peru S.A. 4,650 % fällig am 17.09.2024	PEN 2.400	588	0,08
STAATSEMISSIONEN			
Peru Government International Bond 5,350 % fällig am 12.08.2040	1.900	373	0,05
5,940 % fällig am 12.02.2029	9.700	2.336	0,33
6,150 % fällig am 12.08.2032	2.000	462	0,06
6,350 % fällig am 12.08.2028	17.400	4.341	0,61
6,950 % fällig am 12.08.2031	2.200	545	0,08
		8.057	1,13
Summe Peru		8.645	1,21
POLEN STAATSEMISSIONEN			
Poland Government International Bond 5,500 % fällig am 16.11.2027	\$ 200	206	0,03
PORTUGAL UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Banco Espírito Santo S.A. 4,000 % fällig am 21.01.2019 ^	€ 400	62	0,01
4,750 % fällig am 15.01.2018 ^	700	108	0,01
EDP - Energias de Portugal S.A. 2,375 % fällig am 27.11.2023	800	850	0,12
Summe Portugal		1.020	0,14
KATAR UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
QatarEnergy Trading LLC 2,250 % fällig am 12.07.2031	\$ 400	332	0,05
RUMÄNIEN STAATSEMISSIONEN			
Romania Government International Bond 1,375 % fällig am 02.12.2029	€ 630	491	0,07
1,750 % fällig am 13.07.2030	1.000	746	0,10
2,000 % fällig am 28.01.2032	600	429	0,06
2,000 % fällig am 14.04.2033	700	481	0,07
2,124 % fällig am 16.07.2031	400	296	0,04
2,625 % fällig am 02.12.2040	600	359	0,05
2,875 % fällig am 13.04.2042	800	480	0,07
3,750 % fällig am 07.02.2034	800	639	0,09
Summe Rumänien		3.921	0,55
SERBIEN STAATSEMISSIONEN			
Serbia Government International Bond 1,000 % fällig am 23.09.2028	1.700	1.308	0,18

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DE NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DE NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DE NETTO- VERMÖ- GENS				
2,050 % fällig am 23.09.2036	€	900		4,282 % fällig am 09.01.2028	\$	450	0,05	RMAC PLC							
Summe Serbien		1.853	0,26	4,550 % fällig am 17.04.2026		750	0,09	4,206 % fällig am 12.06.2046	€	888	\$ 1.063	0,15			
SLOWENIEN				THAILAND				AKTIEN							
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				STAATSEMISSIONEN				VORZUGSWERTPAPIERE							
Nova Kreditna Banka Maribor d.d.				Thailand Government International Bond				Nationwide Building Society							
1,875 % fällig am 27.01.2025	700	678	0,10	3,390 % fällig am 17.06.2037	THB	15.276	0,06	10,250 %	2.470	372	0,05				
Nova Ljubljanska Banka d.d.				3,450 % fällig am 17.06.2043		109.900	0,45	Summe Thailand		3.681	0,51				
3,400 % fällig am 05.02.2030	1.000	885	0,12	Summe Thailand				Summe Thailand		3.681	0,51				
Summe Slowenien		1.563	0,22	VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE				STAATSEMISSIONEN							
SÜDKOREA				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNited Kingdom Gilt							
STAATSEMISSIONEN				MDGH GMTN RSC Ltd.				0,625 % fällig am 22.10.2050							
South Korea Government International Bond				5,500 % fällig am 28.04.2033	\$	500	0,07	€	2.700	1.452	0,20				
2,125 % fällig am 10.06.2027	KRW	2.095.000	1,545	GROSSBRITANNIEN				1,250 % fällig am 31.07.2051		3.500	2,277	0,32			
2,375 % fällig am 10.12.2027		2.480.000	1,837	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				1,500 % fällig am 31.07.2053		1.600	1,105	0,16			
2,375 % fällig am 10.12.2028		10.348.000	7,590	Barclays PLC				1,750 % fällig am 22.01.2049		2.200	1,695	0,24			
2,625 % fällig am 10.06.2028		4.190.000	3,128	4,375 % fällig am 12.01.2026				2,250 % fällig am 22.01.2044		1.700	1,818	0,25			
5,500 % fällig am 10.03.2028		2.480.000	2,119	FCE Bank PLC				4,250 % fällig am 07.12.2040		1.700	2,096	0,29			
Summe Südkorea		16.219	2,27	1,615 % fällig am 11.05.2023				Summe Großbritannien		66.432	9,28				
SPANIEN				VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE				USA							
FÖRDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				FÖRDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE							
BBVA Consumer Auto				MDGH GMTN RSC Ltd.				Amortizing Residential Collateral Trust							
0,270 % fällig am 20.07.2031	€	534	558	5,000 % fällig am 28.04.2033	\$	500	0,07	5,089 % fällig am 25.10.2031	\$	2	2	0,00			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				GROSSBRITANNIEN				Asset-Backed Funding Certificates Trust							
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.				Barclays PLC				5,089 % fällig am 25.06.2034							
5,875 % fällig am 24.09.2023 (f)(h)	1.000	1.028	0,14	4,375 % fällig am 12.01.2026				96	90	0,01					
Banco Santander S.A.				FCE Bank PLC				Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust							
1,849 % fällig am 25.03.2026	\$	200	177	1,615 % fällig am 11.05.2023				€	400	423	0,06	5,004 % fällig am 25.02.2036	2.436	2,364	0,33
3,848 % fällig am 12.04.2023		400	398	GSK Consumer Healthcare Capital UK PLC				5,389 % fällig am 25.10.2037				11	11	0,00	
CaixaBank S.A.				3,125 % fällig am 24.03.2025				Citigroup Mortgage Loan Trust							
1,750 % fällig am 24.10.2023	€	900	950	HSBC Holdings PLC				4,549 % fällig am 25.12.2036				1.790	1,009	0,14	
3,625 % fällig am 14.09.2028 (f)(h)		1.800	1.357	2,251 % fällig am 22.11.2027				Countrywide Asset-Backed Certificates							
Summe Spanien			3,910	2,804 % fällig am 24.05.2032				5,069 % fällig am 25.12.2036				10	7	0,00	
STAATSEMISSIONEN				Nationwide Building Society				Countrywide Asset-Backed Certificates Trust							
Autonomous Community of Catalonia				3,766 % fällig am 08.03.2024				4,529 % fällig am 25.07.2037				1.279	1,172	0,16	
4,220 % fällig am 26.04.2035	400	415	0,06	NatWest Markets PLC				4,529 % fällig am 25.07.2037				372	336	0,05	
Spain Government International Bond				1,000 % fällig am 28.05.2024				Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.							
1,450 % fällig am 31.10.2071	2.200	1.077	0,15	Santander UK Group Holdings PLC				4,598 % fällig am 25.01.2032				2	2	0,00	
1,900 % fällig am 31.10.2052		300	204	4,796 % fällig am 15.11.2024				Home Equity Mortgage Trust							
3,450 % fällig am 30.07.2066		4.200	3,964	Standard Chartered PLC				6,000 % fällig am 25.01.2037				262	245	0,03	
5,250 % fällig am 06.04.2029	£	500	619	1,822 % fällig am 23.11.2025				IndyMac Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust							
Summe Spanien			6,279	2,678 % fällig am 29.06.2032				4,069 % fällig am 25.03.2035				2.012	1,917	0,27	
SUPRANATIONAL				Tesco Property Finance PLC				Long Beach Mortgage Loan Trust							
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				5,744 % fällig am 13.04.2040				4,689 % fällig am 25.05.2036				1.148	668	0,09	
Europäische Bank für Wiederaufbau und Entwicklung				TP ICAP Finance PLC				Massachusetts Educational Financing Authority							
0,500 % fällig am 21.12.2023	AUD	3.100	2,028	2,625 % fällig am 18.11.2028				5,308 % fällig am 25.04.2038				104	104	0,01	
Europäische Investitionsbank				Avon Finance PLC				MASTR Asset-Backed Securities Trust							
0,500 % fällig am 21.07.2023		1.200	799	4,331 % fällig am 20.09.2048				4,629 % fällig am 25.10.2036				2.075	1,847	0,26	
Inter-American Development Bank				Canada Square Funding PLC				4,709 % fällig am 25.08.2036				5.169	1,850	0,26	
2,500 % fällig am 14.04.2027		1.300	817	4,205 % fällig am 17.06.2058				Merrill Lynch Mortgage Investors Trust							
Summe Supranational			3,644	Eurosaill PLC				4,549 % fällig am 25.09.2037				4	1	0,00	
SCHWEDEN				Finsbury Square PLC				Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust							
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				4,419 % fällig am 16.12.2069				4,489 % fällig am 25.11.2036				1.153	695	0,10	
EQT AB				Genesis Mortgage Funding PLC				4,639 % fällig am 25.07.2036				100	84	0,01	
2,375 % fällig am 06.04.2028	€	700	658	4,603 % fällig am 15.09.2059				New Century Home Equity Loan Trust							
Summe Schweden				Mansard Mortgages PLC				3,740 % fällig am 20.06.2031				271	233	0,03	
SCHWEIZ				4,172 % fällig am 15.12.2049				Option One Mortgage Loan Trust							
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Newgate Funding PLC				4,529 % fällig am 25.01.2037				579	388	0,05	
Credit Suisse AG				2,646 % fällig am 15.12.2050				4,529 % fällig am 25.02.2037				2.099	1,412	0,20	
3,625 % fällig am 09.09.2024	\$	500	467	Polaris PLC				Residential Asset Securities Corp. Trust							
6,500 % fällig am 08.08.2023 (h)		700	679	4,222 % fällig am 23.12.2058				5,049 % fällig am 25.11.2035				61	61	0,01	
Credit Suisse Group AG				Ripon Mortgages PLC				Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust							
3,800 % fällig am 09.06.2023		1.800	1,753	4,011 % fällig am 28.08.2056				4,509 % fällig am 25.12.2036				14	3	0,00	
3,869 % fällig am 12.01.2029		1.150	924												

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond Ex-US Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
SLC Student Loan Trust 5,574 % fällig am 25.11.2042	\$ 494	\$ 491	0,07	Morgan Stanley 2,630 % fällig am 18.02.2026	\$ 1.300	\$ 1.222	0,17	Countrywide Alternative Loan Trust 3,435 % fällig am 25.02.2037 ^	\$ 121	\$ 103	0,02
Soundview Home Loan Trust 4,794 % fällig am 25.12.2036	3.000	2.899	0,41	2,950 % fällig am 07.05.2032	€ 700	664	0,09	3,548 % fällig am 25.11.2035	61	51	0,01
4,889 % fällig am 25.11.2036	2.222	2.060	0,29	ONEOK, Inc. 4,550 % fällig am 15.07.2028	\$ 300	284	0,04	4,088 % fällig am 25.11.2035	24	21	0,00
5,094 % fällig am 25.11.2035	299	291	0,04	Oracle Corp. 2,300 % fällig am 25.03.2028 (j)	2.400	2.083	0,29	4,098 % fällig am 20.10.2035	1.179	812	0,11
Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust 5,620 % fällig am 25.04.2035	39	38	0,01	2,875 % fällig am 25.03.2031 (j)	600	499	0,07	4,533 % fällig am 20.02.2047 ^	758	575	0,08
Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust 4,734 % fällig am 25.01.2037	2.286	2.189	0,31	3,950 % fällig am 25.03.2051 (j)	100	72	0,01	4,663 % fällig am 20.07.2046 ^	193	144	0,02
		23.417	3,27	4,100 % fällig am 25.03.2061 (j)	700	489	0,07	4,739 % fällig am 25.05.2037 ^	67	25	0,00
				Organon & Co. 4,125 % fällig am 30.04.2028	400	355	0,05	5,250 % fällig am 25.06.2035 ^	19	15	0,00
				5,125 % fällig am 30.04.2031	500	434	0,06	5,929 % fällig am 25.11.2035	140	111	0,02
				Pacific Gas & Electric Co. 2,100 % fällig am 01.08.2027	100	86	0,01	6,000 % fällig am 25.07.2037	2.003	1.068	0,15
				2,950 % fällig am 01.03.2026 ^	100	92	0,01	6,250 % fällig am 25.08.2037 ^	54	29	0,00
				3,150 % fällig am 01.01.2026	100	93	0,01	6,500 % fällig am 25.06.2036 ^	155	78	0,01
				3,450 % fällig am 01.07.2025	100	95	0,01	Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust 3,680 % fällig am 25.08.2034 ^	1	1	0,00
				3,950 % fällig am 01.12.2047 ^	100	68	0,01	3,792 % fällig am 25.11.2034	5	5	0,00
				4,250 % fällig am 15.03.2046 ^	300	210	0,03	4,849 % fällig am 25.05.2035	21	17	0,00
				4,300 % fällig am 15.03.2045 ^	100	71	0,01	5,029 % fällig am 25.03.2035	96	80	0,01
				4,550 % fällig am 01.07.2030	200	182	0,03	5,049 % fällig am 25.02.2035	52	47	0,01
				Penske Truck Leasing Co. LP 3,950 % fällig am 10.03.2025	1.500	1.446	0,20	5,149 % fällig am 25.09.2034	5	5	0,00
				Southern California Edison Co. 0,700 % fällig am 03.04.2023	500	495	0,07	6,000 % fällig am 25.02.2037	936	475	0,07
				4,963 % fällig am 03.04.2023	200	200	0,03	Countrywide Home Loan Reperforming REMIC Trust 4,729 % fällig am 25.06.2035	114	108	0,02
				5,153 % fällig am 01.04.2024	500	497	0,07	Deutsche ALT-A Securities Mortgage Loan Trust 4,629 % fällig am 25.08.2036 ^	411	369	0,05
				WEA Finance LLC 3,750 % fällig am 17.09.2024	600	567	0,08	Deutsche ALT-B Securities Mortgage Loan Trust 4,489 % fällig am 25.10.2036 ^	4	3	0,00
				Wells Fargo & Co. 3,526 % fällig am 24.03.2028	700	649	0,09	Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust 4,859 % fällig am 19.08.2045	50	42	0,01
				3,908 % fällig am 25.04.2026	800	778	0,11	4,979 % fällig am 19.07.2045 ^	3	0	0,00
						39.153	5,47	First Horizon Mortgage Pass-Through Trust 3,875 % fällig am 25.08.2035	14	9	0,00
								GreenPoint Mortgage Funding Trust 4,929 % fällig am 25.11.2045	15	13	0,00
								GSR Mortgage Loan Trust 2,880 % fällig am 25.03.2033	4	4	0,00
								HarborView Mortgage Loan Trust 2,898 % fällig am 19.12.2036 ^	119	98	0,01
								4,048 % fällig am 19.10.2035	387	221	0,03
								Impac CMB Trust 5,389 % fällig am 25.07.2033	1	1	0,00
								IndyMac Mortgage Loan Trust 3,014 % fällig am 25.03.2036	511	349	0,05
								3,837 % fällig am 25.12.2034	8	8	0,00
								JPMorgan Alternative Loan Trust 4,869 % fällig am 25.10.2036	272	239	0,03
								5,500 % fällig am 25.11.2036 ^	2	1	0,00
								JPMorgan Mortgage Trust 3,062 % fällig am 25.11.2033	5	4	0,00
								3,196 % fällig am 27.07.2037	177	161	0,02
								3,478 % fällig am 25.02.2036 ^	95	71	0,01
								MASTR Alternative Loan Trust 4,789 % fällig am 25.03.2036 ^	87	10	0,00
								Mellon Residential Funding Corp. Mortgage Pass-Through Trust 4,758 % fällig am 15.12.2030	11	10	0,00
								Merrill Lynch Alternative Note Asset Trust 4,609 % fällig am 25.03.2037	6.116	1.759	0,25
								Residential Accredit Loans, Inc. Trust 3,483 % fällig am 25.11.2037	721	586	0,08
								4,539 % fällig am 25.02.2047	166	61	0,01
								4,689 % fällig am 25.06.2037 ^	317	283	0,04
								4,709 % fällig am 25.03.2047	731	643	0,09
								4,749 % fällig am 25.07.2036 ^	1.099	467	0,07
								4,749 % fällig am 25.06.2046	792	185	0,03
								5,189 % fällig am 25.10.2045	64	52	0,01
								6,000 % fällig am 25.06.2036	385	311	0,04
								Residential Funding Mortgage Securities, Inc. Trust 3,910 % fällig am 25.09.2035 ^	38	24	0,00
								6,500 % fällig am 25.03.2032	0	0	0,00
								Sequoia Mortgage Trust 3,194 % fällig am 20.07.2037	492	395	0,06
								5,053 % fällig am 20.07.2033	15	14	0,00
								Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust 3,780 % fällig am 25.02.2034	13	12	0,00
								3,957 % fällig am 25.04.2034	15	15	0,00

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Structured Asset Mortgage Investments Trust				Ginnie Mae				JAPAN TREASURY BILLS			
4,709 % fällig am 25.01.2037	\$ 1.103	\$ 956	0,13	3,000 % fällig am 20.07.2046 - 20.05.2047	\$ 25	\$ 24	0,00	(0,256) % fällig am 11.01.2023 (c)(d)	¥ 3.004.300	\$ 22.770	3,18
4,769 % fällig am 25.07.2046 ^	344	239	0,03	Uniform Mortgage-Backed Security				(0,249) % fällig am 11.01.2023 (c)(d)	1.000	8	0,00
4,809 % fällig am 25.05.2036	130	98	0,01	2,500 % fällig am 01.02.2051 - 01.01.2052	2.829	2.404	0,34	(0,242) % fällig am 23.01.2023 (c)(d)	9.000	68	0,01
4,829 % fällig am 25.05.2036	648	496	0,07	3,000 % fällig am 01.04.2043 - 01.06.2051	1.938	1.718	0,24	(0,228) % fällig am 11.01.2023 (c)(d)	2.325.700	17.627	2,46
4,919 % fällig am 19.07.2034	6	6	0,00	3,500 % fällig am 01.10.2034 - 01.07.2050	1.548	1.439	0,20	(0,209) % fällig am 06.01.2023 (c)(d)	1.231.000	9.330	1,30
5,039 % fällig am 19.03.2034	3	3	0,00	4,000 % fällig am 01.06.2050	750	710	0,10	(0,205) % fällig am 16.01.2023 (c)(d)	1.360.000	10.308	1,44
Structured Asset Securities Corp.				Uniform Mortgage-Backed Security, TBA				(0,191) % fällig am 23.01.2023 (c)(d)	459.000	3.479	0,49
4,669 % fällig am 25.01.2036	165	158	0,02	3,000 % fällig am 01.02.2053	23.500	20.647	2,88	(0,190) % fällig am 06.01.2023 (c)(d)	1.180.000	8.944	1,25
Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust				3,500 % fällig am 01.02.2053	16.300	14.820	2,07	(0,162) % fällig am 23.01.2023 (c)(d)	135.000	1.023	0,14
4,679 % fällig am 25.10.2036	475	416	0,06	4,000 % fällig am 01.03.2053	22.400	21.021	2,94	(0,160) % fällig am 23.01.2023 (c)(d)	1.907.000	14.454	2,02
Thornburg Mortgage Securities Trust				Uniform Mortgage-Backed Security, TBA				(0,151) % fällig am 23.01.2023 (c)(d)	1.028.000	7.792	1,09
6,666 % fällig am 25.06.2047 ^	89	76	0,01	3,500 % fällig am 01.02.2053	16.300	14.820	2,07	(0,147) % fällig am 06.02.2023 (c)(d)	1.929.000	14.622	2,04
Wachovia Mortgage Loan Trust				4,000 % fällig am 01.03.2053	22.400	21.021	2,94	(0,138) % fällig am 06.02.2023 (c)(d)	871.000	6.602	0,92
1,276 % fällig am 25.01.2037	1.476	586	0,08	4,500 % fällig am 01.02.2053	42.300	40.722	5,69	(0,138) % fällig am 06.03.2023 (c)(d)	312.000	2.365	0,33
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust				6,000 % fällig am 01.01.2053	5.700	5.781	0,80	(0,123) % fällig am 27.02.2023 (c)(d)	1.020.000	7.733	1,08
2,585 % fällig am 25.03.2034	1	1	0,00	Summe USA		215.726	30,13	(0,111) % fällig am 20.02.2023 (c)(d)	840.000	6.368	0,89
2,835 % fällig am 27.02.2034	7	6	0,00	US-SCHATZOBBLIGATIONEN					133.493	18,64	
3,048 % fällig am 25.02.2046	194	171	0,02	U.S. Treasury Bonds				Summe kurzfristige Instrumente	152.116	21,24	
3,240 % fällig am 25.06.2037 ^	106	93	0,01	1,625 % fällig am 15.11.2050	400	238	0,03	Summe Übertragbare Wertpapiere	\$ 737.412	102,98	
3,290 % fällig am 25.02.2037 ^	689	622	0,09	4,000 % fällig am 15.11.2052	200	201	0,03	AKTIEN			
3,342 % fällig am 25.05.2037 ^	394	343	0,05	U.S. Treasury Inflation Protected Securities (e)				INVESTMENTFONDS			
3,565 % fällig am 25.09.2036	137	117	0,02	0,125 % fällig am 15.07.2031	2.891	2.556	0,36	ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN			
5,009 % fällig am 25.01.2045	15	15	0,00	0,125 % fällig am 15.01.2032	1.182	1.037	0,14	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (f)	4.168.885	41.497	5,80
Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust				0,500 % fällig am 15.01.2028	6.402	6.023	0,84	PIMCO Specialty Funds Ireland p.l.c. - PIMCO China Bond Fund (g)	402.852	5.366	0,75
2,988 % fällig am 25.07.2046 ^	80	49	0,01	0,625 % fällig am 15.07.2032	410	376	0,05		46.863	6,55	
		19.567	2,73	1,750 % fällig am 15.01.2028	569	569	0,08	BÖRSENGEHANDELTE FONDS			
				2,375 % fällig am 15.01.2027	739	754	0,11	PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (g)	4.450	459	0,06
				2,500 % fällig am 15.01.2029	4.996	5.212	0,73	Summe Investmentfonds	\$ 47.322	6,61	
				3,875 % fällig am 15.04.2029	1.631	1.834	0,26				
				U.S. Treasury Notes							
				0,125 % fällig am 15.12.2023	300	287	0,04				
				Summe USA		19.087	2,67				
						215.726	30,13				
				KURZFRISTIGE INSTRUMENTE							
				HUNGARY TREASURY BILLS							
				18,250 % fällig am 03.01.2023 (c)(d)	HUF 2.147.000	5.722	0,80				
				ISRAEL TREASURY BILLS							
				0,011 % fällig am 04.01.2023 (c)(d)	ILS 3.800	1.076	0,15				
				0,022 % fällig am 04.01.2023 (c)(d)	7.200	2.040	0,28				
				1,184 % fällig am 02.03.2023 (c)(d)	25.600	7.212	1,01				
				1,716 % fällig am 05.07.2023 (c)(d)	2.200	612	0,09				
				1,718 % fällig am 03.05.2023 (c)(d)	7.000	1.961	0,27				
						12.901	1,80				

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft ⁽¹⁾	% des Netto- vermögens
FICC	1,900 %	30.12.2022	03.01.2023	\$ 1.625	U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 29.06.2023	\$ (1.658)	\$ 1.625	\$ 1.625	0,23
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (1.658)	\$ 1.625	\$ 1.625	0,23

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Netto- vermögens
3-Month SOFR December Futures	Short	03.2024	694	\$ 276	0,04
3-Month SOFR June Futures	Long	09.2023	418	(474)	(0,06)

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond Ex-US Fund (Forts.)

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
3-Month SOFR June Futures	Long	09.2024	347	\$ (107)	(0,01)
Australia Government 3-Year Note March Futures	Short	03.2023	56	51	0,01
Australia Government 10-Year Bond March Futures	Long	03.2023	146	(654)	(0,09)
Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 146,000 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond February 2023 Futures ⁽¹⁾	Short	01.2023	7	6	0,00
Canada Government 10-Year Bond March Futures	Short	03.2023	131	209	0,03
Euro-Bobl March Futures	Short	03.2023	296	782	0,11
Euro-BTP Italy Government Bond March Futures	Long	03.2023	94	(811)	(0,11)
Euro-BTP Italy Government Bond March Futures	Short	03.2023	190	301	0,04
Euro-Bund 10-Year Bond March Futures	Short	03.2023	38	322	0,05
Euro-Buxl 30-Year Bond March Futures	Long	03.2023	15	(409)	(0,06)
Euro-OAT France Government 10-Year Bond March Futures	Short	03.2023	255	2.459	0,34
Euro-Schatz March Futures	Long	03.2023	238	(355)	(0,05)
Japan Government 10-Year Bond March Futures	Long	03.2023	47	(964)	(0,13)
Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 138,500 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond February 2023 Futures ⁽¹⁾	Short	01.2023	7	(36)	(0,01)
U.S. Treasury 2-Year Note March Futures	Short	03.2023	148	(41)	(0,01)
U.S. Treasury 5-Year Note March Futures	Long	03.2023	439	(64)	(0,01)
U.S. Treasury 10-Year Note March Futures	Long	03.2023	25	(7)	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond March Futures	Short	03.2023	6	(5)	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond March Futures	Short	03.2023	431	373	0,05
United Kingdom Long Gilt March Futures	Short	03.2023	109	805	0,11
				\$ 1.657	0,24

⁽¹⁾ Future-Style-Option.

VERKAUFSOPTIONEN

OPTIONEN AUF BÖRSEGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
Call – CME Kaufoptionen mit Ausübungskurs von USD 98,000 auf 3-Month SOFR December Futures	\$ 98,000	15.12.2023	13	\$ (11)	\$ (1)	0,00
Put – CME Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von USD 96,500 auf 3-Month SOFR December Futures	96,500	15.12.2023	13	(12)	(40)	(0,01)
				\$ (23)	\$ (41)	(0,01)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate					\$ 1.616	0,23

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽³⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
British Telecommunications PLC	1,000 %	20.06.2028	€ 700	\$ (20)	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20.12.2024	\$ 100	(1)	0,00
Jaguar Land Rover Automotive PLC	5,000	20.06.2026	€ 500	(97)	(0,01)
Rolls-Royce PLC	1,000	20.06.2024	900	29	0,00
Stellantis NV	5,000	20.12.2026	500	(40)	(0,01)
Tesco PLC	1,000	20.06.2025	1.500	(29)	0,00
				\$ (158)	(0,02)

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF⁽²⁾

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽³⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.IG-35 10-Year Index	(1,000) %	20.12.2030	\$ 10.300	\$ 98	0,01
CDX.IG-37 10-Year Index	(1,000)	20.12.2031	16.500	101	0,01
CDX.IG-38 10-Year Index	(1,000)	20.06.2032	2.200	(13)	0,00
CDX.IG-39 10-Year Index	(1,000)	20.12.2032	60.600	(807)	(0,11)
iTraxx Europe Main 37 10-Year Index	(1,000)	20.06.2032	€ 3.000	(42)	(0,01)
iTraxx Europe Main 38 10-Year Index	(1,000)	20.12.2032	9.800	(230)	(0,03)
				\$ (893)	(0,13)

ZINSSWAPS - BASISWAPS

Zahlung variabler Zinssatzindex	Erhalt variabler Zinssatzindex	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
3-Month USD-LIBOR	1-Month USD-LIBOR + 0,070 %	07.03.2024	\$ 7.400	\$ 6	0,00
3-Month USD-LIBOR	1-Month USD-LIBOR + 0,102 %	04.10.2024	15.000	43	0,01
				\$ 49	0,01

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	0,010 %	07.02.2023	£ 34.350	\$ (686)	(0,10)
Zahlung ⁽⁴⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	2,000	15.03.2033	27.100	(70)	(0,01)
Zahlung ⁽⁴⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	2,000	15.03.2053	2.800	(15)	0,00
Zahlung ⁽⁴⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	2,250	15.03.2028	14.000	(495)	(0,07)
Zahlung ⁽⁴⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	2,500	15.03.2025	2.800	(35)	0,00
Erhalt	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	5,750	16.03.2027	INR 1.130.580	(443)	(0,06)
Zahlung	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	6,250	21.09.2023	2.356.900	(96)	(0,01)
Zahlung	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	6,250	21.09.2024	648.240	(21)	0,00
Erhalt	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	6,250	16.03.2032	116.100	(90)	(0,01)
Zahlung	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	6,500	21.09.2024	638.533	31	0,00
Erhalt	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	6,500	21.09.2027	300.100	(36)	(0,01)
Zahlung	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	6,750	21.09.2024	1.151.300	73	0,01
Erhalt	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	7,000	21.09.2027	262.600	(63)	(0,01)
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000	15.12.2023	¥ 2.430.000	(45)	(0,01)
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000	15.12.2026	970.000	(84)	(0,01)
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000	15.12.2028	10.000	(3)	0,00
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000	17.03.2031	610.000	(266)	(0,04)
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,050	15.12.2031	851.000	(251)	(0,04)
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,400	19.06.2039	540.000	554	0,08
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,400	15.12.2051	80.000	(124)	(0,02)
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,450	15.12.2051	230.000	(142)	(0,02)
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,800	15.06.2052	640.000	(302)	(0,04)
Zahlung	1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS	1,250	15.09.2031	SGD 200	(7)	0,00
Erhalt	1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS	1,250	15.09.2031	200	23	0,00
Zahlung	1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS	2,500	21.09.2027	4.300	(77)	(0,01)
Zahlung	1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS	2,750	15.06.2027	6.400	(77)	(0,01)
Zahlung	1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS	2,750	21.09.2027	18.000	(88)	(0,01)
Zahlung	1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS	3,000	15.06.2027	2.400	(9)	0,00
Zahlung	1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS	3,250	21.12.2027	470	(2)	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,000	15.06.2027	\$ 16.900	1.460	0,20
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,000	15.06.2029	37.300	(3.550)	(0,50)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,250	15.12.2028	5.600	(749)	(0,10)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,618	09.02.2029	2.700	(299)	(0,04)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,695	15.11.2031	16.600	(2.366)	(0,33)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2024	9.600	2	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2027	88.500	2.523	0,35
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2029	5.200	252	0,04
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2032	11.670	(161)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2052	1.980	52	0,01
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,888	22.03.2029	4.300	(416)	(0,06)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,175	21.04.2029	4.000	(325)	(0,05)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,750	30.04.2029	2.400	127	0,02
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,817	30.04.2029	8.300	407	0,06
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,818	30.04.2029	6.200	303	0,04
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,819	30.04.2029	4.200	205	0,03
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,906	16.09.2052	2.300	(139)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,965	30.06.2024	15.900	(428)	(0,06)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,965	30.11.2026	61.700	2.065	0,29
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,968	30.06.2024	15.900	(427)	(0,06)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,050	08.09.2029	500	(15)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,100	09.09.2029	2.100	(56)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,454	30.06.2029	5.400	(59)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,828	15.05.2032	3.600	(76)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,898	30.06.2029	5.000	72	0,01
Erhalt ⁽⁴⁾	3-Month AUD-BBR-BBSW	3,750	15.03.2024	AUD 93.200	88	0,01
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,220	03.03.2025	CAD 6.900	(402)	(0,06)
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,250	16.06.2031	5.500	(128)	(0,02)
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,500	17.06.2025	9.600	(487)	(0,07)
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,500	17.06.2030	9.200	(787)	(0,11)
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,500	16.06.2051	250	(35)	(0,01)
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,585	19.07.2031	7.100	(673)	(0,09)
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,713	02.10.2029	2.100	(178)	(0,02)
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,900	18.12.2029	24.500	(2.101)	(0,29)
Zahlung	3-Month CHF-SRFXON3 Compounded-OIS	0,283	14.02.2027	CHF 900	(55)	(0,01)
Zahlung	3-Month CHF-SRFXON3 Compounded-OIS	0,294	10.02.2027	8.500	(488)	(0,07)
Zahlung	3-Month CHF-SRFXON3 Compounded-OIS	0,343	16.05.2027	1.900	(123)	(0,02)
Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,500	16.03.2027	CNY 61.000	(97)	(0,01)
Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,500	21.12.2027	102.700	(162)	(0,02)
Zahlung	3-Month EUR-ESTRON Compounded-OIS	1,000	23.11.2024	€ 17.300	(183)	(0,03)
Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	3,000	21.09.2027	KRW 20.573.370	(394)	(0,06)
Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	3,000	15.06.2032	2.883.300	(95)	(0,01)
Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	3,250	15.06.2032	885.300	(17)	0,00
Zahlung	3-Month NZD-BBR	0,528	17.03.2024	NZD 650	(21)	0,00
Zahlung	3-Month NZD-BBR	3,000	01.11.2023	22.600	(309)	(0,04)
Zahlung	3-Month NZD-BBR	3,000	15.12.2023	24.900	(365)	(0,05)
Zahlung	3-Month NZD-BBR	3,750	15.06.2027	9.400	(169)	(0,02)
Zahlung ⁽⁴⁾	3-Month NZD-BBR	4,000	14.06.2024	32.500	(248)	(0,03)
Zahlung	3-Month SEK-STIBOR	0,500	19.06.2024	SEK 56.200	(290)	(0,04)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,400	15.01.2028	\$ 24.600	(2.883)	(0,40)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,750	16.06.2031	15.710	2.321	0,32

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond Ex-US Fund (Forts.)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,249 %	31.08.2024	\$ 11.650	\$ 922	0,13
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,250	15.12.2026	63.400	7.507	1,05
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,298	25.08.2024	10.200	817	0,11
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,500	15.12.2028	19.300	(2.801)	(0,39)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,518	20.01.2029	1.500	(194)	(0,03)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,630	20.01.2029	4.400	(541)	(0,08)
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	7,250	20.06.2023	ZAR 16.700	(67)	(0,01)
Erhalt	6-Month AUD-BBR-BBSW	1,250	17.06.2030	AUD 5.100	574	0,08
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	1,750	16.03.2027	6.600	(423)	(0,06)
Zahlung ⁽⁴⁾	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,250	15.09.2032	1.900	(28)	0,00
Zahlung ⁽⁴⁾	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,250	15.03.2033	1.600	(26)	0,00
Zahlung ⁽⁴⁾	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,500	15.09.2032	58.600	(586)	(0,08)
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	1,913	30.01.2029	CZK 24.300	(193)	(0,03)
Erhalt ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	0,054	27.05.2050	€ 450	110	0,02
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,064	17.11.2052	1.000	341	0,05
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,550	10.08.2024	900	(39)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,650	12.04.2027	2.400	(246)	(0,03)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,650	11.05.2027	1.800	(184)	(0,03)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,700	11.04.2027	1.400	(140)	(0,02)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,000	13.05.2027	2.200	(195)	(0,03)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,000	18.05.2027	1.300	(115)	(0,02)
Zahlung ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	1,500	15.03.2025	45.200	(948)	(0,13)
Zahlung ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	1,500	15.03.2028	97.000	(3.149)	(0,44)
Erhalt ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	1,500	15.03.2053	9.300	527	0,07
Zahlung ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	1,750	15.03.2033	78.650	(2.157)	(0,30)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,250	21.09.2037	8.950	(1.109)	(0,16)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,250	21.09.2042	1.260	(230)	(0,03)
Zahlung ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	19.03.2027	11.660	(14)	0,00
Erhalt ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	15.03.2033	5.200	16	0,00
Zahlung	6-Month HUF-BBR	1,500	20.03.2024	HUF 342.600	(138)	(0,02)
Zahlung	28-Day MXN-TIE	4,870	07.07.2025	MXN 86.100	(241)	(0,03)
					\$ (15.675)	(2,19)
					\$ (16.677)	(2,33)

Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate

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

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

⁽³⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert.

⁽⁴⁾ Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

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

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

OPTIONSKAUF

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Kosten	Markt- wert	% des Netto- vermögens
BOA	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,180 %	11.01.2024	3.600	\$ 103	\$ 381	0,05

OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Kosten	Markt- wert	% des Netto- vermögens
BPS	Put – OTC France Government International Bond 0,750 % fällig am 25.05.2052	€ 97,000	23.05.2025	1.600	\$ 121	\$ 654	0,09

VERKAUFSOPTIONEN

CREDIT DEFAULT SWAPTIONS AUF KREDITINDIZES

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/ -verkauf	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Netto- vermögens
GST	Put – OTC iTraxx Europe 37 5-Year Index	Verkauf	3,000 %	15.03.2023	1.800	\$ (3)	\$ 0	0,00

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Netto-vermögens
BOA	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,150 %	01.12.2023	1.900	\$ (6)	\$ (1)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	01.12.2023	1.900	(6)	(14)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,310	11.01.2024	31.500	(102)	(521)	(0,07)
	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,000	19.01.2023	500	(2)	0	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,500	19.01.2023	500	(2)	(6)	0,00
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,550	11.04.2023	3.300	(3)	0	0,00
BPS	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,100	11.04.2023	3.300	(10)	(51)	(0,01)
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,700	28.04.2023	2.100	(4)	0	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,250	28.04.2023	2.100	(4)	(30)	(0,01)
	Put – OTC 25-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,451	23.05.2025	1.600	(121)	(612)	(0,09)
	Call – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,270	23.01.2023	500	(1)	0	0,00
	Put – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,770	23.01.2023	500	(1)	(3,77)	0,00
BRC	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,000	19.01.2023	300	(1)	0	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,500	19.01.2023	300	(1)	(4)	0,00
	Call – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,200	12.01.2023	800	(2)	0	0,00
CBK	Put – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,800	12.01.2023	800	(2)	(3)	0,00
	Call – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,150	09.01.2023	2.400	(8)	0	0,00
	Put – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	09.01.2023	2.400	(8)	(15)	0,00
DUB	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,920	13.10.2023	1.100	(7)	(1)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,920	13.10.2023	1.100	(7)	(15)	0,00
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,790	08.04.2024	2.800	(22)	(8)	0,00
GLM	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,790	08.04.2024	2.800	(22)	(32)	(0,01)
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,920	13.10.2023	800	(5)	(1)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,920	13.10.2023	800	(5)	(11)	0,00
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,018	20.10.2023	800	(5)	(1)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,018	20.10.2023	800	(5)	(10)	0,00
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,140	23.10.2023	900	(6)	(1)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,140	23.10.2023	900	(6)	(11)	0,00
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,190	23.10.2023	800	(6)	(1)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,190	23.10.2023	800	(6)	(9)	0,00
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,225	23.10.2023	900	(6)	(1)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,225	23.10.2023	900	(6)	(10)	0,00
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,973	25.10.2023	1.100	(8)	(1)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,973	25.10.2023	1.100	(8)	(14)	0,00
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,841	27.10.2023	800	(5)	(1)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,841	27.10.2023	800	(5)	(11)	0,00
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,088	03.11.2023	500	(4)	(1)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,088	03.11.2023	500	(4)	(6)	0,00
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,910	10.11.2023	1.700	(11)	(2)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,910	10.11.2023	1.700	(11)	(22)	0,00
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,250	17.11.2023	3.000	(11)	(2)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	17.11.2023	3.000	(11)	(22)	0,00
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,150	20.11.2023	1.500	(5)	(1)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	20.11.2023	1.500	(5)	(12)	0,00
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,250	07.12.2023	1.400	(4)	(1)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	07.12.2023	1.400	(4)	(10)	0,00
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,697	02.04.2024	3.400	(27)	(10)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,697	02.04.2024	3.400	(27)	(43)	(0,01)
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,721	08.04.2024	900	(7)	(3)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,721	08.04.2024	900	(7)	(11)	0,00
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,550	05.04.2023	6.500	(12)	0	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,100	05.04.2023	6.500	(12)	(100)	(0,02)
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,550	11.04.2023	11.400	(22)	0	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,100	11.04.2023	11.400	(22)	(178)	(0,03)
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,700	24.04.2023	1.600	(2)	0	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,250	24.04.2023	1.600	(5)	(23)	0,00
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,700	26.04.2023	2.200	(4)	0	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,250	26.04.2023	2.200	(4)	(31)	(0,01)
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,550	15.05.2023	4.000	(7)	0	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,100	15.05.2023	4.000	(7)	(64)	(0,01)
	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,067	09.06.2023	2.000	(23)	(5)	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	3,140	09.06.2023	2.000	(28)	(66)	(0,01)
	Call – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,230	23.01.2023	1.900	(5)	(1)	0,00
JPM	Put – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,730	23.01.2023	1.900	(5)	(11)	0,00
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Erhalt	0,820	16.12.2024	8.700	(61)	(13)	0,00
	Call – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,200	12.01.2023	900	(3)	0	0,00
MYC	Put – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,800	12.01.2023	900	(3)	(3)	0,00
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,993	11.10.2023	700	(5)	(1)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,993	11.10.2023	700	(5)	(9)	0,00
							\$ (797)	\$ (2.051)	(0,28)

(1) Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZKAUF⁽¹⁾

Kontrahent	Referenzinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag ⁽³⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BPS	South Korea Government International Bond	(1,000) %	20.06.2023	\$ 3.100	\$ (76)	\$ 65	\$ (11)	0,00
BRC	China Government International Bond	(1,000)	20.06.2023	1.600	(31)	25	(6)	0,00
	South Korea Government International Bond	(1,000)	20.06.2023	4.400	(111)	95	(16)	(0,01)

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond Ex-US Fund (Forts.)

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽³⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
GST	China Government International Bond	(1,000) %	20.06.2023	\$ 2.900	\$ (56)	\$ 45	\$ (11)	0,00
HUS	South Korea Government International Bond	(1,000)	20.06.2023	1.500	(38)	33	(5)	0,00
JPM	South Korea Government International Bond	(1,000)	20.06.2023	2.100	(50)	43	(7)	0,00
					\$ (362)	\$ 306	\$ (56)	(0,01)

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽²⁾

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽³⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BRC	Italy Government International Bond	1,000 %	20.06.2025	\$ 1.500	\$ (37)	\$ 44	\$ 7	0,00
CBK	Italy Government International Bond	1,000	20.06.2025	1.000	(24)	29	5	0,00
					\$ (61)	\$ 73	\$ 12	0,00

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

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

⁽³⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert.

CROSS-CURRENCY SWAPS

Kontrahent	Erhalt	Zahlung	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag erhaltener Währung	Nennbetrag gelieferter Währung	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
AZD	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month AUD-LIBOR zzgl. 0,290 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	04.01.2031	AUD 5.900	\$ 4.445	\$ 29	\$ (17)	\$ 12	0,00
CBK	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month AUD-LIBOR zzgl. 0,420 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	31.07.2029	7.100	4.899	(2)	10	8	0,00
GLM	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month AUD-LIBOR zzgl. 0,423 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	01.08.2029	7.000	4.830	(14)	10	(4)	0,00
MYC	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month AUD-LIBOR zzgl. 0,298 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	14.10.2030	2.000	1.437	9	(5)	4	0,00
						\$ 22	\$ (2)	\$ 20	0,00

ZINSSWAPS

Kontrahent	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,250 %	16.03.2032	MYR 2.116	\$ 4	\$ 25	\$ 29	0,01
	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,500	21.09.2027	9.800	4	21	25	0,00
	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	4,000	21.09.2027	16.256	19	(62)	(43)	(0,01)
	Erhalt	3-Month THB-THORON Compounded-OIS	2,000	21.09.2024	THB 156.400	(7)	(1)	(8)	0,00
	Erhalt	3-Month THB-THORON Compounded-OIS	2,250	21.12.2027	250.400	(36)	23	(13)	0,00
	Zahlung	6-Month THB-THBFX	2,000	16.03.2032	31.900	5	(41)	(36)	(0,01)
	Zahlung	6-Month THB-THBFX	2,000	15.06.2032	30.200	(4)	(35)	(39)	(0,01)
	Zahlung	6-Month THB-THBFX	2,750	21.09.2032	37.180	(1)	30	29	0,00
	Zahlung	6-Month THB-THBFX	3,250	15.06.2032	800	0	2	2	0,00
	Zahlung	6-Month THB-THBFX	2,000	15.06.2032	2.700	(1)	(2)	(3)	0,00
BPS	Zahlung	6-Month THB-THBFX	3,250	15.06.2032	18.500	3	30	33	0,01
CBK	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,500	16.03.2032	MYR 2.800	1	24	25	0,00
GLM	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,750	21.09.2032	1.200	(1)	7	6	0,00
	Zahlung	6-Month THB-THBFX	2,000	15.06.2032	THB 18.800	(1)	(24)	(25)	0,00
	Zahlung	6-Month THB-THBFX	3,250	15.06.2032	4.500	1	7	8	0,00
GST	Erhalt	3-Month THB-THORON Compounded-OIS	2,000	21.09.2024	465.700	(49)	25	(24)	0,00
JPM	Zahlung	6-Month THB-THBFX	2,000	15.06.2032	42.900	(5)	(52)	(57)	(0,01)

Kontrahent	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Netto- vermögens
MBC	Zahlung	6-Month THB-THBFIX	2,000 %	15.06.2032	THB 23.900	\$ (6)	\$ (26)	\$ (32)	0,00
SCX	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,500	16.03.2032	MYR 2.300	(7)	28	21	0,00
	Erhalt	3-Month THB-THORON Compounded-OIS	2,000	21.09.2024	THB 462.505	19	(43)	(24)	0,00
	Erhalt	3-Month THB-THORON Compounded-OIS	2,000	21.09.2027	3.350	0	1	1	0,00
	Erhalt	3-Month THB-THORON Compounded-OIS	2,250	21.09.2027	191.600	(34)	22	(12)	0,00
						\$ (96)	\$ (41)	\$ (137)	(0,02)

TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES

Kontrahent	Zahlung/Erhalt	Wertpapier	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Variabler Zinssatz	Nenn- betrag	Fälligkeits- datum	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Netto- vermögens
BOA	Erhalt	iBoxx USD Liquid Investment Grade Index	k. A.	1,058	\$ 5.400	20.09.2023	\$ 42	\$ 140	\$ 182	0,03
BPS	Erhalt	iBoxx USD Liquid Investment Grade Index	k. A.	1,059	14.200	20.06.2023	60	118	178	0,02
	Erhalt	iBoxx USD Liquid Investment Grade Index	k. A.	1,058	4.645	20.09.2023	36	101	137	0,02
MYC	Erhalt	iBoxx USD Liquid Investment Grade Index	k. A.	1,059	1.700	20.06.2023	7	14	21	0,00
							\$ 145	\$ 373	\$ 518	0,07

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
BOA	01.2023	AUD	395	\$ 267	\$ 0	\$ (1)	0,00	
	01.2023	HUF	83.016	212	0	(9)	0,00	
	01.2023	¥	7.021.000	49.180	0	(4.066)	(0,57)	
	01.2023	PEN	11.896	3.051	7	(55)	(48)	(0,01)
	01.2023	\$	356	337	8	0	8	0,00
	01.2023	\$	6.591	¥ 869.000	0	(1)	(1)	0,00
	01.2023		2	THB 59	0	0	0	0,00
	02.2023		221	PEN 854	1	0	1	0,00
	03.2023	MYR	46.499	\$ 10.302	0	(370)	(370)	(0,05)
	03.2023	\$	600	ZAR 10.590	19	0	19	0,00
	05.2023	CNH	14.174	\$ 2.191	121	0	121	0,02
	BPS	01.2023	€	1.496	1.595	0	(3)	(3)
01.2023		HUF	323.337	825	0	(37)	(37)	(0,01)
01.2023		ILS	7.399	2.159	60	0	60	0,01
01.2023		THB	25	1	0	0	0	0,00
01.2023		TWD	39.022	1.275	3	0	3	0,00
03.2023		CNH	12.279	1.902	118	0	118	0,02
03.2023		MXN	22.408	1.112	0	(22)	(22)	0,00
03.2023		MYR	110	24	0	(2)	(2)	0,00
03.2023		TWD	8.006	266	3	0	3	0,00
03.2023		\$	4.746	MYR 20.965	66	0	66	0,01
03.2023		ZAR	10.213	\$ 561	0	(35)	(35)	(0,01)
05.2023		ILS	6.916	2.145	171	0	171	0,02
BRC	05.2023	MYR	610	131	0	(10)	(10)	0,00
	07.2023	ILS	1.057	332	29	0	29	0,00
	01.2023	CNH	4.112	590	0	(5)	(5)	0,00
	01.2023	HUF	935.913	2.441	0	(54)	(54)	(0,01)
	01.2023	PEN	1.157	291	0	(12)	(12)	0,00
	01.2023	SGD	956	710	0	(3)	(3)	0,00
	01.2023	\$	6.643	MYR 31.361	530	0	530	0,07
	01.2023		6.241	NOK 62.103	65	0	65	0,01
	01.2023		113	THB 3.912	0	0	0	0,00
	02.2023	TWD	84.029	\$ 2.734	0	(14)	(14)	0,00
	01.2023	AUD	637	428	0	(4)	(4)	0,00
	01.2023	DKK	3.365	474	0	(9)	(9)	0,00
CBK	01.2023	€	1.228	1.300	0	(11)	(11)	0,00
	01.2023	ILS	10.998	3.481	364	0	364	0,05
	01.2023	PEN	7.254	1.806	0	(92)	(92)	(0,01)
	01.2023	THB	106.577	3.082	0	0	0	0,00
	01.2023	\$	1.629	AUD 2.415	9	0	9	0,00
	01.2023		2.742	BRL 14.393	0	(16)	(16)	0,00
	01.2023		3.228	CHF 3.049	70	0	70	0,01
	01.2023		558	CLP 485.552	11	0	11	0,00
	01.2023		1.433	€ 1.356	15	0	15	0,00
	01.2023		5.115	¥ 680.300	44	0	44	0,01
	01.2023		664	NOK 6.582	4	0	4	0,00
	01.2023		3.049	NZD 4.771	0	(32)	(32)	(0,01)
01.2023		1.765	PEN 6.833	26	0	26	0,00	
01.2023		523	THB 18.151	2	0	2	0,00	
02.2023		975	BRL 4.720	15	0	15	0,00	
03.2023	ILS	25.388	\$ 7.487	270	0	270	0,04	
03.2023	PEN	8.248	\$ 2.052	0	(99)	(99)	(0,01)	
03.2023	\$	11	MXN 214	0	0	0	0,00	
04.2023	CLP	491.843	\$ 557	0	(11)	(11)	0,00	
04.2023	PEN	8.535	2.118	0	(101)	(101)	(0,01)	

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond Ex-US Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
	05.2023	CNH	\$ 1.559	\$ 241	\$ 13	\$ 13	0,00	
	05.2023	PEN	15.097	3.836	0	(81)	(0,01)	
	05.2023	\$	2.107	CNH 14.857	63	63	0,01	
	07.2023	ILS	6.406	\$ 1.894	55	55	0,01	
	11.2023		10.830	3.236	104	104	0,01	
CLY	01.2023	HUF	177.834	463	0	(11)	0,00	
DUB	01.2023	DKK	68.092	9.597	0	(180)	(0,03)	
	01.2023	HUF	10.493	23	0	(5)	0,00	
	01.2023	TWD	15.741	514	1	0	0,00	
	07.2023	ILS	7.554	2.157	0	(12)	0,00	
GLM	01.2023	BRL	14.393	2.701	0	(25)	0,00	
	01.2023	CLP	481.994	489	0	(76)	(0,01)	
	01.2023	CNH	4.268	614	0	(4)	0,00	
	01.2023	KRW	291.229	221	0	(10)	0,00	
	01.2023	MYR	8.887	2.036	5	(2)	0,00	
	01.2023	PEN	577	149	0	(2)	0,00	
	01.2023	THB	11.621	333	0	(3)	0,00	
	01.2023	\$	2.060	MYR 9.111	24	0	0,00	
	03.2023	CNH	6.354	\$ 984	61	61	0,01	
	03.2023	\$	949	MXN 19.514	38	38	0,01	
	04.2023		2.653	BRL 14.393	26	26	0,00	
	05.2023		1.712	PEN 6.812	55	55	0,01	
IND	05.2023	CNH	22.540	\$ 3.485	193	193	0,03	
JPM	01.2023	£	44.330	53.529	197	197	0,03	
	01.2023	HUF	16	0	0	0	0,00	
	01.2023	THB	9.861	286	1	1	0,00	
	01.2023	\$	387	THB 13.417	1	1	0,00	
	02.2023	TWD	10.178	\$ 335	3	3	0,00	
	03.2023	\$	37	IDR 582.010	0	0	0,00	
MBC	05.2023		2	CNH 15	0	0	0,00	
	01.2023	AUD	1.719	\$ 1.153	0	(12)	0,00	
	01.2023	CAD	7.663	5.712	57	57	0,01	
	01.2023	DKK	61.775	8.726	0	(144)	(0,02)	
	01.2023	€	144.296	151.315	0	(2.750)	(0,39)	
	01.2023	£	2.208	2.692	35	35	0,01	
	01.2023	¥	1.121.104	8.160	0	(342)	(0,05)	
	01.2023	NOK	4.180	422	0	(2)	0,00	
	01.2023	\$	637	€ 597	0	0	0,00	
	01.2023		808	£ 860	0	(14)	0,00	
	01.2023		12.173	¥ 1.620.100	114	114	0,02	
	01.2023		295	KRW 381.621	8	8	0,00	
	01.2023		222	PEN 895	12	12	0,00	
	01.2023		794	THB 27.511	2	2	0,00	
	02.2023	¥	3.820.000	\$ 26.770	0	(2.326)	(0,33)	
	03.2023	\$	296	CLP 265.532	13	13	0,00	
	03.2023		23	IDR 353.251	0	0	0,00	
	03.2023		221	TWD 6.624	0	(4)	0,00	
MYI	05.2023	CNH	95.487	\$ 14.228	294	294	0,04	
	01.2023	AUD	17.530	11.772	0	(119)	(0,02)	
	01.2023	¥	4.673.434	34.089	0	(1.355)	(0,19)	
	01.2023	MYR	4.227	958	0	(9)	0,00	
	01.2023	THB	1.271	37	0	0	0,00	
	01.2023	\$	1.367	€ 1.300	21	21	0,00	
	01.2023		1.143	MYR 5.410	94	94	0,01	
	02.2023	TWD	18.817	\$ 617	3	3	0,00	
	03.2023	\$	32	IDR 497.731	0	0	0,00	
RBC	01.2023	AUD	202	\$ 135	0	(2)	0,00	
	03.2023	\$	57	MXN 1.142	1	1	0,00	
RYL	01.2023	¥	9.000	\$ 66	0	(3)	0,00	
	01.2023	\$	108	HUF 40.806	0	0	0,00	
SCX	01.2023	AUD	1.175	\$ 792	0	(5)	0,00	
	01.2023	KRW	20.799.945	15.741	0	(792)	(0,11)	
	01.2023	NZD	14.460	9.007	0	(139)	(0,02)	
	01.2023	TWD	109.754	3.489	0	(86)	(0,01)	
	01.2023	\$	242	CLP 241.038	40	40	0,01	
	01.2023		953	€ 900	8	8	0,00	
	01.2023		957	MYR 4.227	10	10	0,00	
	01.2023		416	PEN 1.602	3	3	0,00	
	01.2023		206	THB 7.132	1	1	0,00	
TOR	03.2023	MYR	35.138	\$ 7.607	0	(458)	(0,06)	
UAG	01.2023	¥	5.610.000	38.864	0	(3.740)	(0,52)	
	01.2023	CZK	1.677	66	0	(8)	0,00	
	01.2023	HUF	586.069	1.492	0	(70)	(0,01)	
	01.2023	\$	510	DKK 3.565	2	2	0,00	
	02.2023	¥	840.000	\$ 5.977	0	(430)	(0,06)	
	02.2023	TWD	860	28	0	0	0,00	
	03.2023	¥	350.019	2.559	0	(115)	(0,02)	
					\$ 3.589	\$ (18.410)	\$ (14.821)	(2,07)

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilsklasse Institutional EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	01.2023	\$ 10.394	€ 9.749	\$ 15	\$ 0	\$ 15	0,00
BPS	01.2023	€ 260	\$ 277	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 18	€ 16	0	0	0	0,00
CBK	01.2023	10.948	10.560	327	0	327	0,05
JPM	01.2023	1.618	1.556	43	0	43	0,01
MBC	01.2023	€ 26	\$ 28	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 12.725	€ 12.142	239	0	239	0,03
SCX	01.2023	12.665	12.168	327	0	327	0,05
				\$ 951	\$ 0	\$ 951	0,14

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilsklasse Class E USD (Currency Exposure) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2023	\$ 59	CHF 56	\$ 1	\$ 0	\$ 1	0,00
	01.2023	303	MXN 5.932	2	0	2	0,00
	01.2023	247	SGD 339	6	0	6	0,00
BOM	01.2023	1.030	CAD 1.383	0	(9)	(9)	0,00
BPS	01.2023	€ 253	\$ 270	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 18	SGD 25	0	0	0	0,00
BRC	01.2023	£ 43	\$ 52	0	0	0	0,00
	01.2023	PEN 278	72	0	(1)	(1)	0,00
	01.2023	\$ 105	NOK 1.046	1	0	1	0,00
	01.2023	437	SEK 4.581	2	0	2	0,00
	02.2023	72	PEN 278	1	0	1	0,00
CBK	01.2023	CNY 359	\$ 51	0	(1)	(1)	0,00
	01.2023	€ 122	129	0	(1)	(1)	0,00
	01.2023	MXN 5.932	305	1	0	1	0,00
	01.2023	TWD 484	16	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 495	CHF 467	11	0	11	0,00
	01.2023	247	CNY 1.720	2	0	2	0,00
	01.2023	443	IDR 6.974.132	9	0	9	0,00
	01.2023	10	SEK 105	0	0	0	0,00
	02.2023	303	MXN 5.932	0	(1)	(1)	0,00
GLM	01.2023	MYR 1.853	\$ 419	0	(1)	(1)	0,00
	01.2023	\$ 148	CZK 3.483	6	0	6	0,00
	01.2023	394	MYR 1.853	26	0	26	0,00
	01.2023	72	PEN 278	1	0	1	0,00
	01.2023	180	PLN 817	7	0	7	0,00
	02.2023	420	MYR 1.853	4	0	4	0,00
MBC	01.2023	€ 43	\$ 46	0	0	0	0,00
	01.2023	¥ 20.645	155	0	(2)	(2)	0,00
	01.2023	\$ 112	AUD 165	0	0	0	0,00
	01.2023	64	CAD 86	0	(1)	(1)	0,00
	01.2023	1	CZK 16	0	0	0	0,00
	01.2023	217	DKK 1.552	6	0	6	0,00
	01.2023	21.173	€ 20.202	397	0	397	0,06
	01.2023	174	£ 143	0	(2)	(2)	0,00
	01.2023	190	ILS 651	0	(6)	(6)	0,00
	01.2023	2.566	¥ 352.891	111	0	111	0,02
	01.2023	11	NOK 112	0	0	0	0,00
	01.2023	1.435	AUD 2.137	14	0	14	0,00
	01.2023	11.486	¥ 1.574.720	457	0	457	0,06
RBC	01.2023	CAD 46	\$ 34	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 17	AUD 25	0	0	0	0,00
	01.2023	5	KRW 5.962	0	0	0	0,00
SCX	01.2023	CNY 741	\$ 107	0	(1)	(1)	0,00
	01.2023	¥ 9.845	73	0	(1)	(1)	0,00
	01.2023	\$ 97	AUD 143	1	0	1	0,00
	01.2023	898	CAD 1.207	0	(8)	(8)	0,00
	01.2023	9.703	CNY 69.261	324	0	324	0,05
	01.2023	3.818	€ 3.669	99	0	99	0,01
	01.2023	194	NZD 312	3	0	3	0,00
TOR	01.2023	1.250	CAD 1.681	0	(10)	(10)	0,00
	01.2023	4.622	£ 3.844	3	0	3	0,00
UAG	01.2023	CLP 38.151	\$ 44	0	(1)	(1)	0,00
	01.2023	\$ 40	CLP 38.151	5	0	5	0,00
	01.2023	98	HUF 38.974	5	0	5	0,00
	01.2023	0	IDR 5.386	0	0	0	0,00
	01.2023	1.215	KRW 1.594.214	52	0	52	0,01
	01.2023	28	SEK 292	0	0	0	0,00
	01.2023	368	THB 12.951	6	0	6	0,00
	02.2023	44	CLP 38.151	1	0	1	0,00
				\$ 1.564	\$ (46)	\$ 1.518	0,21
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						\$ (13.011)	(1,82)

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond Ex-US Fund (Forts.)

LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖGENS
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN			
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA			
2,000 % fällig am 01.01.2038	\$ 13.300	\$ (11.831)	(1,65)
2,000 % fällig am 01.01.2053	75.650	(61.574)	(8,60)
2,500 % fällig am 01.01.2053	3.300	(2.795)	(0,39)
Summe Leerverkaufte Wertpapiere		\$ (76.200)	(10,64)
Summe Anlagen		\$ 682.087	95,26
Sonstige Aktiva und Passiva		\$ 33.935	4,74
Nettovermögen		\$ 716.022	100,00

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

- * Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt
- ^ Das Wertpapier ist in Verzug.
- (a) Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.
- (b) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.
- (c) Nullkuponwertpapier.
- (d) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.
- (e) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.
- (f) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.
- (g) Mit dem Fonds verbunden.
- (h) Bedingt wandelbares Wertpapier.
- (j) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2021: 1,00 %):

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeits- datum	Kauf- datum	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
Citigroup, Inc.	3,290 %	17.03.2026	10.03.2022	\$ 2.200	\$ 2.093	0,29
Deutsche Bank AG	3,729	14.01.2032	22.01.2021	301	221	0,03
Oracle Corp.	2,300	25.03.2028	22.03.2021	2.395	2.083	0,29
Oracle Corp.	2,875	25.03.2031	22.03.2021	599	499	0,07
Oracle Corp.	3,950	25.03.2051	22.03.2021	100	72	0,01
Oracle Corp.	4,100	25.03.2061	22.03.2021	699	489	0,07
				\$ 6.294	\$ 5.457	0,76

Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von 0 USD (31. Dezember 2021: 98.740 USD) wurden gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen zum 31. Dezember 2022 als Sicherheiten verpfändet.

Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von 0 USD (31. Dezember 2021: 8.463 USD) wurden gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte zum 31. Dezember 2022 als Sicherheiten für verzögert gelieferte Wertpapiere oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte verpfändet oder geliefert.

Barmittel in Höhe von 25.647 USD (31. Dezember 2021: 15.571 USD) wurden zum 31. Dezember 2022 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 12.800 USD (31. Dezember 2021: 3.640 USD) wurden gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. zum 31. Dezember 2022 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 737.412	\$ 0	\$ 737.412
Investmentfonds	46.863	459	0	47.322
Pensionsgeschäfte	0	1.625	0	1.625
Finanzderivate ⁽³⁾	1.705	(29.777)	0	(28.072)
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(76.200)	0	(76.200)
Summen	\$ 48.568	\$ 633.519	\$ 0	\$ 682.087

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

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 1.081.382	\$ 0	\$ 1.081.382
Investmentfonds	6.361	0	0	6.361
Pensionsgeschäfte	0	1.246	0	1.246
Finanzderivate ⁽³⁾	1.470	(10.441)	0	(8.971)
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(150.627)	0	(150.627)
Summen	\$ 7.831	\$ 921.560	\$ 0	\$ 929.391

⁽¹⁾ Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

⁽²⁾ Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

⁽³⁾ Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung des Marktwerts der außerbörslich gehandelten Finanzderivate und (erhaltenen)/verpfändeten Sicherheiten nach Kontrahenten zum 31. Dezember 2022 und 31. Dezember 2021:

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2022			Zum 31. Dez. 2021		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Nettoengagement ⁽¹⁾
AZD	\$ 27	\$ 0	\$ 27	\$ (2)	\$ 0	\$ (2)
BOA	(4.371)	3.760	(611)	68	(220)	(152)
BOM	(9)	0	(9)	k. A.	k. A.	k. A.
BPS	633	(530)	103	(1.454)	1.130	(324)
BRC	488	(400)	88	360	(270)	90
CBK	979	(680)	299	(277)	270	(7)
CLY	(11)	0	(11)	k. A.	k. A.	k. A.
CIB	k. A.	k. A.	k. A.	1	0	1
DUB	(252)	280	28	(370)	0	(370)
GLM	(593)	420	(173)	(454)	560	106
GSC	k. A.	k. A.	k. A.	(2)	0	(2)
GST	(35)	0	(35)	(10)	0	(10)
HUS	(5)	0	(5)	(572)	260	(312)
IND	193	(330)	(137)	k. A.	k. A.	k. A.
JPM	165	0	165	(304)	20	(284)
MBC	(4.349)	3.720	(629)	k. A.	k. A.	k. A.
MYC	15	10	25	(68)	(740)	(808)
MYI	(894)	490	(404)	540	(730)	(190)
NAB	k. A.	k. A.	k. A.	(22)	0	(22)
RBC	(1)	0	(1)	90	0	90
RYL	(3)	0	(3)	(559)	460	(99)
SCX	(688)	600	(88)	(1.205)	930	(275)
TOR	(3.747)	3.130	(617)	219	(280)	(61)
UAG	(553)	390	(163)	221	0	221
WST	k. A.	k. A.	k. A.	(4)	0	(4)

⁽¹⁾ Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2022:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	51,35	92,15
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	51,26	26,23
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,37	0,22
Investmentfonds	6,61	0,70
Pensionsgeschäfte	0,23	0,14
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,23	0,21
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(2,33)	(0,77)
Freiverkehrsfinaanzderivate	(1,82)	(0,42)
Leerverkaufte Wertpapiere	(10,64)	(16,52)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	k. A.	(10,91)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	k. A.	(0,93)

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2022 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
Australien	1,91	2,63
Brasilien	0,21	0,17
Kanada	1,68	2,18
Kaimaninseln	2,86	3,57
China	2,16	13,05
Dänemark	2,57	4,33
Finnland	k. A.	0,08

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
Frankreich	3,25	4,03
Deutschland	2,47	2,36
Guernsey, Kanalinseln	k. A.	0,04
Hongkong	0,08	0,13
Ungarn	0,03	0,06
Indien	k. A.	0,17
Irland	6,51	5,22
Israel	1,22	1,13
Italien	1,29	4,31
Japan	4,87	17,80
Jersey, Kanalinseln	k. A.	0,03
Luxemburg	0,71	0,84
Malaysia	0,92	1,94
Mexiko	0,04	0,05
Multinational	0,11	0,11
Niederlande	0,77	1,66
Neuseeland	0,09	0,09
Norwegen	0,22	0,08
Peru	1,21	1,12
Polen	0,03	k. A.
Portugal	0,14	0,02
Katar	0,05	0,28
Rumänien	0,55	0,47
Russland	k. A.	0,28
Saudi-Arabien	k. A.	0,79
Serbien	0,26	0,30
Singapur	k. A.	0,90
Slowenien	0,22	0,33
Südafrika	k. A.	0,08
Südkorea	2,27	2,11
Spanien	1,50	4,43
Supranational	0,51	0,41
Schweden	0,09	0,11
Schweiz	0,95	1,76
Thailand	0,51	k. A.
Vereinigte Arabische Emirate	0,07	0,20
Großbritannien	9,28	12,91
USA	30,13	24,99
Kurzfristige Instrumente	21,24	1,05
Investmentfonds	6,61	0,70
Pensionsgeschäfte	0,23	0,14
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,24	0,21
Verkaufsoptionen		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	(0,01)	k. A.
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf	(0,02)	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	(0,13)	(0,04)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	k. A.	0,00
Zinsswaps — Basisswaps	0,01	0,01
Zinsswaps	(2,19)	(0,74)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Zinsswapoptionen	0,05	0,01
Optionen auf Wertpapiere	0,09	0,02
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes	0,00	0,00
Devisenoptionen	k. A.	(0,01)
Zinsswapoptionen	(0,28)	(0,16)
Zinsscaps	k. A.	0,00
Optionen auf Wertpapiere	k. A.	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzkauf	(0,01)	(0,03)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf	0,00	0,00
Cross-Currency Swaps	0,00	0,00
Zinsswaps	(0,02)	0,01
Total Return Swaps auf Indizes	0,07	0,01
Total Return Swaps auf Wertpapiere	k. A.	0,00
Devisenterminkontrakte	(2,07)	(0,34)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,35	0,07
Leerverkaufte Wertpapiere	(10,64)	(16,52)
Sonstige Aktiva und Passiva	4,74	(1,94)
Nettovermögen	100,00	100,00

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft ⁽¹⁾	% des Netto- vermögens
BPS	4,310 %	30.12.2022	03.01.2023	\$ 7.300	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,250 % fällig am 15.02.2050	\$ (7.418)	\$ 7.300	\$ 7.303	0,97
FICC	1,900	30.12.2022	03.01.2023	11.236	U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 29.12.2023	(11.461)	11.236	11.237	1,50
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (18.879)	\$ 18.536	\$ 18.540	2,47

⁽¹⁾ Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Netto- vermögens
Australia Government 3-Year Note March Futures	Long	03.2023	74	\$ (71)	(0,01)
Australia Government 10-Year Bond March Futures	Long	03.2023	15	(65)	(0,01)
CAC 40 Index January Futures	Long	01.2023	30	(57)	(0,01)
Canada Government 10-Year Bond March Futures	Long	03.2023	44	(68)	(0,01)
DAX Index March Futures	Long	03.2023	3	(32)	0,00
E-mini S&P 500 Index March Futures	Long	03.2023	1.338	(9.881)	(1,32)
Euro STOXX 50 March Futures	Short	03.2023	258	471	0,06
Euro STOXX 600 March Futures	Long	03.2023	3.068	(2.635)	(0,35)
Euro-Bobl March Futures	Long	03.2023	103	(469)	(0,06)
Euro-BTP Italy Government Bond March Futures	Long	03.2023	65	(561)	(0,07)
Euro-Bund 10-Year Bond March Futures	Short	03.2023	214	1	0,00
Euro-Buxl 30-Year Bond March Futures	Long	03.2023	6	(164)	(0,02)
Euro-OAT France Government 10-Year Bond March Futures	Short	03.2023	31	293	0,04
Euro-Schatz March Futures	Long	03.2023	151	(225)	(0,03)
FTSE 100 Index March Futures	Long	03.2023	20	3	0,00
FTSE/MIB Index March Futures	Short	03.2023	3	10	0,00
IBEX 35 January Futures	Long	01.2023	1	0	0,00
Japan Government 10-Year Bond March Futures	Long	03.2023	25	(521)	(0,07)
Mini MSCI Emerging Markets Index March Futures	Long	03.2023	322	(365)	(0,05)
Nikkei 225 Yen-Denominated March Futures	Long	03.2023	6	(43)	(0,01)
ONX30 Index January Futures	Short	01.2023	1	1	0,00
S&P/Toronto Stock Exchange 60 March Futures	Long	03.2023	84	(500)	(0,07)
SPI 200 Index March Futures	Long	03.2023	114	(254)	(0,03)
Swiss Market March Futures	Short	03.2023	1	3	0,00
Topix Index March Futures	Long	03.2023	136	(556)	(0,07)
U.S. Treasury 2-Year Note March Futures	Long	03.2023	82	(1)	0,00
U.S. Treasury 5-Year Note March Futures	Short	03.2023	239	(4)	0,00
U.S. Treasury 10-Year Note March Futures	Long	03.2023	83	(70)	(0,01)
U.S. Treasury 30-Year Bond March Futures	Long	03.2023	169	(218)	(0,03)
United Kingdom Long Gilt March Futures	Long	03.2023	15	(1)	0,00
				\$ (15.979)	(2,13)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ (15.979)	(2,13)

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag ⁽³⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AT&T, Inc.	1,000 %	20.06.2026	\$ 200	\$ (3)	0,00
General Motors Co.	5,000	20.12.2026	300	(27)	(0,01)
				\$ (30)	(0,01)

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF⁽²⁾

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag ⁽³⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
iTraxx Crossover 37 5-Year Index	(5,000) %	20.06.2027	€ 100	\$ 3	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO Global Core Asset Allocation Fund (Forts.)

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festszinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽³⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.HY-39 5-Year Index	5,000 %	20.12.2027	\$ 100	\$ 5	0,00
CDX.IG-39 5-Year Index	1,000	20.12.2027	49.800	512	0,07
iTraxx Europe Main 37 5-Year Index	1,000	20.06.2027	€ 300	(3)	0,00
				\$ 514	0,07

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung ⁽⁴⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	2,000 %	15.03.2033	£ 4.500	\$ 110	0,02
Erhalt ⁽⁴⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	2,000	15.03.2053	1.700	(97)	(0,01)
Zahlung ⁽⁴⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	2,250	15.03.2028	1.900	(67)	(0,01)
Zahlung	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	6,500	21.09.2027	INR 263.320	(13)	0,00
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000	15.12.2026	¥ 2.800.000	(271)	(0,04)
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,050	15.12.2031	3.990.000	1.078	0,14
Zahlung ⁽⁴⁾	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	1,000	15.03.2053	520.000	(57)	(0,01)
Erhalt	1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS	1,250	15.12.2026	SGD 9.630	(100)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,250	16.03.2024	\$ 14.500	251	0,03
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2029	41.000	(1.734)	(0,23)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2032	14.300	571	0,08
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2052	3.100	249	0,03
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2052	4.000	-177	-0,02
Erhalt ⁽⁴⁾	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,385	08.06.2032	6.100	517	0,07
Erhalt ⁽⁴⁾	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,700	03.11.2033	22.400	(565)	(0,07)
Zahlung ⁽⁴⁾	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,100	03.11.2025	97.300	677	0,09
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,575	04.01.2027	BRL 39.700	(11)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,670	02.01.2025	32.000	(113)	(0,01)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,708	02.01.2025	22.000	66	0,01
Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,740	02.01.2025	42.700	124	0,02
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,750	02.01.2025	30.597	27	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,120	02.01.2025	69.900	(148)	(0,02)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,330	02.01.2025	84.800	(139)	(0,02)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	12,460	02.01.2025	14.600	17	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	2,250	21.09.2052	CAD 2.600	(209)	(0,03)
Erhalt	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,250	21.12.2027	CNY 57.300	0	0,00
Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,500	15.12.2026	55.090	13	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	4,920	26.08.2026	COP21.200.000	735	0,10
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	5,925	26.08.2026	20.900.000	(592)	(0,08)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	7,215	09.02.2027	38.418.830	47	0,01
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	7,620	18.09.2030	29.000.000	680	0,09
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,585	26.11.2025	21.088.900	233	0,03
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,590	26.11.2025	22.207.400	245	0,03
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,930	18.09.2030	2.700.000	26	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	9,280	26.11.2025	24.084.000	178	0,02
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	10,270	17.11.2027	16.699.000	21	0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	10,840	02.12.2025	74.238.900	59	0,01
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	10,960	21.11.2025	11.115.900	(15)	0,00
Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	1,215	11.02.2027	ILS 10.150	18	0,00
Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	1,268	17.03.2031	KRW 2.741.200	(234)	(0,03)
Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	1,336	17.03.2031	1.600.000	(139)	(0,02)
Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	2,500	16.03.2027	495.400	(1)	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	5,980	21.12.2026	ZAR 151.000	135	0,02
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	6,890	04.11.2026	146.400	(328)	(0,04)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,850	14.01.2027	CLP 3.860.940	58	0,01
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	6,045	11.02.2027	3.472.700	81	0,01
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	5,225	29.07.2027	CZK 70.940	44	0,01
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,081	15.02.2031	€ 24.400	(3.300)	(0,44)
Zahlung ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	1,500	15.03.2025	2.700	(24)	0,00
Zahlung ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	1,500	15.03.2028	10.300	(495)	(0,07)
Zahlung ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	1,500	15.03.2053	5.400	(294)	(0,04)
Zahlung ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	1,750	15.03.2033	22.140	(353)	(0,05)
Erhalt	6-Month HUF-BBR	3,700	08.11.2026	HUF 3.299.700	577	0,08
Zahlung	6-Month HUF-BBR	11,070	02.09.2027	450.700	(18)	0,00
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	2,983	08.11.2026	PLN 6.850	(44)	(0,01)
Erhalt	28-Day MXN-TIE	7,745	11.02.2027	MXN 74.680	16	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIE	8,240	02.12.2032	64.700	110	0,01
Erhalt	28-Day MXN-TIE	8,250	01.12.2032	66.000	110	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIE	8,700	05.11.2027	63.500	(19)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIE	9,400	11.12.2024	246.000	(118)	(0,02)
Zahlung	28-Day MXN-TIE	9,455	12.12.2024	240.300	(102)	(0,01)
					\$ (2.704)	(0,36)
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					\$ (2.217)	(0,30)

- (1) Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definieren, dann zahlt der Teilfonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückzahlungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.
- (2) Agiert der Teilfonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definieren, dann erhält der Teilfonds entweder (i) vom Sicherungsgeber einen Betrag in Höhe des Nennwerts des Swaps und liefert die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er erhält einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückzahlungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.
- (3) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definieren.
- (4) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

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

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

VERKAUFSOPTIONEN

INFLATION-CAPPED OPTIONS

Kontrahent	Beschreibung	Anfänglicher Index	Variabler Zinssatz	Verfallsdatum	Nennbetrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
GLM	Cap – OTC CPALEMU	\$ 100,151	Maximal [(Index Final/Index Initial – 1) – 3,000 %] oder 0	22.06.2035	8.200	\$ (374)	\$ (416)	(0,06)
JPM	Cap – OTC CPURNSA	234,781	Maximal [(Index Final/Index Initial – 1) – 4,000 %] oder 0	16.05.2024	1.500	(10)	0	0,00
						\$ (384)	\$ (416)	(0,06)

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,000 %	19.01.2023	1.950	\$ (9)	\$ (1)	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,500	19.01.2023	1.950	(8)	(23)	(0,01)
BPS	Call – OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	4,140	05.01.2023	24.000	(32)	(1)	0,00
	Put – OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,640	05.01.2023	24.000	(32)	(4)	0,00
BRC	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,000	19.01.2023	1.950	(8)	(1)	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,500	19.01.2023	1.950	(8)	(24)	0,00
							\$ (97)	\$ (54)	(0,01)

(1) Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHÜTZVERKAUF⁽¹⁾

Kontrahent	Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽²⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
GST	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500 %	17.11.2059	\$ 2.900	\$ (86)	\$ 80	\$ (6)	0,00
MYC	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	12.200	(403)	376	(27)	(0,01)
SAL	CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17.08.2061	2.200	(5)	(13)	(18)	0,00
UAG	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	5.100	(148)	137	(11)	0,00
					\$ (642)	\$ 580	\$ (62)	(0,01)

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definieren.

ZINSSWAPS

Kontrahent	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fest-Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	Zahlung	3-Month MYR-KLIBOR	2,750 %	15.12.2026	MYR 6.350	\$ (15)	\$ (39)	\$ (54)	(0,01)
	Zahlung	3-Month MYR-KLIBOR	3,000	16.03.2027	33.030	(123)	(101)	(224)	(0,03)
CBK	Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	1,430	01.07.2029	KRW 100	0	0	0	0,00
GLM	Zahlung	6-Month THB-THBFX	1,750	15.06.2027	THB 107.200	(77)	12	(65)	(0,01)
GST	Zahlung	3-Month THB-THORON Compounded-OIS	2,500	21.09.2027	57.200	26	(3)	23	0,01
MYC	Erhalt	3-Month THB-THORON Compounded-OIS	2,250	21.09.2027	7.800	1	(1)	0	0,00
						\$ (188)	\$ (132)	\$ (320)	(0,04)

Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO Global Core Asset Allocation Fund (Forts.)

TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES

Kontrahent	Zahlung/Erhalt	Wertpapier	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Variabler Zinssatz	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	Zahlung	Dow Jones U.S. Select REIT Total Return Index	229	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	\$ 2.664	04.01.2023	\$ 0	\$ 150	\$ 150	0,02
	Zahlung	Dow Jones U.S. Select REIT Total Return Index	1.814	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	19.993	23.08.2023	0	81	81	0,01
BPS	Zahlung	Dow Jones U.S. Select REIT Total Return Index	757	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	8.343	15.02.2023	0	33	33	0,01
	Zahlung	Industrial Select Sector Index	2.419	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	8.537	21.06.2023	0	32	32	0,00
BRC	Erhalt	iBoxx USD Liquid Investment Grade Index	k. A.	1,058 %	100	20.12.2023	(1)	(2)	(3)	0,00
		NDUEACWF Index	25.089	1-Month USD-LIBOR abzgl. eines bestimmten Spreads	7.968	06.09.2023	0	(49)	(49)	(0,01)
GST	Erhalt	iBoxx USD Liquid High Yield Index	k. A.	1,058	100	20.06.2023	(1)	(1)	(2)	0,00
JPM	Zahlung	JPPMGSHPI Index	189.602	1-Month USD-LIBOR abzgl. eines bestimmten Spreads	15.327	07.06.2023	0	39	39	0,01
	Zahlung	NDUEACWF Index	78.972	1-Month USD-LIBOR abzgl. eines bestimmten Spreads	25.082	06.09.2023	0	153	153	0,02
MBC	Erhalt	MSCI Emerging Markets Index	24.335	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	11.828	06.12.2023	0	(33)	(33)	0,00
MEI	Zahlung	SX4T Index	3.303	1-Month USD-LIBOR abzgl. eines bestimmten Spreads	€ 9.771	11.01.2023	0	7	7	0,00
MYI	Erhalt	MSCI Emerging Markets Index	24.335	1-Month USD-LIBOR abzgl. eines bestimmten Spreads	\$ 11.828	01.03.2023	0	(40)	(40)	(0,01)
	Erhalt	MSCI Emerging Markets Index	24.335	1-Month USD-LIBOR abzgl. eines bestimmten Spreads	11.828	08.03.2023	0	(41)	(41)	(0,01)
	Erhalt	MSCI Emerging Markets Index	24.335	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	11.828	07.06.2023	0	(41)	(41)	(0,01)
SOG	Zahlung	Dow Jones U.S. Select REIT Total Return Index	1.065	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	11.810	05.04.2023	0	118	118	0,02
							\$ (2)	\$ 406	\$ 404	0,05

TOTAL RETURN SWAPS AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Zahlung/Erhalt	Wertpapier	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Variabler Zinssatz	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens	
BOA	Zahlung	3M Co.	18.600	1-Month USD-LIBOR abzgl. eines bestimmten Spreads	\$ 2.243	28.06.2023	\$ 0	\$ 20	\$ 20	0,00	
	Zahlung	Fastenal Co.	34.800	1-Month USD-LIBOR abzgl. eines bestimmten Spreads	1.655	28.06.2023	0	14	14	0,00	
	Zahlung	Illinois Tool Works, Inc.	10.800	1-Month USD-LIBOR abzgl. eines bestimmten Spreads	2.397	28.06.2023	0	12	12	0,00	
	Zahlung	J.B. Hunt Transport, Inc.	5.500	1-Month USD-LIBOR abzgl. eines bestimmten Spreads	972	28.06.2023	0	17	17	0,00	
	Zahlung	Knight-Swift Transportation Holdings, Inc.	18.900	1-Month USD-LIBOR abzgl. eines bestimmten Spreads	993	28.06.2023	0	6	6	0,00	
	Zahlung	Old Dominion Freight Line, Inc.	3.400	1-Month USD-LIBOR abzgl. eines bestimmten Spreads	974	28.06.2023	0	13	13	0,00	
	Zahlung	W.W. Grainger, Inc.	4.500	1-Month USD-LIBOR abzgl. eines bestimmten Spreads	2.530	28.06.2023	0	36	36	0,01	
	Zahlung	Watsco, Inc.	8.600	1-Month USD-LIBOR abzgl. eines bestimmten Spreads	2.172	28.06.2023	0	35	35	0,01	
								\$ 0	\$ 153	\$ 153	0,02

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens	
BOA	01.2023	£ 111	\$ 135	\$ 1	\$ 0	\$ 1	0,00	
	01.2023	HUF 111.156	284	0	(12)	(12)	0,00	
	01.2023	¥ 8.512.800	59.611	0	(4.959)	(4.959)	(0,66)	
	01.2023	PEN 6.302	1.581	0	(67)	(67)	(0,01)	
	01.2023	\$ 128	CHF 121	3	0	3	0,00	
	01.2023	7.473	HUF 3.382.008	1.514	0	1.514	0,20	
	01.2023	1.150	SEK 11.730	0	(24)	(24)	0,00	
	02.2023	ZAR 14.632	\$ 803	0	(54)	(54)	(0,01)	
	03.2023	MXN 710	36	0	0	0	0,00	
	03.2023	\$ 1.884	TWD 57.164	0	(10)	(10)	0,00	
	03.2023	2.208	ZAR 38.887	64	0	64	0,01	
	BOM	01.2023	2.634	CAD 3.537	0	(24)	(24)	0,00
		01.2023	BRL 5.923	\$ 1.138	16	0	16	0,00
	BPS	01.2023	£ 1.301	1.572	7	0	7	0,00
01.2023		HUF 327.819	856	0	(18)	(18)	0,00	
01.2023		ILS 1.367	399	11	0	11	0,00	
01.2023		\$ 0	THB 2	0	0	0	0,00	
01.2023		1.278	ZAR 22.153	23	0	23	0,00	

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermogens
	02.2023	\$ 15.039	COP 72.874.971	\$ 0	\$ (147)	\$ (147)	(0,02)
	03.2023	COP 82.861.712	\$ 17.027	162	0	162	0,02
	03.2023	INR 145.390	1.753	5	0	5	0,00
	03.2023	PEN 13.860	3.565	0	(46)	(46)	(0,01)
	03.2023	TWD 2.112	70	1	0	1	0,00
	03.2023	\$ 3.998	COP 19.776.915	26	0	26	0,00
	03.2023	2.781	MXN 56.041	56	0	56	0,01
	05.2023	ILS 593	\$ 184	15	0	15	0,00
	07.2023	11.722	3.679	318	0	318	0,04
BRC	01.2023	CNH 107.981	15.486	0	(139)	(139)	(0,02)
	01.2023	HUF 1.205.375	3.089	0	(121)	(121)	(0,02)
	01.2023	MYR 2.096	477	0	(2)	(2)	0,00
	01.2023	\$ 630	MYR 2.962	47	0	47	0,01
	01.2023	7.569	NOK 75.315	78	0	78	0,01
	01.2023	159	SEK 1.699	1	0	1	0,00
	01.2023	1.169	SGD 1.574	5	0	5	0,00
BSH	03.2023	CLP 1.764.865	\$ 2.051	0	(1)	(1)	0,00
CBK	01.2023	2.069.008	2.171	0	(255)	(255)	(0,03)
	01.2023	€ 4.010	4.263	0	(19)	(19)	0,00
	01.2023	HUF 1.211.074	3.035	0	(183)	(183)	(0,03)
	01.2023	ILS 17.896	5.668	596	0	596	0,08
	01.2023	PLN 414	84	0	(11)	(11)	0,00
	01.2023	\$ 879	AUD 1.287	0	(6)	(6)	0,00
	01.2023	8.613	BRL 45.239	0	(45)	(45)	(0,01)
	01.2023	2.219	CAD 3.002	0	(4)	(4)	0,00
	01.2023	1.161	CHF 1.096	25	0	25	0,00
	01.2023	2.327	CLP 2.069.706	101	0	101	0,01
	01.2023	6.025	€ 5.693	54	0	54	0,01
	01.2023	1.297	¥ 178.800	59	0	59	0,01
	01.2023	805	NOK 7.983	5	0	5	0,00
	01.2023	6.920	PEN 27.791	352	0	352	0,05
	01.2023	2.663	ZAR 46.666	74	0	74	0,01
	01.2023	ZAR 22.153	\$ 1.275	0	(25)	(25)	0,00
	02.2023	BRL 6.112	1.133	0	(19)	(19)	0,00
	02.2023	CLP 2.081.106	2.327	0	(103)	(103)	(0,01)
	02.2023	ZAR 41.164	2.364	0	(47)	(47)	(0,01)
	03.2023	COP 10.946.918	2.198	3	(32)	(29)	0,00
	03.2023	PEN 13.836	3.442	0	(166)	(166)	(0,02)
	03.2023	\$ 4.197	MXN 82.600	11	(17)	(17)	0,00
	03.2023	196	TWD 5.950	0	(1)	(1)	0,00
	04.2023	1.137	PEN 4.550	45	0	45	0,01
	05.2023	ILS 1.876	\$ 586	50	0	50	0,01
	05.2023	MXN 120	6	0	0	0	0,00
	07.2023	ILS 6.893	2.151	175	0	175	0,02
	08.2023	10.315	3.192	229	0	229	0,03
CLY	01.2023	HUF 511.816	1.311	0	(53)	(53)	(0,01)
DUB	03.2023	\$ 2.227	MXN 44.250	13	0	13	0,00
GLM	01.2023	BRL 48.610	\$ 9.095	8	(120)	(112)	(0,02)
	01.2023	CNH 112.081	16.112	0	(106)	(106)	(0,01)
	01.2023	COP 7.890.759	1.631	6	0	6	0,00
	01.2023	HUF 323.754	831	0	(31)	(31)	0,00
	01.2023	THB 7.538	217	0	(1)	(1)	0,00
	01.2023	\$ 1.270	BRL 6.633	0	(14)	(14)	0,00
	01.2023	10.360	COP 50.223.796	0	(14)	(14)	0,00
	01.2023	318	HKD 2.477	0	(1)	(1)	0,00
	01.2023	29	THB 1.004	0	0	0	0,00
	01.2023	ZAR 231	\$ 13	0	(1)	(1)	0,00
	02.2023	COP 21.618.196	4.746	329	0	329	0,04
	03.2023	96.179.839	19.743	172	0	172	0,02
	03.2023	MXN 310.334	15.096	0	(610)	(610)	(0,08)
	03.2023	\$ 3.985	CLP 3.630.322	237	0	237	0,03
	03.2023	9.530	COP 45.956.043	0	(176)	(176)	(0,02)
	03.2023	6.006	MXN 120.528	94	0	94	0,01
	04.2023	MXN 25.962	\$ 1.291	0	(16)	(16)	0,00
	04.2023	\$ 5.314	BRL 28.827	52	0	52	0,01
JPM	01.2023	HUF 1.464.478	\$ 3.671	0	(220)	(220)	(0,03)
	01.2023	\$ 412	BRL 2.135	0	(7)	(7)	0,00
	01.2023	42	CNY 290	0	0	0	0,00
	01.2023	1.075	MXN 21.421	22	0	22	0,00
	01.2023	ZAR 23.887	\$ 1.312	0	(90)	(90)	(0,01)
	02.2023	BRL 2.135	409	7	0	7	0,00
	02.2023	TWD 46.623	1.536	13	0	13	0,00
	02.2023	\$ 1.084	ZAR 18.899	23	0	23	0,00
	03.2023	IDR 1.154.070	\$ 74	0	(1)	(1)	0,00
	03.2023	\$ 75	CNY 517	0	0	0	0,00
	03.2023	4.328	MXN 85.285	12	(23)	(11)	0,00
MBC	01.2023	AUD 1.043	\$ 697	0	(10)	(10)	0,00
	01.2023	CAD 1.018	746	0	(5)	(5)	0,00
	01.2023	CNH 5.313	766	0	(3)	(3)	0,00
	01.2023	€ 6.136	6.474	0	(77)	(77)	(0,01)
	01.2023	£ 3.482	4.244	55	0	55	0,01
	01.2023	¥ 285.700	2.097	0	(69)	(69)	(0,01)
	01.2023	NZD 2.940	1.883	24	0	24	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO Global Core Asset Allocation Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Netto- vermögens
	01.2023	\$ 436	AUD 650	\$ 5	\$ 0	\$ 5	0,00
	01.2023	3.382	CAD 4.537	0	(34)	(34)	(0,01)
	01.2023	9.769	CNH 68.082	83	0	83	0,01
	01.2023	2.438	DKK 17.435	65	0	65	0,01
	01.2023	53.209	€ 50.755	983	0	983	0,13
	01.2023	824	£ 673	0	(14)	(14)	0,00
	01.2023	1.321	HKD 10.282	0	(3)	(3)	0,00
	01.2023	6.337	¥ 862.798	207	0	207	0,03
	01.2023	1.105	SEK 11.300	0	(20)	(20)	0,00
	01.2023	2.064	THB 71.212	0	(5)	(5)	0,00
	01.2023	ZAR 13.949	\$ 777	0	(41)	(41)	(0,01)
	02.2023	¥ 8.120.000	\$ 58.702	0	(3.277)	(3.277)	(0,44)
	02.2023	\$ 133	ZAR 2.410	8	0	8	0,00
	03.2023	IDR 700.457	\$ 45	0	(1)	(1)	0,00
	03.2023	\$ 2.134	COP 9.947.932	3	(12)	(109)	(0,02)
	05.2023	727	CNH 4.877	0	(15)	(15)	0,00
MYI	01.2023	CZK 6.683	\$ 272	0	(23)	(23)	0,00
	01.2023	€ 149	\$ 159	0	(1)	(1)	0,00
	01.2023	£ 1.485	1.810	23	0	23	0,00
	01.2023	HUF 467.144	1.056	0	(185)	(185)	(0,03)
	01.2023	\$ 13.844	AUD 20.615	140	0	140	0,02
	01.2023	77	€ 72	0	0	0	0,00
	01.2023	40	£ 33	0	0	0	0,00
	01.2023	16.400	¥ 2.248.403	652	0	652	0,09
	01.2023	257	ZAR 4.415	2	0	2	0,00
	01.2023	ZAR 8.830	\$ 485	0	(33)	(33)	(0,01)
	02.2023	TWD 86.197	2.827	11	0	11	0,00
	02.2023	\$ 2.322	ZAR 42.306	156	0	156	0,02
	02.2023	ZAR 10.920	\$ 618	0	(22)	(22)	0,00
	03.2023	COP 955.736	195	1	0	1	0,00
	03.2023	IDR 986.931	63	0	(1)	(1)	0,00
	03.2023	ZAR 38.887	2.195	0	(78)	(78)	(0,01)
RBC	01.2023	\$ 159	AUD 237	2	0	2	0,00
	01.2023	1.653	CAD 2.250	8	0	8	0,00
	02.2023	MXN 38.635	\$ 1.949	0	(22)	(22)	0,00
	03.2023	COP 2.147.303	466	29	0	29	0,00
	03.2023	MXN 44.331	2.198	0	(52)	(52)	(0,01)
	03.2023	\$ 2.937	MXN 58.736	39	0	39	0,01
	03.2023	ZAR 30.034	\$ 1.668	0	(60)	(60)	(0,01)
RYL	01.2023	¥ 72.000	\$ 528	0	(21)	(21)	0,00
	01.2023	\$ 126	HUF 47.624	0	0	0	0,00
SCX	01.2023	KRW 788.745	\$ 597	0	(30)	(30)	0,00
	01.2023	\$ 931	AUD 1.382	6	0	6	0,00
	01.2023	2.297	CAD 3.085	0	(19)	(19)	0,00
	01.2023	234	KRW 300.709	5	0	5	0,00
	01.2023	285	NZD 458	4	0	4	0,00
	02.2023	TWD 43.840	\$ 1.425	0	(9)	(9)	0,00
	03.2023	CLP 5.165.159	5.914	0	(92)	(92)	(0,01)
	03.2023	\$ 1.130	COP 5.490.000	0	(12)	(12)	0,00
SOG	01.2023	355	BRL 1.876	0	0	0	0,00
SSB	01.2023	COP 42.333.037	\$ 8.257	0	(463)	(463)	(0,06)
TOR	01.2023	CZK 4.464	189	0	(8)	(8)	0,00
	01.2023	¥ 1.090.000	7.503	0	(778)	(778)	(0,10)
UAG	02.2023	ZAR 81.594	4.726	0	(53)	(53)	(0,01)
	01.2023	BRL 1.350	255	0	(1)	(1)	0,00
	01.2023	CZK 4.082	161	0	(20)	(20)	0,00
	01.2023	£ 1.496	1.839	40	0	40	0,01
	01.2023	HUF 318.343	830	0	(18)	(18)	0,00
	01.2023	\$ 530	CZK 12.733	32	0	32	0,00
	02.2023	¥ 4.547	ZAR 84.696	413	0	413	0,05
	03.2023	¥ 2.829.154	\$ 20.684	0	(930)	(930)	(0,12)
	03.2023	MXN 625	31	0	0	0	0,00
	05.2023	CNH 4.878	704	0	(8)	(8)	0,00
	09.2023	\$ 259	ZAR 4.596	6	0	6	0,00
				\$ 8.122	\$ (14.677)	\$ (6.555)	(0,87)

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Class E EUR (Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2023	CHF 732	\$ 774	\$ 0	\$ (18)	\$ (18)	0,00
	01.2023	€ 7	7	0	0	0	0,00
	01.2023	MXN 15.257	779	0	(4)	(4)	0,00
	01.2023	SGD 1.084	789	0	(19)	(19)	0,00
BOM	01.2023	CAD 3.956	2.946	26	0	26	0,00
BPS	01.2023	SGD 79	58	0	(1)	(1)	0,00

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BRC	01.2023	NOK 4.124	\$ 414	\$ 0	\$ (4)	\$ (4)	0,00
	01.2023	SEK 25.311	2.417	0	(13)	(13)	0,00
CBK	01.2023	AUD 821	554	0	(3)	(3)	0,00
	01.2023	CHF 6.085	6.442	0	(140)	(140)	(0,02)
	01.2023	CNY 118	17	0	0	0	0,00
	01.2023	€ 154	163	0	(1)	(1)	0,00
	01.2023	IDR 14.191.102	901	0	(18)	(18)	0,00
	01.2023	INR 406.470	4.963	54	0	54	0,01
	01.2023	PHP 30.800	544	0	(11)	(11)	0,00
	01.2023	SEK 578	56	0	0	0	0,00
	01.2023	TWD 135.987	4.427	0	(1)	(1)	0,00
	01.2023	\$ 135.122	€ 130.111	3.800	0	3.800	0,50
	01.2023	784	MXN 15.257	2	(2)	(2)	0,00
	02.2023	MXN 15.257	\$ 781	2	0	2	0,00
GLM	01.2023	BRL 11.861	2.157	0	(89)	(89)	(0,01)
	01.2023	CZK 3.146	134	0	(5)	(5)	0,00
	01.2023	MYR 3.191	679	0	(45)	(45)	(0,01)
	01.2023	PLN 1.305	287	0	(10)	(10)	0,00
	01.2023	\$ 2.240	BRL 11.861	7	0	7	0,00
	01.2023	722	MYR 3.191	2	0	2	0,00
	02.2023	BRL 11.861	\$ 2.226	0	(8)	(8)	0,00
	02.2023	MYR 3.191	723	0	(7)	(7)	0,00
JPM	01.2023	£ 9.340	11.278	41	0	41	0,01
MBC	01.2023	ZAR 38	2	0	0	0	0,00
	01.2023	AUD 236	158	0	(2)	(2)	0,00
	01.2023	CAD 5.567	4.150	42	0	42	0,01
	01.2023	CZK 15	1	0	0	0	0,00
	01.2023	DKK 14.812	2.071	0	(55)	(55)	(0,01)
	01.2023	€ 1.825	1.942	0	(7)	(7)	0,00
	01.2023	ILS 800	234	7	0	7	0,00
	01.2023	INR 109	1	0	0	0	0,00
	01.2023	¥ 487.169	3.551	0	(144)	(144)	(0,02)
	01.2023	NOK 440	45	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 185.305	€ 176.820	3.487	0	3.487	0,46
MYI	01.2023	AUD 7.473	\$ 5.018	0	(50)	(50)	(0,01)
	01.2023	¥ 1.789.507	13.053	0	(520)	(520)	(0,07)
	01.2023	ZAR 27.243	1.601	0	0	0	0,00
RBC	01.2023	AUD 86	58	0	(1)	(1)	0,00
SCX	01.2023	501	338	0	(2)	(2)	0,00
	01.2023	CAD 3.451	2.569	22	0	22	0,00
	01.2023	CNY 12.672	1.775	0	(59)	(59)	(0,01)
	01.2023	NZD 402	251	0	(4)	(4)	0,00
	01.2023	\$ 166.514	€ 159.979	4.297	0	4.297	0,57
SOG	01.2023	HKD 14.937	\$ 1.918	4	0	4	0,00
UAG	01.2023	KRW 4.754.773	3.579	0	(201)	(201)	(0,03)
	01.2023	CLP 144.422	152	0	(17)	(17)	0,00
	01.2023	HKD 57.167	7.315	0	(11)	(11)	0,00
	01.2023	HUF 57.263	145	0	(8)	(8)	0,00
	01.2023	IDR 10.961	1	0	0	0	0,00
	01.2023	SEK 1.615	154	0	(1)	(1)	0,00
	01.2023	THB 30.499	866	0	(15)	(15)	0,00
	01.2023	\$ 165	CLP 144.422	4	0	4	0,00
	01.2023	9	KRW 11.477	0	0	0	0,00
	02.2023	CLP 144.422	\$ 165	0	(4)	(4)	0,00
				\$ 11.795	\$ (1.500)	\$ 10.295	1,37

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilsklasse Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2023	CHF 6	\$ 7	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	01.2023	£ 161	194	0	0	0	0,00
	01.2023	MXN 171	9	0	0	0	0,00
	01.2023	SGD 11	8	0	0	0	0,00
BOM	01.2023	CAD 33	24	0	0	0	0,00
BPS	01.2023	SGD 1	1	0	0	0	0,00
BRC	01.2023	£ 33	40	0	0	0	0,00
	01.2023	NOK 50	5	0	0	0	0,00
	01.2023	SEK 197	19	0	0	0	0,00
CBK	01.2023	CHF 53	56	0	(1)	(1)	0,00
	01.2023	CNY 1	0	0	0	0	0,00
	01.2023	IDR 86.687	6	0	0	0	0,00
	01.2023	INR 3.259	40	0	0	0	0,00
	01.2023	PHP 147	3	0	0	0	0,00
	01.2023	SEK 5	0	0	0	0	0,00
	01.2023	TWD 1.104	36	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 4	CAD 5	0	0	0	0,00
	01.2023	9	€ 9	0	0	0	0,00
	01.2023	6	¥ 871	0	0	0	0,00
	01.2023	9	MXN 171	0	0	0	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO Global Core Asset Allocation Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	02.2023	MXN 171	\$ 9	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
GLM	01.2023	BRL 88	\$ 16	0	(1)	(1)	0,00
	01.2023	CZK 38	2	0	0	0	0,00
	01.2023	MYR 22	5	0	0	0	0,00
	01.2023	PLN 16	3	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 17	BRL 88	0	0	0	0,00
	01.2023	5	MYR 22	0	0	0	0,00
	02.2023	BRL 88	\$ 17	0	0	0	0,00
	02.2023	MYR 22	5	0	0	0	0,00
JPM	01.2023	\$ 1.443	£1.195	0	(5)	(5)	0,00
MBC	01.2023	AUD 2	\$ 1	0	0	0	0,00
	01.2023	CAD 50	37	0	0	0	0,00
	01.2023	CZK 0	0	0	0	0	0,00
	01.2023	DKK 136	19	0	(1)	(1)	0,00
	01.2023	€ 204	214	0	(4)	(4)	0,00
	01.2023	ILS 12	4	0	0	0	0,00
	01.2023	INR 1	0	0	0	0	0,00
	01.2023	¥ 4.306	31	0	(1)	(1)	0,00
	01.2023	NOK 5	1	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 2	€ 2	0	0	0	0,00
	01.2023	1.329	£1.107	5	(2)	3	0,00
MYI	01.2023	AUD 61	\$ 41	0	0	0	0,00
	01.2023	¥ 15.166	111	0	(4)	(4)	0,00
	01.2023	\$ 3	CHF 3	0	0	0	0,00
	01.2023	56	£ 46	0	(1)	(1)	0,00
	01.2023	ZAR 187	\$ 11	0	0	0	0,00
RBC	01.2023	AUD 1	0	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 3	HKD 23	0	0	0	0,00
SCX	01.2023	AUD 4	\$ 3	0	0	0	0,00
	01.2023	CAD 29	21	0	0	0	0,00
	01.2023	CNY 102	14	0	(1)	(1)	0,00
	01.2023	NZD 5	3	0	0	0	0,00
SOG	01.2023	HKD 121	16	0	0	0	0,00
	01.2023	KRW 38.515	29	0	(2)	(2)	0,00
TOR	01.2023	\$ 1.428	£1.188	1	0	1	0,00
UAG	01.2023	CLP 2.256	\$ 2	0	0	0	0,00
	01.2023	HKD 495	63	0	0	0	0,00
	01.2023	HUF 692	2	0	0	0	0,00
	01.2023	IDR 71	0	0	0	0	0,00
	01.2023	SEK 13	1	0	0	0	0,00
	01.2023	THB 303	9	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 3	CLP2.256	0	0	0	0,00
	01.2023	0	KRW 93	0	0	0	0,00
	02.2023	CLP 2.256	\$ 3	0	0	0	0,00
				\$ 6	\$ (23)	\$ (17)	0,00
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						\$ 3.428	0,45
Summe Anlagen						\$ 728.692	97,15
Sonstige Aktiva und Passiva						\$ 21.384	2,85
Nettovermögen						\$ 750.076	100,00

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

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

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.

(b) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.

(c) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.

(d) Nullkuponwertpapier.

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

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

(g) Mit dem Fonds verbunden.

Barmittel in Höhe von 35.607 USD (31. Dezember 2021: 55.630 EUR) wurden zum 31. Dezember 2022 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Wertpapier mit einem Gesamtmarktwert von 0 USD (31. Dezember 2021: 855 USD) und Barmittel in Höhe von 5.030 USD (31. Dezember 2021: 5.340 USD) wurden gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. zum 31. Dezember 2022 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 94.207	\$ 379.228	\$ 0	\$ 473.435
Investmentfonds	151.214	100.275	0	251.489
Pensionsgeschäfte	0	18.536	0	18.536
Finanzderivate ⁽³⁾	(15.794)	1.026	0	(14.768)
Summen	\$ 229.627	\$ 499.065	\$ 0	\$ 728.692

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

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 124.910	\$ 450.226	\$ 648	\$ 575.784
Investmentfonds	388.149	0	0	388.149
Pensionsgeschäfte	0	511	0	511
Finanzderivate ⁽³⁾	11.497	8.311	0	19.808
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(84.769)	0	(84.769)
Summen	\$ 524.556	\$ 374.279	\$ 648	\$ 899.483

⁽¹⁾ Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

⁽²⁾ Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

⁽³⁾ Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung des Marktwerts der außerbörslich gehandelten Finanzderivate und (erhaltenen)/verpfändeten Sicherheiten nach Kontrahenten zum 31. Dezember 2022 und 31. Dezember 2021:

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2022			Zum 31. Dez. 2021		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾
BOA	\$ (3.503)	\$ 1.500	\$ (2.003)	\$ (584)	\$ 855	\$ 271
BOM	2	0	2	k. A.	k. A.	k. A.
BPS	485	(1.380)	(895)	(251)	980	729
BRC	(222)	450	228	40	0	40
BSH	(1)	0	(1)	k. A.	k. A.	k. A.
CBK	4.514	(4.480)	34	364	(310)	54
CLY	(53)	0	(53)	k. A.	k. A.	k. A.
DUB	13	0	13	(29)	0	(29)
GLM	(829)	420	(409)	285	(630)	(345)
GST	15	(20)	(5)	24	(20)	4
HUS	k. A.	k. A.	k. A.	241	(330)	(89)
JPM	(36)	(590)	(626)	(132)	620	488
MBC	1.039	(1.100)	(61)	k. A.	k. A.	k. A.
MEI	7	(440)	(433)	k. A.	k. A.	k. A.
MYC	(27)	180	153	66	(195)	(129)
MYI	(65)	780	725	308	(330)	(22)
NAB	k. A.	k. A.	k. A.	383	(300)	83
RBC	(57)	0	(57)	1.910	(1.520)	390
RYL	(21)	0	(21)	k. A.	k. A.	k. A.
SAL	(18)	0	(18)	14	0	14
SCX	4.106	(3.980)	126	2.559	(1.480)	1.079
SOG	(81)	(280)	(361)	18	3.740	3.758
SSB	(463)	590	127	(8)	0	(8)
TOR	(838)	690	(148)	2.137	(1.280)	857
UAG	(549)	420	(129)	223	(270)	(47)

⁽¹⁾ Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2022:

	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	25,87	33,48
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	35,98	21,09
Sonstige übertragbare Wertpapiere	1,28	1,06
Investmentfonds	33,53	37,50
Pensionsgeschäfte	2,47	0,05
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(2,13)	1,11
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,30)	0,07
Freiverkehrsfinanzderivate	0,45	0,73
Leerverkaufte Wertpapiere	k. A.	(8,19)

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2022 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
Kreditbeteiligungen und -abtretungen	k. A.	0,39
Unternehmensanleihen und Wechsel	3,39	8,14
Wandelanleihen und Wechsel	0,12	0,11
US-Regierungsbehörden	4,77	1,05
US-Schatzobligationen	1,20	0,50
Non-Agency-MBS	1,66	1,11
Förderungsbesicherte Wertpapiere	7,95	4,81
Staatsemissionen	7,97	12,31
Stammaktien	6,88	8,25
Vorzugwertpapiere	0,16	0,20
Real Estate Investment Trusts	5,86	5,92
Kurzfristige Instrumente	23,17	12,84
Investmentfonds	33,53	37,50
Pensionsgeschäfte	2,47	0,05
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(2,13)	1,11
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf	(0,01)	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	0,00	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,07	0,01
Zinsswaps	(0,36)	0,06
Freiverkehrsinanzderivate		
Optionskauf		
Devisenoptionen	k. A.	0,00
Verkaufsoptionen		
Devisenoptionen	k. A.	0,00
Inflation-Capped Options	(0,06)	(0,01)
Zinsswapoption	(0,01)	k. A.
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	(0,01)	0,02
Zinsswaps	(0,04)	(0,02)
Total Return Swaps auf Indizes	0,05	0,01
Total Return Swaps auf Wertpapiere	0,02	(0,03)
Devisenterminkontrakte	(0,87)	0,24
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	1,37	0,52
Leerverkaufte Wertpapiere	k. A.	(8,19)
Sonstige Aktiva und Passiva	2,85	13,10
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTO-VERMÖGENS	% DES
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE				
BELGIEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Ontex Group NV 3,500 % fällig am 15.07.2026	€ 7.500	\$ 6.800	0,22	
BERMUDA				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
NCL Corp. Ltd. 5,875 % fällig am 15.03.2026 5,875 % fällig am 15.02.2027	\$ 2.850 1.875	2.244 1.626	0,07 0,05	
Viking Cruises Ltd. 5,875 % fällig am 15.09.2027 13,000 % fällig am 15.05.2025	4.000 2.000	3.267 2.113	0,11 0,07	
VOC Escrow Ltd. 5,000 % fällig am 15.02.2028	3.500	3.016	0,10	
Summe Bermuda		12.266	0,40	
KANADA				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Air Canada 3,875 % fällig am 15.08.2026 4,625 % fällig am 15.08.2029	CAD 3.250 3.000	2.884 1.941	0,10 0,06	
B.C. Unlimited Liability Co. 3,500 % fällig am 15.02.2029 4,000 % fällig am 15.10.2030 4,375 % fällig am 15.01.2028	\$ 4.000 10.000 2.500	3.436 8.119 2.242	0,11 0,26 0,07	
Bausch Health Cos., Inc. 4,875 % fällig am 01.06.2028 5,500 % fällig am 01.11.2025 5,750 % fällig am 15.08.2027	3.500 3.000 2.500	2.233 2.555 1.705	0,07 0,08 0,06	
Bombardier, Inc. 7,125 % fällig am 15.06.2026 7,500 % fällig am 15.03.2025 7,875 % fällig am 15.04.2027	6.000 2.901 3.000	5.832 2.879 2.916	0,19 0,09 0,10	
GFL Environmental, Inc. 3,500 % fällig am 01.09.2028 4,000 % fällig am 01.08.2028	5.000 3.000	4.402 2.569	0,14 0,08	
Strathcona Resources Ltd. 6,875 % fällig am 01.08.2026	5.875	4.295	0,14	
Summe Kanada		48.008	1,55	
KAIMANINSELN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Diamond Foreign Asset Co. (9,000 % bar oder 9,000 % PIK) 9,000 % fällig am 22.04.2027 (a)(g) 9,000 % fällig am 22.04.2027 (a)	66 18	62 17	0,00 0,00	
Noble Finance Co. (11,000 % bar oder 15,000 % PIK) 11,000 % fällig am 15.02.2028 (a)	976	1.085	0,04	
Spirit Loyalty Cayman Ltd. 8,000 % fällig am 20.09.2025	5.000	5.032	0,16	
UPCB Finance Ltd. 3,625 % fällig am 15.06.2029	€ 12.500	11.895	0,38	
Wynn Macau Ltd. 5,125 % fällig am 15.12.2029 5,500 % fällig am 01.10.2027	\$ 2.500 4.500	2.027 3.941	0,07 0,13	
Summe Kaimaninseln		24.059	0,78	
DÄNEMARK				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Norican A/S 4,500 % fällig am 15.05.2023	€ 2.700	2.726	0,09	
FRANKREICH				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Accor S.A. 2,375 % fällig am 29.11.2028	5.000	4.577	0,15	
Altice France S.A. 3,375 % fällig am 15.01.2028 4,000 % fällig am 15.07.2029 4,125 % fällig am 15.01.2029 5,500 % fällig am 15.01.2028 5,500 % fällig am 15.10.2029	7.000 3.000 3.000 10.000 5.000	5.655 2.431 2.454 7.853 3.822	0,18 0,08 0,08 0,25 0,12	

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTO-VERMÖGENS	% DES
Banijay Entertainment SASU 5,375 % fällig am 01.03.2025	\$ 2.750	\$ 2.603	0,08	
CAB SELAS 3,375 % fällig am 01.02.2028	€ 10.000	8.610	0,28	
Chrome Bidco SASU 3,500 % fällig am 31.05.2028	3.400	3.061	0,10	
Chrome Holdco SASU 5,000 % fällig am 31.05.2029	3.850	3.207	0,10	
Elior Group S.A. 3,750 % fällig am 15.07.2026	4.400	3.984	0,13	
Rexel S.A. 2,125 % fällig am 15.12.2028	7.000	6.509	0,21	
Verallia S.A. 1,875 % fällig am 10.11.2031	7.000	5.847	0,19	
Summe Frankreich		60.613	1,95	
DEUTSCHLAND				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Cheplapharm Arzneimittel GmbH 3,500 % fällig am 11.02.2027 4,375 % fällig am 15.01.2028	5.000 5.000	4.691 4.705	0,15 0,15	
Ctec GmbH 5,250 % fällig am 15.02.2030	12.000	10.707	0,35	
IHO Verwaltungs GmbH (3,625 % bar oder 4,375 % PIK) 3,625 % fällig am 15.05.2025 (a)	2.750	2.685	0,09	
IHO Verwaltungs GmbH (3,750 % bar oder 4,500 % PIK) 3,750 % fällig am 15.09.2026 (a)	3.000	2.793	0,09	
IHO Verwaltungs GmbH (3,875 % bar oder 4,625 % PIK) 3,875 % fällig am 15.05.2027 (a)	2.000	1.811	0,06	
IHO Verwaltungs GmbH (4,750 % bar oder 5,500 % PIK) 4,750 % fällig am 15.09.2026 (a)	\$ 5.000	4.335	0,14	
Nidda Healthcare Holding GmbH 3,500 % fällig am 30.09.2024 7,500 % fällig am 21.08.2026	€ 677 17.000	706 17.383	0,02 0,56	
Techem Verwaltungsgesellschaft mbH 2,000 % fällig am 15.07.2025	10.000	9.843	0,32	
TK Elevator Midco GmbH 4,375 % fällig am 15.07.2027	7.000	6.667	0,21	
WEPA Hygieneprodukte GmbH 2,875 % fällig am 15.12.2027	10.000	8.752	0,28	
ZF Finance GmbH 2,250 % fällig am 03.05.2028 3,750 % fällig am 21.09.2028	5.000 4.000	4.187 3.600	0,13 0,12	
Summe Deutschland		82.865	2,67	
IRLAND				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Motion Bondco DAC 4,500 % fällig am 15.11.2027 6,625 % fällig am 15.11.2027	3.000 \$ 5.000	2.639 4.312	0,08 0,14	
Summe Irland		6.951	0,22	
ITALIEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Atlantia SpA 1,625 % fällig am 03.02.2025 1,875 % fällig am 13.07.2027 1,875 % fällig am 12.02.2028	€ 2.000 10.000 12.500	1.999 9.096 11.123	0,06 0,29 0,36	
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 5,375 % fällig am 18.01.2028 8,000 % fällig am 22.01.2030 10,500 % fällig am 23.07.2029	3.000 3.000 3.000	2.589 2.809 2.974	0,08 0,09 0,10	
FIS Fabbrica Italiana Sintetici SpA 5,625 % fällig am 01.08.2027	5.800	4.956	0,16	
IMA Industria Macchine Automatiche SpA 3,750 % fällig am 15.01.2028	12.000	10.605	0,34	
Inter Media and Communication SpA 6,750 % fällig am 09.02.2027	6.000	6.087	0,20	
Intesa Sanpaolo SpA 4,198 % fällig am 01.06.2032 4,950 % fällig am 01.06.2042 5,710 % fällig am 15.01.2026 5,875 % fällig am 01.09.2031 (d)(f) 7,700 % fällig am 17.09.2025 (d)(f) 7,750 % fällig am 11.01.2027 (d)(f)	\$ 1.000 2.000 5.000 € 5.000 \$ 7.000 € 4.000	737 1.290 4.810 4.310 6.369 4.129	0,02 0,04 0,16 0,14 0,21 0,13	

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTO-VERMÖGENS	% DES
Nexi SpA 1,625 % fällig am 30.04.2026 2,125 % fällig am 30.04.2029	€ 8.000 11.000	\$ 7.803 9.557	0,25 0,31	
Shiba BidCo SpA 4,500 % fällig am 31.10.2028	5.000	4.609	0,15	
Telecom Italia SpA 1,625 % fällig am 18.01.2029 5,303 % fällig am 30.05.2024	5.000 \$ 2.000	4.094 1.899	0,13 0,06	
UniCredit SpA 3,875 % fällig am 03.06.2027 (d)(f) 5,459 % fällig am 30.06.2035	€ 4.000 \$ 14.000	3.188 11.402	0,10 0,37	
Summe Italien		116.435	3,75	
JERSEY, KANALINSELN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Adient Global Holdings Ltd. 3,500 % fällig am 15.08.2024 4,875 % fällig am 15.08.2026	€ 5.000 \$ 1.000	5.135 932	0,17 0,03	
Summe Jersey, Kanalinseln		6.067	0,20	
LIBERIA				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Royal Caribbean Cruises Ltd. 4,250 % fällig am 01.07.2026 5,500 % fällig am 31.08.2026 5,500 % fällig am 01.04.2028 11,500 % fällig am 01.06.2025	5.000 10.000 5.000 3.991	4.048 8.425 3.999 4.289	0,13 0,27 0,13 0,14	
Summe Liberia		20.761	0,67	
LUXEMBURG				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Albion Financing SARL 6,125 % fällig am 15.10.2026	6.125	5.471	0,18	
Altice Financing S.A. 3,000 % fällig am 15.01.2028 5,750 % fällig am 15.08.2029	€ 6.000 \$ 5.000	5.076 3.942	0,16 0,13	
Altice France Holding S.A. 4,000 % fällig am 15.02.2028	€ 4.000	2.766	0,09	
Aramark International Finance SARL 3,125 % fällig am 01.04.2025	5.000	5.136	0,17	
BK LC Lux Finco SARL 5,250 % fällig am 30.04.2029	3.000	2.783	0,09	
Camelot Finance S.A. 4,500 % fällig am 01.11.2026	\$ 4.750	4.459	0,14	
Cirsa Finance International SARL 4,500 % fällig am 15.03.2027 4,750 % fällig am 22.05.2025 6,250 % fällig am 20.12.2023	€ 5.000 4.000 1.207	4.625 4.051 1.282	0,15 0,13 0,04	
Herens Holdco SARL 4,750 % fällig am 15.05.2028	\$ 3.000	2.246	0,07	
Herens Midco SARL 5,250 % fällig am 15.05.2029	€ 12.500	9.310	0,30	
InPost S.A. 2,250 % fällig am 15.07.2027	2.925	2.591	0,08	
LHMC Finco 2 SARL (7,250 % bar oder 8,000 % PIK) 7,250 % fällig am 02.10.2025 (a)	3.650	3.380	0,11	
Lincoln Financing SARL 3,625 % fällig am 01.04.2024	5.000	5.284	0,17	
Summer BC Holdco SARL 5,750 % fällig am 31.10.2026 9,250 % fällig am 31.10.2027	4.000 3.154	3.655 2.568	0,12 0,08	
Telecom Italia Capital S.A. 6,375 % fällig am 15.11.2033 7,200 % fällig am 18.07.2036	\$ 7.000 3.000	5.738 2.441	0,18 0,08	
Summe Luxemburg		76.804	2,47	
MULTINATIONAL				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Allied Universal Holdco LLC 3,625 % fällig am 01.06.2028 4,875 % fällig am 01.06.2028	€ 6.000 £ 4.250	5.104 4.053	0,16 0,13	
American Airlines, Inc. 5,500 % fällig am 20.04.2026 5,750 % fällig am 20.04.2029	\$ 10.000 8.000	9.634 7.326	0,31 0,24	

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global High Yield Bond Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
iHeartCommunications, Inc. 4,750 % fällig am 15.01.2028 5,250 % fällig am 15.08.2027	\$ 5.000 3.000	\$ 4.080 2.546	0,13 0,08	Nabors Industries, Inc. 7,375 % fällig am 15.05.2027 9,000 % fällig am 01.02.2025	\$ 2.750 1.125	\$ 2.667 1.141	0,09 0,04	PennyMac Financial Services, Inc. 4,250 % fällig am 15.02.2029 5,750 % fällig am 15.09.2031	\$ 7.500 2.000	\$ 5.860 1.589	0,19 0,05
Imola Merger Corp. 4,750 % fällig am 15.05.2029	7.500	6.522	0,21	Nationstar Mortgage Holdings, Inc. 5,500 % fällig am 15.08.2028	5.000	4.085	0,13	Performance Food Group, Inc. 4,250 % fällig am 01.08.2029 5,500 % fällig am 15.10.2027 6,875 % fällig am 01.05.2025	3.000 5.000 1.500	2.603 4.726 1.506	0,08 0,15 0,05
IQVIA, Inc. 2,250 % fällig am 15.01.2028 2,250 % fällig am 15.03.2029 2,875 % fällig am 15.06.2028 5,000 % fällig am 15.05.2027	€ 10.000 5.900 7.000 2.000	9.419 5.328 6.686 1.911	0,30 0,17 0,22 0,06	NCR Corp. 5,000 % fällig am 01.10.2028 5,250 % fällig am 01.10.2030 5,750 % fällig am 01.09.2027 6,125 % fällig am 01.09.2029	4.000 2.500 3.750 2.000	3.417 2.067 3.594 1.873	0,11 0,07 0,12 0,06	Permian Resources Operating LLC 5,375 % fällig am 15.01.2026 6,875 % fällig am 01.04.2027	2.000 4.000	1.824 3.780	0,06 0,12
Jeld-Wen, Inc. 4,625 % fällig am 15.12.2025 4,875 % fällig am 15.12.2027 6,250 % fällig am 15.05.2025	3.000 2.500 2.000	2.517 1.886 1.885	0,08 0,06 0,06	Nexstar Media, Inc. 4,750 % fällig am 01.11.2028 5,625 % fällig am 15.07.2027	4.000 4.000	3.466 3.678	0,11 0,12	PetSmart, Inc. 4,750 % fällig am 15.02.2028 7,750 % fällig am 15.02.2029	12.000 6.000	10.887 5.646	0,35 0,18
Kaiser Aluminum Corp. 4,500 % fällig am 01.06.2031 4,625 % fällig am 01.03.2028	2.000 4.000	1.610 3.497	0,05 0,11	NextEra Energy Operating Partners LP 4,250 % fällig am 15.07.2024 4,250 % fällig am 15.09.2024 4,500 % fällig am 15.09.2027	2.000 262 3.000	1.943 245 2.757	0,06 0,01 0,09	Post Holdings, Inc. 4,500 % fällig am 15.09.2031 4,625 % fällig am 15.04.2030 5,500 % fällig am 15.12.2029 5,625 % fällig am 15.01.2028	1.864 5.000 5.000 5.000	1.570 4.324 4.535 4.714	0,05 0,14 0,15 0,15
KFC Holding Co. 4,750 % fällig am 01.06.2027	3.500	3.366	0,11	Novelis Corp. 3,250 % fällig am 15.11.2026 3,875 % fällig am 15.08.2031 4,750 % fällig am 30.01.2030	3.000 8.000 7.000	2.693 6.542 6.222	0,09 0,21 0,20	Premier Entertainment Sub LLC 5,625 % fällig am 01.09.2029	5.000	3.694	0,12
Kinetik Holdings LP 5,875 % fällig am 15.06.2030	3.000	2.817	0,09	NRG Energy, Inc. 3,375 % fällig am 15.02.2029 3,625 % fällig am 15.02.2031 3,875 % fällig am 15.02.2032 6,625 % fällig am 15.01.2027	4.250 3.750 5.000 1.067	3.434 2.858 3.765 1.060	0,11 0,09 0,12 0,03	Prime Security Services Borrower LLC 3,375 % fällig am 31.08.2027 5,250 % fällig am 15.04.2024 5,750 % fällig am 15.04.2026 6,250 % fällig am 15.01.2028	5.000 2.000 4.000 5.000	4.324 1.968 3.859 4.561	0,14 0,06 0,12 0,15
LABL, Inc. 5,875 % fällig am 01.11.2028 6,750 % fällig am 15.07.2026	2.500 5.000	2.183 4.721	0,07 0,15	NSG Holdings LLC 7,750 % fällig am 15.12.2025	791	770	0,02	Radiate Holdco LLC 4,500 % fällig am 15.09.2026 6,500 % fällig am 15.09.2028	4.000 4.000	2.945 1.683	0,09 0,05
Lamb Weston Holdings, Inc. 4,125 % fällig am 31.01.2030 4,875 % fällig am 15.05.2028	2.000 2.000	1.769 1.899	0,06 0,06	NuStar Logistics LP 5,750 % fällig am 01.10.2025 6,375 % fällig am 01.10.2030	2.500 2.000	2.408 1.853	0,08 0,06	Range Resources Corp. 4,750 % fällig am 15.02.2030 8,250 % fällig am 15.01.2029	2.000 2.000	1.765 2.064	0,06 0,07
Legacy LifePoint Health LLC 4,375 % fällig am 15.02.2027	4.000	3.390	0,11	Occidental Petroleum Corp. 5,550 % fällig am 15.03.2026 6,200 % fällig am 15.03.2040 6,375 % fällig am 01.09.2028 6,450 % fällig am 15.07.2036 6,600 % fällig am 15.03.2046 6,625 % fällig am 01.09.2030 7,500 % fällig am 01.05.2031 8,875 % fällig am 15.07.2030	1.000 5.000 3.000 5.000 1.000 5.000 1.000 5.625	998 4.902 3.033 5.111 1.031 5.178 1.070 6.360	0,03 0,16 0,10 0,16 0,03 0,17 0,03 0,20	RHP Hotel Properties LP 4,500 % fällig am 15.02.2029 4,750 % fällig am 15.10.2027	7.500 4.000	6.479 3.626	0,21 0,12
Legends Hospitality Holding Co. LLC 5,000 % fällig am 01.02.2026	1.750	1.560	0,05	ON Semiconductor Corp. 3,875 % fällig am 01.09.2028	3.500	3.060	0,10	RLJ Lodging Trust LP 4,000 % fällig am 15.09.2029	5.000	4.061	0,13
Lehman Brothers Holdings, Inc. 0,000 % fällig am 25.05.2010 ^	14.200	53	0,00	OneMain Finance Corp. 3,500 % fällig am 15.01.2027 5,375 % fällig am 15.11.2029 6,125 % fällig am 15.03.2024 6,625 % fällig am 15.01.2028 6,875 % fällig am 15.03.2025 7,125 % fällig am 15.03.2026	1.000 5.000 3.000 2.000 5.000 2.000	998 4.146 4.098 2.909 1.845 4.815 1.906	0,03 0,13 0,13 0,09 0,06 0,16 0,06	Rockcliff Energy LLC 5,500 % fällig am 15.10.2029	5.000	4.581	0,15
Level 3 Financing, Inc. 3,625 % fällig am 15.01.2029 3,750 % fällig am 15.07.2029 4,250 % fällig am 01.07.2028	2.000 3.000 5.000	1.468 2.162 3.950	0,05 0,07 0,13	Olympus Water U.S. Holding Corp. 3,875 % fällig am 01.10.2028 4,250 % fällig am 01.10.2028 5,375 % fällig am 01.10.2029	€ 10.000 \$ 2.000 € 10.000	8.697 1.626 7.783	0,28 0,05 0,25	Rocket Mortgage LLC 3,625 % fällig am 01.03.2029 3,875 % fällig am 01.03.2031 4,000 % fällig am 15.10.2033	1.750 3.000 2.000	1.390 2.297 1.497	0,04 0,07 0,05
LFS Topco LLC 5,875 % fällig am 15.10.2026	2.500	2.021	0,07	ON Semiconductor Corp. 3,875 % fällig am 01.09.2028	\$ 3.500	3.060	0,10	Rockies Express Pipeline LLC 3,600 % fällig am 15.05.2025 4,800 % fällig am 15.05.2030 4,950 % fällig am 15.07.2029	1.500 2.000 4.000	1.419 1.763 3.602	0,05 0,06 0,12
Live Nation Entertainment, Inc. 6,500 % fällig am 15.05.2027	4.000	3.922	0,13	OneMain Finance Corp. 3,500 % fällig am 15.01.2027 5,375 % fällig am 15.11.2029 6,125 % fällig am 15.03.2024 6,625 % fällig am 15.01.2028 6,875 % fällig am 15.03.2025 7,125 % fällig am 15.03.2026	5.000 5.000 3.000 2.000 5.000 2.000	4.146 4.098 2.909 1.845 4.815 1.906	0,13 0,13 0,09 0,06 0,16 0,06	Sabre Global, Inc. 7,375 % fällig am 01.09.2025 11,250 % fällig am 15.12.2027	2.000 2.280	1.925 2.349	0,06 0,08
Madison IAQ LLC 4,125 % fällig am 30.06.2028 5,875 % fällig am 30.06.2029	8.000 4.000	6.700 2.749	0,22 0,09	Organon & Co. 2,875 % fällig am 30.04.2028 4,125 % fällig am 30.04.2028 5,125 % fällig am 30.04.2031	€ 7.500 \$ 3.000 6.000	7.034 2.661 5.206	0,23 0,09 0,17	SBA Communications Corp. 3,125 % fällig am 01.02.2029 3,875 % fällig am 15.02.2027	7.000 7.000	5.833 6.336	0,19 0,20
Marriott Ownership Resorts, Inc. 4,500 % fällig am 15.06.2029 6,125 % fällig am 15.09.2025	2.000 501	1.662 516	0,05 0,02	Outfront Media Capital LLC 4,250 % fällig am 15.01.2029 4,625 % fällig am 15.03.2030 5,000 % fällig am 15.08.2027 6,250 % fällig am 15.06.2025	2.500 2.000 3.000 2.000	2.078 1.658 2.705 1.984	0,07 0,05 0,09 0,06	SCH Salt Holdings, Inc. 4,875 % fällig am 01.05.2028 6,625 % fällig am 01.05.2029	5.000 3.000	4.300 2.420	0,14 0,08
Mattel, Inc. 3,750 % fällig am 01.04.2029 5,875 % fällig am 15.12.2027	3.000 5.000	2.639 4.913	0,08 0,16	Owens & Minor, Inc. 6,625 % fällig am 01.04.2030	3.750	3.228	0,10	Scripps Escrow, Inc. 5,875 % fällig am 15.07.2027	5.000	4.470	0,14
Mauser Packaging Solutions Holding Co. 4,750 % fällig am 15.04.2024	€ 5.000	5.153	0,17	Oxford Finance LLC 6,375 % fällig am 01.02.2027	4.000	3.728	0,12	Select Medical Corp. 6,250 % fällig am 15.08.2026	2.000	1.906	0,06
Medline Borrower LP 3,875 % fällig am 01.04.2029 5,250 % fällig am 01.10.2029	\$ 10.000 8.750	8.077 6.965	0,26 0,22	Pactiv Evergreen Group Issuer LLC 4,375 % fällig am 15.10.2028	3.000	2.684	0,09	Sensata Technologies, Inc. 3,750 % fällig am 15.02.2031	6.000	4.945	0,16
MGM Resorts International 4,625 % fällig am 01.09.2026 5,750 % fällig am 15.06.2025	5.000 1.000	4.591 973	0,15 0,03	Pactiv Evergreen Group Issuer, Inc. 4,000 % fällig am 15.10.2027	10.000	8.887	0,29	Silgan Holdings, Inc. 2,250 % fällig am 01.06.2028	€ 5.750	5.242	0,17
Michaels Cos., Inc. 5,250 % fällig am 01.05.2028	3.750	3.022	0,10	Park Intermediate Holdings LLC 4,875 % fällig am 15.05.2029 7,500 % fällig am 01.06.2025	3.000 1.000	2.543 1.001	0,08 0,03	Sinclair Television Group, Inc. 4,125 % fällig am 01.12.2030	\$ 5.000	3.755	0,12
Midcap Financial Issuer Trust 6,500 % fällig am 01.05.2028	4.000	3.446	0,11	Park River Holdings, Inc. 5,625 % fällig am 01.02.2029 6,750 % fällig am 01.08.2029	4.000 2.000	2.669 1.375	0,09 0,04	Southwestern Energy Co. 5,375 % fällig am 01.02.2029 5,375 % fällig am 15.03.2030	5.000 5.000	4.643 4.570	0,15 0,15
Midwest Gaming Borrower LLC 4,875 % fällig am 01.05.2029	6.000	5.113	0,16	PDC Energy, Inc. 5,750 % fällig am 15.05.2026	2.000	1.912	0,06	Spectrum Brands, Inc. 3,875 % fällig am 15.03.2031	3.000	2.337	0,08
Moog, Inc. 4,250 % fällig am 15.12.2027	4.000	3.707	0,12								
MPH Acquisition Holdings LLC 5,500 % fällig am 01.09.2028 5,750 % fällig am 01.11.2028 (h)	5.000 5.000	3.911 3.336	0,13 0,11								
MPT Operating Partnership LP 2,500 % fällig am 24.03.2026 3,500 % fällig am 15.03.2031	£ 2.125 \$ 3.000	2.036 2.063	0,07 0,07								
MSCI, Inc. 3,250 % fällig am 15.08.2033 3,875 % fällig am 15.02.2031 4,000 % fällig am 15.11.2029	1.000 2.500 5.000	774 2.083 4.364	0,02 0,07 0,14								

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
4,000 % fällig am 01.10.2026	€	2.000	0,06	4,750 % fällig am 15.02.2029	\$	7.000	0,20	NON-AGENCY-MBS			
5,000 % fällig am 01.10.2029	\$	2.000	0,06	6,250 % fällig am 15.04.2025		5.000	0,16	Bear Stearns ALT-A Trust			
5,750 % fällig am 15.07.2025		480	0,02	Uber Technologies, Inc.				3,734 % fällig am 25.03.2036 ^	\$	46	0,00
Spirit AeroSystems, Inc.				4,500 % fällig am 15.08.2029		7.000	0,20	Countrywide Alternative Loan Trust			
7,500 % fällig am 15.04.2025		3.000	2,971	United Airlines, Inc.				5,500 % fällig am 25.11.2035 ^	1.126	710	0,03
9,375 % fällig am 30.11.2029		3.000	3,162	4,375 % fällig am 15.04.2026		4.000	0,12	Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust			
Sprint Capital Corp.				4,625 % fällig am 15.04.2029		10.000	0,28	4,649 % fällig am 19.10.2036 ^	354	210	0,01
8,750 % fällig am 15.03.2032		10.000	11,924	Univision Communications, Inc.				HarborView Mortgage Loan Trust			
Sprint LLC				4,500 % fällig am 01.05.2029		8.000	0,22	4,599 % fällig am 19.03.2037	79	70	0,00
7,625 % fällig am 15.02.2025		10.000	10,345	5,125 % fällig am 15.02.2025		4.000	0,12	Residential Funding Mortgage Securities, Inc. Trust			
SRS Distribution, Inc.				6,625 % fällig am 01.06.2027		5.000	0,16	4,307 % fällig am 25.02.2036 ^	88	75	0,00
4,625 % fällig am 01.07.2028		7.000	6,214	Venture Global Calcasieu Pass LLC				Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust			
6,000 % fällig am 01.12.2029		2.500	1,993	3,875 % fällig am 15.08.2029		3.250	0,09	2,888 % fällig am 25.05.2047 ^	29	4	0,00
6,125 % fällig am 01.07.2029		5.000	4,049	3,875 % fällig am 01.11.2033		2.500	0,07	3,018 % fällig am 25.05.2046 ^	74	58	0,00
Standard Industries, Inc.				4,125 % fällig am 15.08.2031		3.350	0,09				
2,250 % fällig am 21.11.2026	€	20.000	18,343	Vertiv Group Corp.							
3,375 % fällig am 15.01.2031	\$	4.000	3,018	4,125 % fällig am 15.11.2028		9.000	0,25				
4,375 % fällig am 15.07.2030		2.500	2,043	ViaSat, Inc.							
4,750 % fällig am 15.01.2028		5.000	4,507	5,625 % fällig am 15.09.2025		3.000	0,09				
Staples, Inc.				5,625 % fällig am 15.04.2027		825	0,02				
7,500 % fällig am 15.04.2026		5.000	4,314	6,500 % fällig am 15.07.2028		3.000	0,07				
Station Casinos LLC				Victoria's Secret & Co.							
4,500 % fällig am 15.02.2028		3.000	2,613	4,625 % fällig am 15.07.2029		4.000	0,10				
Suburban Propane Partners LP				WESCO Distribution, Inc.							
5,000 % fällig am 01.06.2031		5.000	4,256	7,250 % fällig am 15.06.2028		7.500	0,25				
Summer BC Bidco LLC				Western Midstream Operating LP							
5,500 % fällig am 31.10.2026		5.000	4,063	5,450 % fällig am 01.04.2044		2.250	0,06				
Syneos Health, Inc.				5,500 % fällig am 01.02.2050		7.000	0,19				
3,625 % fällig am 15.01.2029		5.000	3,988	White Cap Buyer LLC							
Tallgrass Energy Partners LP				6,875 % fällig am 15.10.2028		7.375	0,21				
5,500 % fällig am 15.01.2028		5.000	4,442	White Cap Parent LLC (8,250 % bar oder 8,250 % PIK)							
6,000 % fällig am 31.12.2030		1.000	866	8,250 % fällig am 15.03.2026 (a)		3.000	0,08				
7,500 % fällig am 01.10.2025		2.000	2,021	WMG Acquisition Corp.							
Team Health Holdings, Inc.				2,250 % fällig am 15.08.2031	€	3.500	0,09				
3,625 % fällig am 01.02.2025 (h)		7.000	4,045	2,750 % fällig am 15.07.2028		2.500	0,08				
TEGNA, Inc.				3,875 % fällig am 15.07.2030	\$	5.000	0,14				
4,625 % fällig am 15.03.2028		3.000	2,853	WR Grace Holdings LLC							
4,750 % fällig am 15.03.2026		2.000	1,943	4,875 % fällig am 15.06.2027		5.000	0,14				
5,000 % fällig am 15.09.2029		5.000	4,755	5,625 % fällig am 15.08.2029		3.000	0,08				
Tenet Healthcare Corp.				WW International, Inc.							
4,375 % fällig am 15.01.2030		6.750	5,854	4,500 % fällig am 15.04.2029		2.500	0,04				
4,625 % fällig am 15.06.2028		5.000	4,482	Wyndham Hotels & Resorts, Inc.							
4,875 % fällig am 01.01.2026		2.000	1,895	4,375 % fällig am 15.08.2028		5.000	0,14				
5,125 % fällig am 01.11.2027		5.000	4,661	Wynn Las Vegas LLC							
6,125 % fällig am 01.10.2028		10.000	8,974	4,250 % fällig am 30.05.2023		2.500	0,08				
6,125 % fällig am 15.06.2030		5.000	4,773	5,250 % fällig am 15.05.2027		5.000	0,15				
TerraForm Power Operating LLC				5,500 % fällig am 01.03.2025		2.000	0,06				
4,750 % fällig am 15.01.2030		1.500	1,308	Yum! Brands, Inc.							
5,000 % fällig am 31.01.2028		6.500	5,861	3,625 % fällig am 15.03.2031		5.000	0,14				
TK Elevator U.S. Newco, Inc.				4,625 % fällig am 31.01.2032		1.000	0,03				
5,250 % fällig am 15.07.2027		3.950	3,514	6,875 % fällig am 15.11.2037		2.000	0,07				
TransDigm, Inc.				Zayo Group Holdings, Inc.							
4,625 % fällig am 15.01.2029		8.000	7,048	4,000 % fällig am 01.03.2027		5.000	0,12				
5,500 % fällig am 15.11.2027		8.000	7,529	6,125 % fällig am 01.03.2028		3.000	0,06				
6,250 % fällig am 15.03.2026		6.000	5,930	ZoomInfo Technologies LLC							
Travel + Leisure Co.				3,875 % fällig am 01.02.2029		5.000	0,14				
4,625 % fällig am 01.03.2030		5.000	4,155								
6,625 % fällig am 31.07.2026		4.000	3,920								
TriNet Group, Inc.											
3,500 % fällig am 01.03.2029		5.000	4,117								
Triumph Group, Inc.											
8,875 % fällig am 01.06.2024		1.931	1,968								
Twilio, Inc.											
3,625 % fällig am 15.03.2029		4.000	3,255								
3,875 % fällig am 15.03.2031		3.000	2,384								
U.S. Foods, Inc.											
4,625 % fällig am 01.06.2030		2.250	1,984								

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kapital- betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions- geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse	
								Pensions- geschäft ⁽¹⁾	% des Netto- vermögens
FICC	1,900 %	30.12.2022	03.01.2023	\$ 7.812	U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 29.06.2023	\$ (7.968)	\$ 7.812	\$ 7.813	0,25
NOM	4,320	30.12.2022	03.01.2023	3.600	U.S. Treasury Bonds 3,000 % fällig am 15.11.2044	(3.674)	3.600	3.602	0,12
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (11.642)	\$ 11.412	\$ 11.415	0,37

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global High Yield Bond Fund (Forts.)

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

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Netto- vermögens
Euro-Bobl March Futures	Short	03.2023	750	\$ 933	0,03
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ 933	0,03

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Netto- vermögens
CDX.HY-38 5-Year Index	5,000 %	20.06.2027	\$ 99.000	\$ 1.853	0,06
CDX.HY-39 5-Year Index	5,000	20.12.2027	100.000	1.438	0,04
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate				\$ 3.291	0,10

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

⁽²⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definieren.

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

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

DEWISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2023	\$ 1.917	€ 1.818	\$ 24	\$ 0	\$ 24	0,00
BRC	01.2023	20.530	€ 19.232	4	0	4	0,00
CBK	01.2023	€ 323	\$ 343	0	(1)	(1)	0,00
	01.2023	\$ 2.370	€ 2.229	10	0	10	0,00
JPM	01.2023	£ 31.141	\$ 37.604	138	0	138	0,01
MBC	01.2023	€ 26.196	27.459	0	(511)	(511)	(0,02)
	01.2023	£ 1.827	2.227	29	0	29	0,00
	01.2023	\$ 4.745	€ 4.459	16	0	16	0,00
	02.2023	CAD 2.287	\$ 1.726	37	0	37	0,00
MYI	01.2023	€ 3.277	3.495	0	(2)	(2)	0,00
	01.2023	£ 751	904	0	0	0	0,00
	01.2023	SGD 5	4	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 230	€ 216	1	0	1	0,00
	01.2023	5.122	£ 4.249	0	(11)	(11)	0,00
	01.2023	2	SGD 3	0	0	0	0,00
SCX	01.2023	€ 726.482	\$ 756.158	0	(19.510)	(19.510)	(0,63)
				\$ 259	\$ (20.035)	\$ (19.776)	(0,64)

ABGESICHERTE DEWISENTERMINKONTRAKTE

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilsklasse Institutional CHF (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2023	\$ 11.631	CHF 11.000	\$ 266	\$ 0	\$ 266	0,01
CBK	01.2023	20.138	19.025	439	0	439	0,01
MBC	01.2023	CHF 82	\$ 89	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 44	CHF 40	0	0	0	0,00
MYI	01.2023	CHF 3.594	\$ 3.852	0	(35)	(35)	0,00
SCX	01.2023	\$ 16	CHF 15	0	0	0	0,00
				\$ 705	\$ (35)	\$ 670	0,02

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Investor EUR (Hedged) thesaurierend, Class E EUR (Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2023	\$ 44	€ 42	\$ 1	\$ 0	\$ 1	0,00
BPS	01.2023	€ 543	\$ 579	0	(1)	(1)	0,00
CBK	01.2023	2.769	2.939	0	(18)	(18)	0,00
	01.2023	\$ 377.863	€ 364.447	11.258	0	11.258	0,36
MBC	01.2023	€ 4.014	\$ 4.270	0	(16)	(16)	0,00
	01.2023	\$ 425.626	€ 406.074	7.941	0	7.941	0,26
SCX	01.2023	402.913	387.100	10.396	0	10.396	0,33
				\$ 29.596	\$ (35)	\$ 29.561	0,95

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend, Institutional GBP (Hedged) ausschüttend und Class E GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2023	£ 39.627	\$ 48.930	\$ 1.256	\$ 0	\$ 1.256	0,04
	01.2023	\$ 482	£ 400	0	(1)	(1)	0,00
BPS	01.2023	£ 60	\$ 72	0	0	0	0,00
BRC	01.2023	4.265	5.137	5	0	5	0,00
	01.2023	\$ 584	£ 486	0	0	0	0,00
JPM	01.2023	150.875	124.945	0	(554)	(554)	(0,02)
MBC	01.2023	£ 932	\$ 1.138	17	0	17	0,00
	01.2023	\$ 150.808	£ 125.730	610	(154)	456	0,02
MYI	01.2023	£ 205	\$ 253	6	0	6	0,00
	01.2023	\$ 554	£ 453	0	(10)	(10)	0,00
TOR	01.2023	150.004	124.765	100	0	100	0,00
UAG	01.2023	£ 136	\$ 169	5	0	5	0,00
				\$ 1.999	\$ (719)	\$ 1.280	0,04

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilklasse Class E SGD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	01.2023	SGD 7	\$ 5	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
BOA	01.2023	\$ 1.464	SGD 2.009	34	0	34	0,01
BPS	01.2023	1.461	2.005	34	0	34	0,00
BRC	01.2023	1	2	0	0	0	0,00
GLM	01.2023	182	247	3	0	3	0,00
MBC	01.2023	SGD 37	\$ 28	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 1.589	SGD 2.172	31	0	31	0,00
RBC	01.2023	15	20	0	0	0	0,00
RYL	01.2023	23	31	0	0	0	0,00
SCX	01.2023	1	1	0	0	0	0,00
UAG	01.2023	SGD 10	\$ 7	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 14	SGD 19	0	0	0	0,00
				\$ 102	\$ 0	\$ 102	0,01

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ 11.837 0,38

Summe Anlagen

\$ 3.079.842 99,26

Sonstige Aktiva und Passiva

\$ 23.026 0,74

Nettovermögen

\$ 3.102.868 100,00

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

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

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.

(b) Nullkuponwertpapier.

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

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

(e) Mit dem Fonds verbunden.

(f) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(g) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2021: 0,49 %):

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeitsdatum	Kaufdatum	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
Diamond Foreign Asset Co. (9,000 % bar oder 9,000 % PIK)	9,000 %	22.04.2027	12.05.2021	\$ 66	\$ 62	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global High Yield Bond Fund (Forts.)

(h) Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von 10.952 USD (31. Dezember 2021: 15.991 USD) wurden gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen zum 31. Dezember 2022 als Sicherheiten verpfändet.

Barmittel in Höhe von 205 USD (31. Dezember 2021: 0 USD) wurden gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen zum 31. Dezember 2022 als Sicherheiten erhalten.

Barmittel in Höhe von 20.021 USD (31. Dezember 2021: 18.614 EUR) wurden zum 31. Dezember 2022 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Wertpapier mit einem Gesamtmarktwert von 0 USD (31. Dezember 2021: 22 USD) und Barmittel in Höhe von 8.590 USD (31. Dezember 2021: 2.700 USD) wurden gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. zum 31. Dezember 2022 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 2.850.743	\$ 43	\$ 2.850.786
Investmentfonds	201.583	0	0	201.583
Pensionsgeschäfte	0	11.412	0	11.412
Finanzderivate ⁽³⁾	933	15.128	0	16.061
Summen	\$ 202.516	\$ 2.877.283	\$ 43	\$ 3.079.842

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

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 4.998	\$ 4.666.725	\$ 11.498	\$ 4.683.221
Investmentfonds	417.716	0	0	417.716
Finanzderivate ⁽³⁾	0	24.073	0	24.073
Summen	\$ 422.714	\$ 4.690.798	\$ 11.498	\$ 5.125.010

⁽¹⁾ Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

⁽²⁾ Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

⁽³⁾ Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions- geschäften	% des Nettovermögens
BRC	(2,000) %	16.12.2022	TBD ⁽¹⁾	\$ (1.281)	\$ (1.280)	(0,04)
	(0,500)	16.12.2022	TBD ⁽¹⁾	(596)	(596)	(0,02)
	(0,250)	21.09.2022	TBD ⁽¹⁾	€ (1.606)	(1.713)	(0,06)
	0,600	23.05.2022	TBD ⁽¹⁾	£ (1.620)	(1.927)	(0,06)
FBF	2,500	16.12.2022	TBD ⁽¹⁾	\$ (2.416)	(2.419)	(0,08)
JML	(1,000)	24.06.2022	TBD ⁽¹⁾	£ (2.068)	(2.462)	(0,08)
Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte					\$ (10.397)	(0,34)

⁽¹⁾ Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung des Marktwerts der außerbörslich gehandelten Finanzderivate und (erhaltenen)/verpfändeten Sicherheiten nach Kontrahenten zum 31. Dezember 2022 und 31. Dezember 2021:

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2022			Zum 31. Dez. 2021		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾
BOA	\$ 1.580	\$ (1.340)	\$ 240	\$ (54)	\$ 0	\$ (54)
BPS	33	0	33	(254)	0	(254)
BRC	9	0	9	369	0	369
CBK	11.688	(11.530)	158	(53)	0	(53)
GLM	3	(10)	(7)	142	(130)	12
HUS	k. A.	k. A.	k. A.	(176)	0	(176)
JPM	(416)	50	(366)	5.256	(4.300)	956
MBC	8.000	(7.460)	540	k. A.	k. A.	k. A.
MYC	k. A.	k. A.	k. A.	739	(710)	29
MYI	(51)	0	(51)	149	82	231
RBC	k. A.	k. A.	k. A.	5.747	(4.620)	1.127
SCX	(9.114)	8.540	(574)	12.491	(8.950)	3.541
TOR	100	(180)	(80)	(4.226)	2.640	(1.586)
UAG	5	0	5	4.923	(3.590)	1.333

⁽¹⁾ Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2022:

	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	49,58	45,83
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	42,29	44,25
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,01	0,53
Investmentfonds	6,50	8,08
Pensionsgeschäfte	0,37	k. A.
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,03	k. A.
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,10	(0,02)
Freiverkehrsfinanzderivate	0,38	0,48
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(0,34)	(0,31)

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2022 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
Belgien	0,22	0,25
Bermuda	0,40	0,33
Kanada	1,55	2,27
Kaimaninseln	0,78	0,65
Dänemark	0,09	k. A.
Frankreich	1,95	2,26
Deutschland	2,67	3,19
Irland	0,22	0,26
Italien	3,75	3,55
Jersey, Kanalinseln	0,20	0,19
Liberia	0,67	0,19
Luxemburg	2,47	2,65
Mauritius	k. A.	0,13
Multinational	1,67	1,82
Niederlande	5,00	4,22
Norwegen	0,34	0,23
Panama	0,53	0,65
Spanien	1,70	1,19
Schweden	0,91	0,85
Schweiz	0,11	0,10
Großbritannien	3,84	4,19
USA	59,77	59,85
Kurzfristige Instrumente	3,04	1,59
Investmentfonds	6,50	8,08
Pensionsgeschäfte	0,37	k. A.
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,03	k. A.
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,10	(0,02)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Total Return Swaps auf Indizes	k. A.	0,02
Devisenterminkontrakte	(0,64)	(0,23)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	1,02	0,69
Sonstige Aktiva und Passiva	0,74	0,85
Nettovermögen	100,00	100,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Investment Grade Credit Fund

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTO-VERMÖGENS	% DES	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTO-VERMÖGENS	% DES	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTO-VERMÖGENS	% DES
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE					BRASILIEN					CHINA				
AUSTRALIEN					UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Boral Finance Pty. Ltd.	\$	415	\$	371	0,00	Viking Cruises Ltd.	4.300	4.544	0,04	Avolon Holdings Funding Ltd.	14.256	11.416	0,11	
3,750 % fällig am 14.12.2028						13,000 % fällig am 15.05.2025		51.820	0,49	2,528 % fällig am 18.11.2027	8.300	7.674	0,07	
										2,875 % fällig am 15.02.2025	3.600	3.268	0,03	
										4,250 % fällig am 15.04.2026	2.310	2.107	0,02	
										4,375 % fällig am 01.05.2026	18.600	17.703	0,17	
										5,500 % fällig am 15.01.2026				
										China Modern Dairy Holdings Ltd.	9.400	7.991	0,08	
										2,125 % fällig am 14.07.2026				
										Geely Automobile Holdings Ltd.	11.600	11.587	0,11	
										3,625 % fällig am 25.01.2023				
										Goodman HK Finance	3.500	3.423	0,03	
										4,375 % fällig am 19.06.2024				
										Melco Resorts Finance Ltd.	23.260	21.401	0,20	
										4,875 % fällig am 06.06.2025	17.850	15.736	0,15	
										5,250 % fällig am 26.04.2026	4.727	3.801	0,04	
										5,375 % fällig am 04.12.2029	11.555	9.929	0,10	
										5,625 % fällig am 17.07.2027	2.600	2.178	0,02	
										5,750 % fällig am 21.07.2028				
										MGM China Holdings Ltd.	8.300	7.819	0,07	
										5,250 % fällig am 18.06.2025	1.255	1.213	0,01	
										5,375 % fällig am 15.05.2024	6.746	6.310	0,06	
										5,875 % fällig am 15.05.2026				
										Park Aerospace Holdings Ltd.	18.490	18.446	0,18	
										4,500 % fällig am 15.03.2023				
										QNB Finance Ltd.	14.500	14.206	0,14	
										3,500 % fällig am 28.03.2024				
										Sands China Ltd.	1.000	858	0,01	
										2,800 % fällig am 08.03.2027	1.500	1.227	0,01	
										3,350 % fällig am 08.03.2029	3.900	3.604	0,03	
										4,300 % fällig am 08.01.2026	6.800	6.510	0,06	
										5,625 % fällig am 08.08.2025	19.048	17.861	0,17	
										5,900 % fällig am 08.08.2028				
										Sunny Optical Technology Group Co. Ltd.	6.914	6.907	0,07	
										3,750 % fällig am 23.01.2023 (j)				
										Tencent Holdings Ltd.	11.900	9.702	0,09	
										2,390 % fällig am 03.06.2030	5.200	3.297	0,03	
										3,240 % fällig am 03.06.2050	700	421	0,00	
										3,290 % fällig am 03.06.2060	48.350	44.600	0,42	
										3,975 % fällig am 11.04.2029				
										Tencent Music Entertainment Group	2.800	2.121	0,02	
										2,000 % fällig am 03.09.2030				
										Tingyi Cayman Islands Holding Corp.	11.500	10.351	0,10	
										1,625 % fällig am 24.09.2025				
										Wynn Macau Ltd.	4.635	4.383	0,04	
										4,875 % fällig am 01.10.2024	20.557	18.890	0,18	
										5,500 % fällig am 15.01.2026	2.000	1.751	0,02	
										5,500 % fällig am 01.10.2027				
										Xiaomi Best Time International Ltd.	1.900	1.380	0,01	
										2,875 % fällig am 14.07.2031				
										Zhongsheng Group Holdings Ltd.	7.100	6.355	0,06	
										3,000 % fällig am 13.01.2026				
											316.004	3,00		
										Summe Kaimaninseln		346.328	3,29	
										CHILE				
										UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
										Banco Santander Chile	4.100	3.896	0,04	
										2,700 % fällig am 10.01.2025				
										Celso Redes Operacion Chile S.A.	1.524	1.307	0,01	
										5,200 % fällig am 22.06.2047				
										Empresa Electrica Cochran SpA	1.062	984	0,01	
										5,500 % fällig am 14.05.2027				
										Summe Chile		6.187	0,06	
										CHINA				
										UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
										Bank of China Luxembourg S.A.	€	11.800	12.585	0,12
										0,125 % fällig am 16.01.2023				
										State Grid Overseas Investment BVI Ltd.	12.223	11.421	0,11	
										0,797 % fällig am 05.08.2026	5.400	4.767	0,04	
										2,125 % fällig am 02.05.2030				
										Summe China		28.773	0,27	

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
ZYPERN				SEB S.A.				BESCHREIBUNG			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				1,375 % fällig am 16.06.2025				1,750 % fällig am 24.11.2028			
Atrium Finance PLC				€ 6.900 \$ 6.851 0,06				€ 10.100 \$ 7.417 0,07			
2,625 % fällig am 05.09.2027				€ 12.100 \$ 9.053 0,09				Summe Guernsey, Kanalinseln			
DÄNEMARK				Societe Generale S.A.				HONGKONG			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				1,488 % fällig am 14.12.2026				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
GN Store Nord A/S				\$ 13.400 11.660 0,11				Huarong Finance Co. Ltd.			
0,875 % fällig am 25.11.2024				25.000 19.291 0,18				2,125 % fällig am 30.09.2023			
1,500 % fällig am 01.10.2053				2.000 1.855 0,02				\$ 17.000 16.363 0,15			
DKK 8.879 986 0,01				TDF Infrastructure SASU				Lenovo Group Ltd.			
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab				€ 9.100 7.392 0,07				3,421 % fällig am 02.11.2030			
1,000 % fällig am 01.10.2050				7.300 7.132 0,07				Summe Hongkong			
4.155 441 0,00				Ubisoft Entertainment S.A.				INDIEN			
Nykredit Realkredit A/S				18.600 15.404 0,15				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
1,000 % fällig am 01.10.2050				6.500 6.921 0,07				Adani Transmission Step-One Ltd.			
102.21 2 10.812 0,10				Worldline S.A.				4,250 % fällig am 21.05.2036			
1,000 % fällig am 01.10.2053				9.600 9.873 0,09				17.661 13.613 0,13			
1,500 % fällig am 01.10.2053				260.051 2,47				Bharti Airtel Ltd.			
9.456 975 0,01				KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNGEN				4,375 % fällig am 10.06.2025			
1,500 % fällig am 01.10.2053				Numericable Group S.A.				5.000 4.862 0,05			
7.010 776 0,01				4,605 % fällig am 31.07.2025				ReNew Power Pvt Ltd.			
Realkredit Danmark A/S				4,228 4,307 0,04				8.300 7.979 0,07			
1,000 % fällig am 01.10.2050				264.358 2,51				5,875 % fällig am 05.03.2027			
1,000 % fällig am 01.10.2053				DEUTSCHLAND				STAATSEMISSIONEN			
1,500 % fällig am 01.10.2053				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Export-Import Bank of India			
34.516 3.654 0,03				Bayer AG				3,875 % fällig am 01.02.2028			
3.680 361 0,00				0,625 % fällig am 12.07.2031				Summe Indien			
7.018 777 0,01				1.000 805 0,01				26.733 0,25			
Summe Dänemark				32.048 0,30				INDONESIEN			
FINNLAND				Deutsche Bank AG				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				1,625 % fällig am 20.01.2027				Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT			
Balder Finland Oyj				18.600 17.533 0,17				4,625 % fällig am 20.07.2023			
1,000 % fällig am 20.01.2029				40.300 33.874 0,32				Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara			
€ 14.100 10.081 0,10				2.311 % fällig am 16.11.2027				4,000 % fällig am 30.06.2050			
Nokia Oyj				\$ 2.800 2.378 0,02				7.800 5.597 0,05			
4,375 % fällig am 12.06.2027				€ 15.000 16.778 0,16				4,875 % fällig am 17.07.2049			
\$ 2.800 2.648 0,02				3.547 % fällig am 18.09.2031				700 554 0,01			
Nordea Bank Abp				\$ 12.643 10.163 0,10				2,300 2.189 0,02			
3,750 % fällig am 01.03.2029 (f)(h)				3.729 % fällig am 14.01.2032 (i)				6,150 % fällig am 21.05.2048			
4.000 3.098 0,03				11.235 8.260 0,08				Summe Indonesien			
SATO Oyj				3.961 % fällig am 26.11.2025				6.572 0,06			
1,375 % fällig am 24.02.2028				10.000 % fällig am 01.12.2027 (f)(h)				Summe Indonesien			
€ 6.671 5.170 0,05				€ 3.600 3.982 0,04				17.803 0,17			
Summe Finnland				Frappat AG Frankfurt Airport Services Worldwide				IRLAND			
20.997 0,20				1,625 % fällig am 09.07.2024				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
FRANKREICH				1,875 % fällig am 31.03.2028				AerCap Ireland Capital DAC			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				2,125 % fällig am 09.07.2027				1,150 % fällig am 29.10.2023			
Accor S.A.				Hamburg Commercial Bank AG				1,650 % fällig am 29.10.2024			
2,375 % fällig am 29.11.2028				0,500 % fällig am 22.09.2026				2,900 2.677 0,03			
4.500 4.120 0,04				100 91 0,00				2,450 % fällig am 29.10.2026			
Altarea S.C.A.				IHO Verwaltungs GmbH (3,625 % bar oder 4,375 % PIK)				2,875 % fällig am 14.08.2024			
1,750 % fällig am 16.01.2030				300 293 0,00				3,150 % fällig am 15.02.2024			
1,875 % fällig am 17.01.2028				300 293 0,00				4,450 % fällig am 01.10.2025			
BNP Paribas S.A.				IHO Verwaltungs GmbH (3,750 % bar oder 4,500 % PIK)				4,450 % fällig am 03.04.2026			
1,675 % fällig am 30.06.2027				19.800 18.432 0,17				4,875 % fällig am 16.01.2024			
1,904 % fällig am 30.09.2028				Kreditanstalt fuer Wiederaufbau				5,003 % fällig am 29.09.2023			
2,219 % fällig am 09.06.2026				4.600 4.896 0,05				AIB Group PLC			
2,591 % fällig am 20.01.2028				6.000 % fällig am 15.03.2023				4,263 % fällig am 10.04.2025			
3,500 % fällig am 16.11.2027				Sixt SE				Bank of Ireland Group PLC			
5,198 % fällig am 10.01.2030				1,750 % fällig am 09.12.2024				6,000 % fällig am 01.09.2025 (f)(h)			
7,750 % fällig am 16.08.2029 (f)(h)				11.070 11.405 0,11				6,253 % fällig am 16.09.2026			
10.000 9.900 0,09				Volkswagen Bank GmbH				€ 5.109 5.088 0,05			
BPCE S.A.				1,875 % fällig am 31.01.2024				\$ 8.700 8.636 0,08			
2,125 % fällig am 13.10.2046 (h)				7.200 7.532 0,07				GE Capital UK Funding Unlimited Co.			
€ 10.000 7.476 0,07				Volkswagen Financial Services AG				5,875 % fällig am 18.01.2033			
Bureau Veritas S.A.				0,000 % fällig am 12.02.2025 (d)				Perrigo Finance Unlimited Co.			
1,250 % fällig am 07.09.2023				1,500 % fällig am 01.10.2024				4,900 % fällig am 15.12.2044			
1,875 % fällig am 06.01.2025				4.200 4.296 0,04				\$ 5.300 3.592 0,03			
15.400 15.623 0,15				Volkswagen Leasing GmbH				SMBC Aviation Capital Finance DAC			
Credit Agricole S.A.				1,125 % fällig am 04.04.2024				3,550 % fällig am 15.04.2024			
4,000 % fällig am 23.12.2027 (f)(h)				1,375 % fällig am 20.01.2025							
€ 2.900 2.743 0,03				1,500 % fällig am 19.06.2026							
7,500 % fällig am 23.06.2026 (f)(h)				2.600 2.629 0,02							
€ 5.138 6.013 0,06				7.500 7.274 0,07							
Holding d'Infrastructures de Transport SASU				Vonovia SE							
1,475 % fällig am 18.01.2031				0,250 % fällig am 01.09.2028							
€ 12.200 10.189 0,10				8.900 7.290 0,07							
1,625 % fällig am 18.09.2029				203.374 1,93							
3.700 3.249 0,03				STAATSEMISSIONEN							
Holding d'Infrastructures des Metiers de l'Environnement				Bundesrepublik Deutschland							
0,625 % fällig am 16.09.2028				1,300 % fällig am 15.10.2027							
3.200 2.680 0,03				5.100 5.143 0,05							
Indigo Group S.A.S.				Summe Deutschland							
1,625 % fällig am 19.04.2028				208.517 1,98							
9.800 9.057 0,09				GUERNSEY, KANALINSELN							
New Immo Holding S.A.				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL							
2,750 % fällig am 26.11.2026				Amdocs Ltd.							
2.800 2.546 0,02				2,538 % fällig am 15.06.2030							
Peugeot Invest				\$ 5.975 4.850 0,04							
1,875 % fällig am 30.10.2026				Globalworth Real Estate Investments Ltd.							
18.500 16.233 0,15				2,950 % fällig am 29.07.2026							
				€ 16.900 14.367 0,14							
				3,000 % fällig am 29.03.2025							
				1.100 1.030 0,01							
				Sirius Real Estate Ltd.							
				1,125 % fällig am 22.06.2026							
				8.500 7.098 0,07							

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
4,125 % fällig am 15.07.2023	\$ 6.600	\$ 6.532	0,06	JERSEY, KANALINSELN				MEXIKO			
Zurich Finance Ireland Designated Activity Co.				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				STAMMAKTIVEN			
5,125 % fällig am 23.11.2052	£ 3.700	4.048	0,04	AA Bond Co. Ltd.	£ 400	\$ 456	0,00	Desarrolladora Homex S.A.B. de C.V. (c)	427.064	\$ 1	0,00
Summe Irland		81.752	0,78	5,500 % fällig am 31.07.2050	7.782	8.121	0,08				
				G City Europe Ltd.	€ 24.900	22.320	0,21				
ITALIEN				Heathrow Funding Ltd.		2.800	0,02				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				HSBC Bank Capital Funding Sterling LP		22.611	0,22				
Aerporti di Roma SpA	€ 2.400	2.093	0,02	5,844 % fällig am 05.11.2031 (f)	£ 18.367						
1,750 % fällig am 30.07.2031	11.700	9.326	0,09	Summe Jersey, Kanalinseln		55.841	0,53				
5,441 % fällig am 20.02.2023	£ 2.500	3.003	0,03	LUXEMBURG							
AMCO - Asset Management Co. SpA	€ 35.900	37.951	0,36	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL							
1,500 % fällig am 17.07.2023				Altice Financing S.A.	€ 1.300	1.126	0,01				
Atlantia SpA				4,250 % fällig am 15.08.2029							
1,625 % fällig am 03.02.2025	14.100	14.091	0,13	Aroundtown S.A.		10.891	0,10				
1,875 % fällig am 13.07.2027	15.770	14.344	0,14	0,000 % fällig am 16.07.2026 (d)	14.300	10.891	0,10				
1,875 % fällig am 12.02.2028	1.600	1.424	0,01	0,375 % fällig am 15.04.2027	2.400	1.699	0,02				
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA				3,000 % fällig am 16.10.2029	£ 1.300	987	0,01				
1,875 % fällig am 09.01.2026	27.200	24.969	0,24	5,375 % fällig am 21.03.2029	\$ 48.200	36.539	0,35				
2,625 % fällig am 28.04.2025	16.100	15.593	0,15	Becton Dickinson Euro Finance SARRL		3.968	0,04				
3,625 % fällig am 24.09.2024	8.925	9.065	0,09	0,334 % fällig am 13.08.2028	€ 4.500	3.444	0,03				
Intesa Sanpaolo SpA				1,336 % fällig am 13.08.2041	5.180						
4,000 % fällig am 23.09.2029	\$ 10.600	9.090	0,09	Bevco Lux SARRL		2.976	0,03				
5,017 % fällig am 26.06.2024	5.900	5.675	0,05	1,000 % fällig am 16.01.2030	3.700	2.134	0,20				
5,710 % fällig am 15.01.2026	14.819	14.257	0,13	1,500 % fällig am 16.09.2027	23.000	21.348	0,20				
7,750 % fällig am 11.01.2027 (f)(h)	€ 22.042	22.755	0,21	CK Hutchison Group Telecom Finance S.A.		3.454	0,03				
Societa per Azioni Esercizi Aeroportuali SEA SpA				0,750 % fällig am 17.04.2026	3.600	7.109	0,07				
3,500 % fällig am 09.10.2025	2.800	2.780	0,03	1,125 % fällig am 17.10.2028	8.000						
UniCredit SpA				CPI Property Group S.A.		10.500	0,06				
2,200 % fällig am 22.07.2027	2.150	2.082	0,02	1,500 % fällig am 27.01.2031	10.500	6.504	0,06				
5,459 % fällig am 30.06.2035	\$ 4.194	3.416	0,03	1,625 % fällig am 23.04.2027	34.550	26.342	0,25				
7,296 % fällig am 02.04.2034	12.230	11.231	0,11	1,750 % fällig am 14.01.2030	10.900	7.098	0,07				
7,830 % fällig am 04.12.2023	62.000	62.656	0,59	2,750 % fällig am 12.05.2026	15.300	12.860	0,12				
		265.801	2,52	2,750 % fällig am 22.01.2028	£ 2.100	1.692	0,02				
STAATSEMISSIONEN				Cromwell Ereit Lux Finco SARRL		16.892	0,16				
Italy Government International Bond				2,125 % fällig am 19.11.2025	€ 19.575						
6,875 % fällig am 27.09.2023	10.700	10.777	0,10	Gazprom PJSC Via Gaz Capital S.A.		500	0,00				
Summe Italien		276.578	2,62	2,949 % fällig am 24.01.2024	500	403	0,00				
JAPAN				3,125 % fällig am 17.11.2023	1.800	1.374	0,01				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Helvetia Europe S.A.		4.700	0,04				
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.				2,750 % fällig am 30.09.2041		3.899	0,04				
0,953 % fällig am 19.07.2025	14.400	13.388	0,13	Lincoln Financing SARRL		3.300	0,03				
1,538 % fällig am 20.07.2027	9.500	8.248	0,08	3,625 % fällig am 01.04.2024		3.488	0,03				
2,048 % fällig am 17.07.2030	15.400	12.182	0,12	Logicor Financing SARRL		5.152	0,05				
3,195 % fällig am 18.07.2029	5.600	4.901	0,05	1,500 % fällig am 13.07.2026	5.700	36.064	0,34				
3,273 % fällig am 19.09.2025	€ 3.100	3.259	0,03	1,625 % fällig am 15.07.2027	41.500	1.404	0,01				
Mizuho Financial Group, Inc.				2,750 % fällig am 15.01.2030	£ 1.530	2.169	0,02				
1,979 % fällig am 08.09.2031	\$ 7.100	5.445	0,05	3,250 % fällig am 13.11.2028	€ 2.409						
2,201 % fällig am 10.07.2031	9.100	7.123	0,07	Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.		7.147	0,07				
Nissan Motor Co. Ltd.				5,125 % fällig am 29.10.2022 ^	\$ 61.150	1.642	0,02				
1,940 % fällig am 15.09.2023	€ 16.640	17.524	0,17	5,250 % fällig am 23.05.2023 ^ (h)	12.200						
2,652 % fällig am 17.03.2026	3.600	3.571	0,03			227.671	2,16				
3,201 % fällig am 17.09.2028	4.700	4.409	0,04	KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNGEN							
4,345 % fällig am 17.09.2027	\$ 16.820	15.278	0,14	Delos Finance SARRL		18.243	0,17				
4,810 % fällig am 17.09.2030	6.550	5.573	0,05	6,480 % fällig am 06.10.2023	18.243	18.239	0,17				
Nomura Holdings, Inc.				Summe Luxemburg		245.910	2,33				
1,851 % fällig am 16.07.2025	25.950	23.676	0,22	MAURITIUS							
2,172 % fällig am 14.07.2028	5.000	4.137	0,04	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL							
2,679 % fällig am 16.07.2030	1.800	1.443	0,01	Greenko Investment Co.		5.600	0,05				
2,710 % fällig am 22.01.2029	9.800	8.184	0,08	4,875 % fällig am 16.08.2023	5.600	5.495	0,05				
3,103 % fällig am 16.01.2030	4.500	3.763	0,04	Greenko Power Ltd.		3.629	0,03				
Sumitomo Mitsui Banking Corp.				4,300 % fällig am 13.12.2028		3.048	0,03				
2,440 % fällig am 18.06.2024	11.500	11.058	0,10	Greenko Solar Mauritius Ltd.		15.400	0,14				
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.				5,550 % fällig am 29.01.2025	15.400	14.534	0,14				
2,130 % fällig am 08.07.2030	3.500	2.774	0,03	5,950 % fällig am 29.07.2026	6.900	6.322	0,06				
2,696 % fällig am 16.07.2024	4.700	4.510	0,04	India Green Energy Holdings		9.900	0,09				
2,750 % fällig am 15.01.2030	2.600	2.187	0,02	5,375 % fällig am 29.04.2024							
3,102 % fällig am 17.01.2023	4.200	4.197	0,04	Summe Mauritius		38.930	0,37				
Suntory Holdings Ltd.											
2,250 % fällig am 16.10.2024	900	844	0,01								
Summe Japan		167.674	1,59								

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
BESCHREIBUNG				RUSSLAND				SUPRANATIONAL			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Syngenta Finance NV				Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd.				Europäische Bank für Wiederaufbau und Entwicklung			
3,375 % fällig am 16.04.2026	€ 18.100	\$ 18.263	0,17	1,832 % fällig am 10.09.2030 (h)	13.500	12.127	0,12	1,500 % fällig am 13.02.2025	\$ 5.200	\$ 4.889	0,05
4,441 % fällig am 24.04.2023	\$ 3.100	3.087	0,03	SP PowerAssets Ltd.	2.400	2.228	0,02	1,625 % fällig am 27.09.2024	500	475	0,00
4,892 % fällig am 24.04.2025	6.784	6.576	0,06	3,000 % fällig am 26.09.2027	2.400	2.228	0,02	Europäische Investitionsbank			
Volkswagen Financial Services NV				SAUDI-ARABIEN				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
0,875 % fällig am 20.02.2025				STAATSEMISSIONEN				0,750 % fällig am 15.11.2024	€ 15.350	17.344	0,17
1,125 % fällig am 18.09.2023	€ 7.000	7.612	0,07	Saudi Arabia Government International Bond	20.200	16.448	0,16	Summe Supranational		22.708	0,22
1,875 % fällig am 03.12.2024	13.700	16.080	0,15	2,250 % fällig am 02.02.2033	20.200	16.448	0,16	SCHWEDEN			
Vonovia Finance BV				SINGAPUR				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
0,500 % fällig am 14.09.2029	€ 500	393	0,00	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Castellum AB			
1,125 % fällig am 14.09.2034	1.000	676	0,01	Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd.	13.500	12.127	0,12	2,125 % fällig am 20.11.2023	€ 4.300	4.409	0,04
WPC Eurobond BV				SLOWAKEI				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
1,350 % fällig am 15.04.2028	5.400	4.803	0,05	STAATSEMISSIONEN				Fastighets AB Balder			
		259.999	2,47	Slovakia Government International Bond	500	418	0,00	1,125 % fällig am 29.01.2027 (j)	4.500	3.576	0,03
NON-AGENCY-MBS				SLOWENIEN				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
EMF-NL Prime BV				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Sagax AB			
2,178 % fällig am 17.04.2041	479	490	0,01	Nova Kreditna Banka Maribor d.d.	10.700	10.359	0,10	1,125 % fällig am 30.01.2027	4.200	3.630	0,04
Eurosaill BV				SUDAFRIKA				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
2,878 % fällig am 17.10.2040	197	209	0,00	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				2,250 % fällig am 13.03.2025	8.400	8.284	0,08
		699	0,01	AngloGold Ashanti Holdings PLC	5.500	4.805	0,05	Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB	18.600	13.882	0,13
STAATSEMISSIONEN				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				1,000 % fällig am 12.08.2027			
BNG Bank NV	\$ 9.300	8.735	0,08	3,750 % fällig am 01.10.2030	7.800	6.772	0,06	Summe Schweden		33.781	0,32
Summe Niederlande		269.433	2,56	Growthpoint Properties International Pty. Ltd.	3.050	3.039	0,03	SCHWEIZ			
NORWEGEN				STAATSEMISSIONEN				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Credit Suisse AG			
Yara International ASA	15.300	14.097	0,13	South Africa Government International Bond	10.500	86.060	0,81	6,500 % fällig am 08.08.2023 (h)	\$ 95.950	93.139	0,88
PANAMA				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Credit Suisse Group AG			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				2,125 % fällig am 15.11.2029	€ 1.700	1.456	0,01
Intercorp Financial Services, Inc.	5.600	4.952	0,05	10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR1.385.100	86.060	0,81	2,593 % fällig am 11.09.2025	\$ 18.030	15.950	0,15
4,125 % fällig am 19.10.2027				Summe Südafrika		100.676	0,95	4,194 % fällig am 01.04.2031	5.200	4.047	0,04
KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNGEN				STAATSEMISSIONEN				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				4,207 % fällig am 12.06.2024	31.150	30.376	0,29
Carnival Corp.	€ 13.966	14.367	0,13	Abertis Infraestructuras S.A.	€ 4.700	4.338	0,04	6,250 % fällig am 18.12.2024 (f)(h)	200	158	0,00
5,648 % fällig am 30.06.2025				Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.	3.200	3.291	0,03	6,375 % fällig am 21.08.2026 (f)(h)	7.000	5.034	0,05
Summe Panama		19.319	0,18	1,125 % fällig am 11.03.2027	3.600	3.441	0,03	7,500 % fällig am 17.07.2023 (f)(h)	14.600	11.704	0,11
PERU				STAATSEMISSIONEN				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UBS AG			
Banco de Credito del Peru S.A.	PEN 9.800	2.400	0,02	Summe Peru		132.172	1,25	5,125 % fällig am 15.05.2024 (h)	8.900	8.803	0,08
STAATSEMISSIONEN				STAATSEMISSIONEN				UBS Group AG			
Peru Government International Bond				Peru Government International Bond				1,494 % fällig am 10.08.2027	5.000	4.308	0,04
5,350 % fällig am 12.08.2040	1.800	353	0,00	5,350 % fällig am 12.08.2040	1.800	353	0,00	2,746 % fällig am 11.02.2033	3.300	2.559	0,03
5,400 % fällig am 12.08.2034	3.000	632	0,01	5,940 % fällig am 12.02.2029	53.150	12.795	0,12	3,126 % fällig am 13.08.2030	400	340	0,00
5,940 % fällig am 12.02.2029	53.150	12.795	0,12	6,350 % fällig am 12.08.2028	121.787	30.388	0,29	4,125 % fällig am 24.09.2025	58.990	57.418	0,55
6,350 % fällig am 12.08.2028	121.787	30.388	0,29	8,200 % fällig am 12.08.2026	311.700	85.604	0,81	Summe Schweiz		235.467	2,23
8,200 % fällig am 12.08.2026	311.700	85.604	0,81					THAILAND			
		129.772	1,23					UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
		132.172	1,25					UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
KATAR				SPANIEN				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
STAATSEMISSIONEN				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Qatar Government International Bond	\$ 11.300	10.371	0,10	Abertis Infraestructuras S.A.	€ 4.700	4.338	0,04	Bangkok Bank PCL			
4,400 % fällig am 16.04.2050				Banco de Sabadell S.A.	3.600	3.441	0,03	3,466 % fällig am 23.09.2036 (h)	9.200	7.211	0,07
RUMÄNIEN				STAATSEMISSIONEN				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
STAATSEMISSIONEN				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Romania Government International Bond				Banco Santander S.A.	€ 4.300	4.518	0,04	Türkei Airlines Pass-Through Trust			
1,375 % fällig am 02.12.2029	€ 3.425	2.669	0,02	1,500 % fällig am 14.04.2026	€ 4.300	4.518	0,04	4,200 % fällig am 15.09.2028	4.544	3.980	0,04
1,750 % fällig am 13.07.2030	7.650	5.705	0,05	Bankinter S.A.	€ 7.600	7.206	0,07	UKRAINE			
2,125 % fällig am 07.03.2028	7.200	6.432	0,06	0,875 % fällig am 08.07.2026	€ 7.600	7.206	0,07	STAATSEMISSIONEN			
2,625 % fällig am 02.12.2040	22.600	13.514	0,13	CaixaBank S.A.	5.400	4.071	0,04	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
2,875 % fällig am 13.04.2042	8.200	4.922	0,05	3,625 % fällig am 14.09.2028 (f)(h)	5.400	4.071	0,04	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Summe Rumänien		33.242	0,31	Summe Spanien		26.865	0,25	Barclays PLC			

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS			
SkyMiles IP Ltd. 7,993 % fällig am 20.10.2027	\$	12.200	12,459	0,12	Credit Suisse Mortgage Capital Certificates 3,240 % fällig am 26.06.2037	\$	4.901	4,629	0,05	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust 2,888 % fällig am 25.11.2046 ^	\$	2.130	1,692	0,02
Tibco Software, Inc. 9,180 % fällig am 30.03.2029	6.000	5.373	0,05	Credit Suisse Mortgage Capital Trust 3,197 % fällig am 27.05.2037	3.745	2.475	0,02	4,769 % fällig am 25.06.2037	3.252	2.869	0,03			
Trans Union LLC 6,634 % fällig am 01.12.2028	1.991	1.975	0,02	Deutsche ALT-A Securities Mortgage Loan Trust 4,529 % fällig am 25.07.2047	438	386	0,00	Washington Mutual MSC Mortgage Pass-Through Certificates Trust 3,984 % fällig am 25.06.2033	72	67	0,00			
USI, Inc. 7,980 % fällig am 02.12.2026	1.940	1.931	0,02	GSC Capital Corp. Mortgage Trust 4,749 % fällig am 25.05.2036 ^	421	383	0,00	Wells Fargo Alternative Loan Trust 3,563 % fällig am 25.07.2037 ^	145	127	0,00			
		132.666	1,26	GSMPS Mortgage Loan Trust 4,739 % fällig am 25.01.2036	2.010	1.662	0,02	4,929 % fällig am 25.03.2037 ^	1.201	1.052	0,01			
KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL				GSR Mortgage Loan Trust 3,760 % fällig am 25.04.2032	105	89	0,00	Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust 4,046 % fällig am 25.08.2036 ^	302	277	0,00			
Illinois State General Obligation Bonds, (BABs), Series 2010 6,725 % fällig am 01.04.2035	100	102	0,00	3,955 % fällig am 25.09.2035	1	1	0,00			58.216	0,55			
7,350 % fällig am 01.07.2035	464	489	0,01	HarborView Mortgage Loan Trust 3,417 % fällig am 19.04.2034	6	5	0,00	US-REGIERUNGSBEHÖRDEN						
Metropolitan Transportation Authority, New York Revenue Bonds, (BABs), Series 2010 6,814 % fällig am 15.11.2040	8.700	9.115	0,09	4,529 % fällig am 19.08.2037	4.561	3.914	0,04	Fannie Mae 1,916 % fällig am 01.01.2037	0	0	0,00			
Municipal Electric Authority of Georgia Revenue Bonds, (BABs), Series 2010 6,637 % fällig am 01.04.2057	193	207	0,00	4,749 % fällig am 19.12.2036	3.201	2.639	0,03	2,003 % fällig am 01.02.2037	1	1	0,00			
New York City Transitional Finance Authority Future Tax Secured, New York Revenue Bonds, Series 2010 5,267 % fällig am 01.05.2027	2.200	2.221	0,02	5,033 % fällig am 20.06.2035	1.589	1.418	0,01	2,073 % fällig am 01.03.2037	24	24	0,00			
State Board of Administration Finance Corp., Florida Revenue Notes, Series 2020 1,258 % fällig am 01.07.2025	25.400	23.333	0,22	HomeBanc Mortgage Trust 4,889 % fällig am 25.03.2035	294	245	0,00	2,375 % fällig am 01.03.2037	0	0	0,00			
1,705 % fällig am 01.07.2027	17.100	14.901	0,14	Impac CMB Trust 5,089 % fällig am 25.03.2035	185	172	0,00	2,530 % fällig am 01.04.2037	0	0	0,00			
		50.368	0,48	IndyMac Mortgage Loan Trust 3,082 % fällig am 25.03.2036	741	522	0,01	2,888 % fällig am 01.06.2043	8	8	0,00			
NON-AGENCY-MBS				JPMorgan Alternative Loan Trust 5,843 % fällig am 26.05.2037	225	175	0,00	2,889 % fällig am 01.10.2044	5	5	0,00			
American Home Mortgage Assets Trust 2,988 % fällig am 25.10.2046	6.624	4.618	0,05	JPMorgan Mortgage Trust 4,001 % fällig am 25.07.2035	19	18	0,00	2,961 % fällig am 25.09.2027	746	704	0,01			
Banc of America Funding Trust 4,496 % fällig am 20.09.2034	1	1	0,00	Lehman Mortgage Trust 5,750 % fällig am 25.02.2037 ^	1.457	1.008	0,01	3,585 % fällig am 01.12.2034	16	16	0,00			
Barclays Commercial Mortgage Securities Trust 5,318 % fällig am 15.10.2037	4.423	4.259	0,04	MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust 3,874 % fällig am 21.11.2034	6	5	0,00	3,821 % fällig am 25.07.2037	2	2	0,00			
Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust 3,743 % fällig am 25.01.2035	317	292	0,00	MASTR Alternative Loan Trust 5,500 % fällig am 25.02.2034	14	13	0,00	4,035 % fällig am 01.10.2037	0	0	0,00			
3,992 % fällig am 25.08.2035 ^	38	35	0,00	Merrill Lynch Mortgage Investors Trust 2,969 % fällig am 25.05.2033	2	2	0,00	4,042 % fällig am 01.10.2036	0	0	0,00			
4,089 % fällig am 25.02.2034	4	4	0,00	3,046 % fällig am 25.02.2035	18	17	0,00	4,158 % fällig am 01.09.2037	1	1	0,00			
4,191 % fällig am 25.11.2034	118	106	0,00	3,455 % fällig am 25.05.2036	326	289	0,00	4,366 % fällig am 25.09.2042	19	19	0,00			
Bear Stearns ALT-A Trust 3,668 % fällig am 25.11.2036 ^	417	194	0,00	5,049 % fällig am 25.06.2028	1	1	0,00	4,451 % fällig am 01.09.2037	2	2	0,00			
4,709 % fällig am 25.06.2046 ^	2.195	1.829	0,02	5,905 % fällig am 25.01.2029	110	106	0,00	4,739 % fällig am 25.05.2042	6	6	0,00			
BWAY Mortgage Trust 2,809 % fällig am 10.03.2033	285	272	0,00	6,000 % fällig am 25.04.2036 ^	36	18	0,00	5,289 % fällig am 25.04.2032	1	1	0,00			
Chase Mortgage Finance Trust 3,788 % fällig am 25.02.2037	8	7	0,00	MortgageIT Trust 5,129 % fällig am 25.12.2034	94	92	0,00	5,500 % fällig am 25.05.2036	289	294	0,00			
Chevy Chase Funding LLC Mortgage-Backed Certificates 4,619 % fällig am 25.10.2035	70	64	0,00	NAAC Reperforming Loan REMIC Trust Certificates 4,839 % fällig am 25.02.2035 ^	242	213	0,00	6,625 % fällig am 15.11.2030	17.025	19.977	0,19			
4,669 % fällig am 25.01.2035	90	83	0,00	Residential Accredited Loans, Inc. Trust 3,548 % fällig am 25.08.2035	182	149	0,00	Freddie Mac 1,021 % fällig am 25.08.2029 (a)	2.907	147	0,00			
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc. 3,790 % fällig am 25.09.2035	11	11	0,00	4,809 % fällig am 25.04.2046	5.463	1.620	0,02	1,944 % fällig am 01.01.2037	0	0	0,00			
Countrywide Alternative Loan Trust 3,398 % fällig am 25.08.2035 ^	1.802	1.486	0,02	6,000 % fällig am 25.02.2037 ^	2.727	2.088	0,02	2,222 % fällig am 01.06.2037	0	0	0,00			
4,563 % fällig am 20.07.2046 ^	4.497	3.344	0,03	Residential Asset Securitization Trust 6,500 % fällig am 25.04.2037 ^	2.115	572	0,01	2,309 % fällig am 01.03.2037	2	2	0,00			
4,949 % fällig am 25.02.2037	38	31	0,00	Sequoia Mortgage Trust 4,753 % fällig am 20.05.2035	144	124	0,00	2,315 % fällig am 01.03.2036	1	1	0,00			
5,009 % fällig am 25.08.2035 ^	475	405	0,01	5,235 % fällig am 20.05.2034	498	462	0,01	2,410 % fällig am 01.04.2037	0	0	0,00			
5,089 % fällig am 25.12.2035 ^	1.331	1.107	0,01	Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust 3,854 % fällig am 25.04.2035	200	186	0,00	2,660 % fällig am 01.03.2036	0	0	0,00			
5,750 % fällig am 25.04.2047 ^	580	334	0,00	Structured Asset Mortgage Investments Trust 3,508 % fällig am 25.03.2046	188	177	0,00	2,889 % fällig am 25.02.2045	18	18	0,00			
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust 2,984 % fällig am 25.01.2036 ^	183	164	0,00	4,769 % fällig am 25.07.2046 ^	179	124	0,00	4,008 % fällig am 01.10.2038	0	0	0,00			
3,792 % fällig am 25.11.2034	19	17	0,00	4,809 % fällig am 25.04.2036	112	96	0,00	4,500 % fällig am 01.01.2040	31	31	0,00			
4,849 % fällig am 25.05.2035	4	3	0,00	4,809 % fällig am 25.05.2036	9	7	0,00	5,992 % fällig am 25.11.2055	5.956	3.661	0,04			
5,500 % fällig am 25.10.2034	406	388	0,00	4,839 % fällig am 19.07.2035	1	1	0,00	Ginnie Mae, TBA 4,000 % fällig am 01.01.2053	3.000	2.839	0,03			
5,500 % fällig am 25.07.2035	38	21	0,00	4,949 % fällig am 25.02.2036 ^	17	13	0,00	Small Business Administration 4,720 % fällig am 01.02.2024	10	10	0,00			
5,500 % fällig am 25.12.2035 ^	170	129	0,00	Structured Asset Securities Corp. Mortgage Pass-Through Certificates 3,783 % fällig am 25.07.2033	172	161	0,00	5,240 % fällig am 01.08.2023	8	8	0,00			
5,910 % fällig am 20.02.2036 ^	88	67	0,00	5,041 % fällig am 25.06.2033	2	2	0,00	Uniform Mortgage-Backed Security 3,000 % fällig am 01.06.2042 - 01.10.2046	36.592	33.326	0,32			
6,000 % fällig am 25.11.2037 ^	27	15	0,00	Thornburg Mortgage Securities Trust 2,994 % fällig am 25.09.2037	244	235	0,00	3,500 % fällig am 01.10.2045	3.437	3.198	0,03			
Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp. 3,187 % fällig am 25.06.2033	4	4	0,00	Towd Point Mortgage Trust 2,750 % fällig am 25.06.2057	4.740	4.517	0,04	4,000 % fällig am 01.05.2030 - 01.11.2041	205	197	0,00			
Credit Suisse First Boston Mortgage-Backed Pass-Through Certificates 3,139 % fällig am 25.07.2033	3	3	0,00	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust 1,989 % fällig am 25.11.2041	165	143	0,00	Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,000 % fällig am 01.02.2053	8.600	7.556	0,07			
6,500 % fällig am 25.12.2033	13	12	0,00	2,868 % fällig am 25.03.2035	54	53	0,00	3,500 % fällig am 01.02.2053	158.922	144.492	1,37			
				3,048 % fällig am 25.08.2046	6	6	0,00	4,000 % fällig am 01.03.2053	579.500	543.827	5,16			
				4,759 % fällig am 25.05.2034	1.669	1.562	0,02			760.373	7,22			
				4,929 % fällig am 25.12.2045	5	4	0,00	US-SCHATZOBIGATIONEN						
				5,009 % fällig am 25.01.2045	14	13	0,00	U.S. Treasury Bonds 1,375 % fällig am 15.11.2040	149.120	97.027	0,92			

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	% DES		BESCHREIBUNG	PARI (000S)	% DES		BESCHREIBUNG	PARI (000S)	% DES	
		MARKT- WERT	NETTO- VERMÖ- GENS			MARKT- WERT	NETTO- VERMÖ- GENS			MARKT- WERT	NETTO- VERMÖ- GENS
3,000 % fällig am 15.05.2045	\$ 32.725	\$ 26.992	0,26	Crown Castle International Corp.	\$ 2.800	\$ 2.798	0,03	Walgreens Boots Alliance, Inc.			
3,000 % fällig am 15.02.2048	40.992	33.626	0,32	5,000 % fällig am 04.01.2023	1.000	998	0,01	4,900 % fällig am	\$ 1.500	\$ 1.498	0,01
3,125 % fällig am 15.08.2044	25.700	21.740	0,21	5,150 % fällig am 10.01.2023				11.01.2023			
3,125 % fällig am 15.05.2048	29.360	24.690	0,23	Dominion Resources, Inc.				4,950 % fällig am	13.600	13.566	0,13
3,250 % fällig am 15.05.2042	141.316	123.961	1,18	4,750 % fällig am 31.01.2023	1.450	1.444	0,01	18.01.2023			
3,375 % fällig am 15.08.2042	2.000	1.788	0,02	Duke Energy Corp.							2,35
U.S. Treasury Notes				4,620 % fällig am 11.01.2023	1.000	998	0,01	HUNGARY TREASURY BILLS			
3,875 % fällig am 30.09.2029	206.000	204.568	1,94	4,620 % fällig am 17.01.2023	2.500	2.494	0,02	18,250 % fällig am 03.01.2023			
U.S. Treasury STRIPS				4,650 % fällig am 09.01.2023	6.900	6.891	0,07	(d)(e)	HUF 22.046.000	58.755	0,56
0,000 % fällig am 15.05.2043 (d)	25	11	0,00	Electricite de France S.A.				Summe kurzfristige Instrumente		306.837	2,91
		1.314.999	12,48	5,000 % fällig am 20.01.2023	20.000	19.946	0,19	Summe Übertragbare Wertpapiere	\$ 9.778.544	92,78	
AKTIEN				Enbridge, Inc.	3.200	3.196	0,03	INVESTMENTFONDS			
OPTIONSSCHEINE				4,750 % fällig am 09.01.2023	2.400	2.393	0,02	ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN			
Garanteed Rate, Inc. – Exp.	7.228	0	0,00	4,780 % fällig am 20.01.2023				PIMCO Funds: Global Investors			
31.12.2060				Entergy Corp.	6.300	6.290	0,06	Series plc - Asia Strategic	3.787.451	33.329	0,32
Summe USA		5.396.303	51,20	4,750 % fällig am 11.01.2023				Interest Bond Fund (g)			
				Fiserv, Inc.	3.000	2.987	0,03	PIMCO Funds: Global Investors			
				4,820 % fällig am 01.02.2023				Series plc - PIMCO Asia	11.356.637	103.686	0,98
				Humana, Inc.	7.000	6.976	0,07	High Yield Bond Fund (g)			
				4,850 % fällig am 25.01.2023				PIMCO Funds: Global Investors			
				Medtronic Global Holdings S.C.A.	13.600	13.553	0,13	Series plc - PIMCO	3.637.652	38.357	0,36
				4,750 % fällig am 27.01.2023				European High Yield Bond			
				Mercedes-Benz Finance North America LLC	5.000	4.980	0,05	Fund (g)			
				4,530 % fällig am 04.01.2023				PIMCO Select Funds plc -			
				Mondelez International, Inc.	3.300	3.298	0,03	PIMCO US Dollar Short-			
				4,530 % fällig am 04.01.2023				Term Floating NAV Fund			
				Oracle Corp.	5.000	4.983	0,05	(g)	60.506.501	602.282	5,72
				4,800 % fällig am 26.01.2023				PIMCO Specialty Funds Ireland			
				Parker-Hannifin Corp.	3.435	3.421	0,03	p.l.c. - PIMCO China Bond			
				4,620 % fällig am 01.02.2023				Fund (g)	329.257	4.386	0,04
				4,700 % fällig am 18.01.2023				Summe Investmentfonds	\$ 1.038.326	9,85	
				4,700 % fällig am 19.01.2023							
				1.800	1.796	0,02					
				Quanta Services, Inc.	3.700	3.695	0,03	BORSENGEHANDELTE FONDS			
				5,100 % fällig am 09.01.2023				PIMCO ETFs plc - PIMCO			
				Republic Services, Inc.	1.450	1.448	0,01	US Dollar Short Maturity	2.587.040	256.286	2,43
				4,650 % fällig am 12.01.2023				UCITS ETF (g)			
				Tampa Electric Co.	13.500	13.478	0,13	Summe Investmentfonds	\$ 1.038.326	9,85	
				4,800 % fällig am 12.01.2023							
				Thomson Reuters Corp.	31.300	31.199	0,30				
				4,770 % fällig am 25.01.2023							
				Virginia Electric & Power Co.	5.300	5.275	0,05				
				4,720 % fällig am 06.02.2023							
				Vodafone Group PLC	8.200	8.194	0,08				
				4,600 % fällig am 05.01.2023							
				VW Credit, Inc.	30.900	30.791	0,29				
				4,800 % fällig am 26.01.2023							

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kapital- betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions- geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions- geschäft ⁽¹⁾	% des Nettovermögens
DEU	4,230 %	30.12.2022	03.01.2023	\$ 30.800	U.S. Treasury Bonds 2,750 % fällig am 15.11.2047	\$ (31.422)	\$ 30.800	\$ 30.814	0,29
FICC	1,900	30.12.2022	03.01.2023	29.223	U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 08.06.2023	(29.808)	29.223	29.226	0,28
SAL	4,320	30.12.2022	03.01.2023	15.400	U.S. Treasury Notes 0,125 % fällig am 15.10.2023	(15.695)	15.400	15.407	0,15
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (76.925)	\$ 75.423	\$ 75.447	0,72

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
3-Month SOFR December Futures	Long	03.2024	836	\$ 390	0,00
3-Month SOFR March Futures	Long	06.2023	836	(11)	0,00
Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 146,000 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond February 2023 Futures ⁽¹⁾	Short	01.2023	135	108	0,00
Euro-BTP Italy Government Bond March Futures	Long	03.2023	443	(3.821)	(0,04)
Euro-Bund 10-Year Bond March Futures	Long	03.2023	3.494	(34.124)	(0,31)
Euro-Schatz March Futures	Long	03.2023	2.113	(3.144)	(0,03)

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 138,500 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond February 2023 Futures ⁽¹⁾	Short	01.2023	135	\$ (690)	(0,01)
U.S. Treasury 10-Year Note March Futures	Long	03.2023	302	(182)	0,00
U.S. Treasury 30-Year Bond March Futures	Long	03.2023	575	(119)	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond March Futures	Short	03.2023	1.653	815	0,01
United Kingdom Long Gilt March Futures	Long	03.2023	402	(2.933)	(0,03)
				\$ (43.711)	(0,41)
				\$ (43.711)	(0,41)

Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate

⁽¹⁾ Future-Style-Option.

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZKAUF⁽¹⁾

Referenzeinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽³⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Toll Brothers Finance Corp.	(1,000) %	20.06.2024	\$ 23.500	\$ (14)	0,00

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽²⁾

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽³⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AES Corp.	5,000 %	20.12.2025	\$ 7.900	\$ (652)	(0,01)
AES Corp.	5,000	20.06.2026	2.400	(184)	0,00
Airbus Finance BV	1,000	20.12.2025	€ 10.300	(67)	0,00
American International Group, Inc.	1,000	20.12.2027	\$ 8.000	66	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.12.2023	12.100	(134)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2024	3.400	6	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.12.2024	7.600	(116)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.12.2025	2.000	(23)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2026	68.000	(1.073)	(0,01)
AT&T, Inc.	1,000	20.12.2026	1.300	(21)	0,00
Atlanta SpA	1,000	20.12.2025	€ 1.800	37	0,00
Auchan Holding S.A.	1,000	20.12.2027	300	0	0,00
Berkshire Hathaway, Inc.	1,000	20.06.2023	\$ 7.100	81	0,00
Boeing Co.	1,000	20.06.2023	7.300	(11)	0,00
Boeing Co.	1,000	20.06.2025	7.000	74	0,00
Boeing Co.	1,000	20.12.2025	900	9	0,00
Boeing Co.	1,000	20.06.2026	1.000	(2)	0,00
BP Capital Markets PLC	1,000	20.12.2025	€ 6.800	(61)	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20.12.2024	23.900	(100)	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20.12.2025	6.000	(47)	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20.12.2027	500	(6)	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20.06.2028	20.400	(674)	(0,01)
British Telecommunications PLC	1,000	20.12.2028	1.100	(35)	0,00
Ford Motor Co.	5,000	20.12.2024	\$ 5.000	(353)	0,00
General Electric Co.	1,000	20.06.2023	12.050	(28)	0,00
General Electric Co.	1,000	20.12.2023	42.850	2.076	0,02
General Electric Co.	1,000	20.06.2024	32.050	288	0,00
General Electric Co.	1,000	20.12.2024	27.900	555	0,01
General Electric Co.	1,000	20.06.2026	18.750	(110)	0,00
General Electric Co.	1,000	20.12.2026	2.000	(13)	0,00
General Motors Co.	5,000	20.12.2026	5.300	(480)	(0,01)
Hess Corp.	1,000	20.06.2026	7.000	50	0,00
International Lease Finance Corp.	5,000	20.12.2023	6.100	(649)	(0,01)
Lennar Corp.	5,000	20.12.2026	3.200	(219)	0,00
MetLife, Inc.	1,000	20.12.2023	11.000	394	0,00
NextEra Energy Capital Holdings, Inc.	1,000	20.06.2026	11.300	(98)	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20.06.2024	€ 25.300	(553)	(0,01)
Rolls-Royce PLC	1,000	20.12.2024	47.100	(1.231)	(0,01)
Southwest Airlines Co.	1,000	20.12.2026	\$ 3.100	15	0,00
Stellantis NV	5,000	20.06.2026	€ 16.100	(1.772)	(0,02)
Stellantis NV	5,000	20.12.2026	8.800	(807)	(0,01)
Syngenta Finance NV	1,000	20.06.2028	2.600	(53)	0,00
Telefonica Emisiones S.A.	1,000	20.06.2026	17.000	(231)	0,00
Telefonica Emisiones S.A.	1,000	20.06.2028	7.800	(219)	0,00
Tesco PLC	1,000	20.12.2024	63.700	430	0,00
Tesco PLC	1,000	20.12.2027	4.700	(88)	0,00
Tesco PLC	1,000	20.06.2028	7.300	(241)	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.06.2026	\$ 1.900	(42)	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.06.2027	3.000	(3)	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.12.2027	5.000	52	0,00
Vodafone Group PLC	1,000	20.06.2023	€ 26.100	(115)	0,00
Vodafone Group PLC	1,000	20.06.2024	12.700	(51)	0,00
Volkswagen International Finance NV	1,000	20.12.2026	4.100	(142)	0,00
Volkswagen International Finance NV	1,000	20.06.2028	11.100	(372)	0,00
				\$ (6.943)	(0,07)

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF⁽²⁾

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽³⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.IG-39 5-Year Index	1,000 %	20.12.2027	\$ 149.300	\$ 81	0,00
iTraxx Crossover 38 5-Year Index	5,000	20.12.2027	€ 12.900	610	0,01
				\$ 691	0,01

ZINSSWAPS

Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fest-Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	1,060 %	21.02.2052	£ 3.000	\$ (1.533)	(0,02)
Zahlung	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	1,101	21.02.2052	7.700	(3.863)	(0,04)
Zahlung	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	1,175	28.02.2052	10.300	(4.991)	(0,05)
Zahlung ⁽⁴⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	2,250	15.03.2028	37.200	(1.316)	(0,01)
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000	15.12.2023	¥ 910.000	17	0,00
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000	15.09.2024	1.829.900	61	0,00
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000	18.12.2029	5.198.520	(2.548)	(0,03)
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,300	20.03.2028	7.992.900	1.184	0,01
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,000	15.06.2027	\$ 382.600	34.368	0,33
Erhalt ⁽⁴⁾	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,450	20.12.2024	427.700	6.416	0,06
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,224	04.01.2027	BRL 245.400	(1.849)	(0,02)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,245	04.01.2027	119.000	(861)	(0,01)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,445	02.01.2025	40.000	160	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,572	04.01.2027	37.000	(201)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,715	04.01.2027	55.200	(257)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,980	04.01.2027	522.800	1.082	0,01
Zahlung	1-Year BRL-CDI	13,026	02.01.2025	1.882.900	1.952	0,02
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,500	17.06.2030	CAD 262.700	(18.278)	(0,17)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,550	10.08.2024	€ 31.200	(1.344)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,650	12.04.2027	88.900	(9.117)	(0,09)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,700	11.04.2027	20.800	(2.087)	(0,02)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,000	13.05.2027	62.700	(5.544)	(0,05)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,000	18.05.2027	28.000	(2.474)	(0,02)
Zahlung ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	1,750	15.03.2033	81.400	(2.518)	(0,02)
Zahlung	6-Month HUF-BBR	1,000	19.09.2023	HUF 37.770.400	(11.356)	(0,11)
Zahlung	6-Month HUF-BBR	1,250	19.09.2023	16.157.700	(5.518)	(0,05)
Zahlung	28-Day MXN-TIE	5,400	05.03.2026	MXN 1.762.000	(9.462)	(0,09)
					\$ (39.877)	(0,38)
					\$ (46.143)	(0,44)

Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate

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

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

⁽³⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definieren.

⁽⁴⁾ Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

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

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

OPTIONSKAUF

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag ⁽¹⁾	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
BPS	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,000 %	15.03.2023	53.270	\$ 6.064	\$ 28.860	0,27
JPM	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,000	15.03.2023	35.260	3.892	19.102	0,18
							\$ 9.956	\$ 47.962	0,45

VERKAUFSOPTIONEN

CREDIT DEFAULT SWAPPTIONS AUF KREDITINDIZES

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/-verkauf	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
GST	Put – OTC iTraxx Europe 37 5-Year Index	Verkauf	3,000 %	15.03.2023	26.000	\$ (46)	\$ (5)	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Netto- vermögens
BOA	Call – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,870 %	23.01.2023	5.700	\$ (42)	\$ (17)	0,00
	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,320	23.01.2023	5.700	(42)	(71)	0,00
BPS	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,900	17.01.2023	10.500	(43)	(1)	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,400	17.01.2023	10.500	(43)	(176)	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,175	15.03.2023	159.840	(5.929)	(49.124)	(0,47)
	Call – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,610	17.01.2023	5.200	(48)	(1)	0,00
	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,110	17.01.2023	5.200	(48)	(149)	0,00
GLM	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,000	12.01.2023	13.200	(74)	(2)	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,550	12.01.2023	13.200	(74)	(110)	0,00
	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,547	07.03.2023	24.000	(528)	(54)	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,547	07.03.2023	24.000	(527)	(1.511)	(0,02)
	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,067	09.06.2023	32.700	(382)	(84)	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	3,140	09.06.2023	32.700	(452)	(1.070)	(0,01)
	Call – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,740	19.01.2023	5.000	(43)	(4)	0,00
	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,180	19.01.2023	5.000	(43)	(112)	0,00
JPM	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,175	15.03.2023	105.770	(3.823)	(32.507)	(0,31)
MYC	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,070	23.01.2023	10.800	(53)	(9)	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,520	23.01.2023	10.800	(53)	(128)	0,00
	Call – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,600	17.01.2023	5.300	(40)	(1)	0,00
	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,050	17.01.2023	5.300	(40)	(194)	0,00
							\$ (12.327)	\$ (85.325)	(0,81)

OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Netto- vermögens
BOA	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.01.2053	\$ 101,891	05.01.2023	8.200	\$ (24)	\$ 0	0,00
JPM	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.03.2053	99,000	06.03.2023	23.500	(173)	(59)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fällig am 01.03.2053	98,766	06.03.2023	5.700	(48)	(78)	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fällig am 01.03.2053	100,766	06.03.2023	5.700	(41)	(19)	0,00
SAL	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.01.2053	101,859	05.01.2023	9.800	(29)	0	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.02.2053	99,750	06.02.2023	10.800	(76)	(65)	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.02.2053	101,750	06.02.2023	10.800	(63)	(25)	0,00
					\$ (454)	\$ (246)	0,00

⁽¹⁾ Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag ⁽²⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Netto- vermögens
BOA	Brazil Government International Bond	1,000 %	20.06.2026	\$ 1.100	\$ (38)	\$ 9	\$ (29)	0,00
	Italy Government International Bond	1,000	20.06.2024	14.500	(304)	467	163	0,00
	Italy Government International Bond	1,000	20.06.2025	14.200	(395)	464	69	0,00
BRC	Huarong Finance Co. Ltd.	1,000	20.12.2024	23.000	(471)	(189)	(660)	(0,01)
	Italy Government International Bond	1,000	20.06.2024	13.500	(294)	445	151	0,00
	Italy Government International Bond	1,000	20.12.2024	19.100	54	216	270	0,01
	Italy Government International Bond	1,000	20.06.2025	49.700	(1.207)	1.448	241	0,00
	NextEra Energy Capital Holdings, Inc.	1,000	20.12.2025	7.800	170	(59)	111	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2024	31.400	(1.186)	1.017	(169)	0,00
CBK	Intrum AB	5,000	20.12.2024	€ 3.000	286	(357)	(71)	0,00
	Italy Government International Bond	1,000	20.06.2025	\$ 11.100	(270)	324	54	0,00
DUB	Saudi Arabia Government International Bond	1,000	20.06.2025	5.700	(5)	84	79	0,00
FBF	Italy Government International Bond	1,000	20.12.2024	3.000	7	35	42	0,00
	Italy Government International Bond	1,000	20.06.2025	13.000	(201)	348	147	0,00
GLM	Italy Government International Bond	1,000	20.06.2025	44.900	(502)	1.225	723	0,01
GST	Equinix, Inc.	5,000	20.06.2027	4.500	629	(9)	620	0,01
	Intrum AB	5,000	20.12.2024	€ 34.400	4.118	(4.935)	(817)	(0,01)
	Saudi Arabia Government International Bond	1,000	20.06.2025	\$ 5.700	(7)	86	79	0,00
	Saudi Arabia Government International Bond	1,000	20.12.2026	1.400	33	(9)	24	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2024	5.700	(229)	198	(31)	0,00
JLN	Intrum AB	5,000	20.12.2024	€ 10.000	1.189	(1.426)	(237)	0,00
JPM	Hochtief AG	5,000	20.12.2025	29.400	6.790	(3.823)	2.967	0,03
	NextEra Energy Capital Holdings, Inc.	1,000	20.06.2024	\$ 16.300	223	(66)	157	0,00
	NextEra Energy Capital Holdings, Inc.	1,000	20.12.2024	8.100	112	(15)	97	0,00
	Saudi Arabia Government International Bond	1,000	20.06.2025	7.600	(1)	107	106	0,00
MYC	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2027	15.800	(978)	173	(805)	(0,01)
	Brookfield Asset Management, Inc.	1,000	20.06.2025	7.900	0	(110)	(110)	0,00
	Consolidated Edison Co. of New York, Inc.	1,000	20.12.2024	16.500	322	(63)	259	0,00
	Pioneer Natural Resources Co.	1,000	20.06.2025	8.400	(408)	515	107	0,00
MYI	Intrum AB	5,000	20.12.2024	€ 2.700	311	(375)	(64)	0,00
					\$ 7.748	\$ (4.275)	\$ 3.473	0,03

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Kontrahent	Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽²⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BPS	CDX.HY-31 5-Year Index 25-35 %	5,000 %	20.12.2023	\$ 5.800	\$ 676	\$ (424)	\$ 252	0,00
BRC	iTraxx Japan 38 5-Year Index	1,000	20.12.2027	¥ 5.902.209	(152)	444	292	0,00
CBK	CDX.HY-31 5-Year Index 25-35 %	5,000	20.12.2023	\$ 8.000	828	(481)	347	0,01
GST	CDX.HY-31 5-Year Index 25-35 %	5,000	20.12.2023	24.000	2.849	(1.807)	1.042	0,01
	iTraxx Japan 38 5-Year Index	1,000	20.12.2027	¥ 2.529.518	(97)	222	125	0,00
JPM	CDX.HY-31 5-Year Index 25-35 %	5,000	20.12.2023	\$ 44.300	5.450	(3.526)	1.924	0,02
	iTraxx Japan 38 5-Year Index	1,000	20.12.2027	¥ 10.517.273	(300)	821	521	0,01
MYC	CDX.HY-31 5-Year Index 25-35 %	5,000	20.12.2023	\$ 6.600	784	(497)	287	0,00
					\$ 10.038	\$ (5.248)	\$ 4.790	0,05

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

⁽²⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert.

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens			
BOA	01.2023	CHF	1.977	\$ 2.103	\$ 0	\$ (35)	0,00			
	01.2023	€	2	2	0	0	0,00			
	01.2023	£	1.445	1.753	15	0	15	0,00		
	01.2023	HUF	9.429.734	24.075	0	(1.057)	(1.057)	(0,01)		
	01.2023	PEN	7.411	1.951	9	0	9	0,00		
	01.2023		2.729	CHF 2.582	64	0	64	0,00		
	01.2023		27.692	£ 22.839	0	(215)	(215)	0,00		
	01.2023		39	HUF 17.803	8	0	8	0,00		
	01.2023	ZAR	77.762	\$ 4.376	0	(193)	(193)	0,00		
	02.2023	\$	11.015	NOK 109.331	102	0	102	0,00		
	02.2023	ZAR	93.342	\$ 5.208	0	(257)	(257)	0,00		
	03.2023		170.589	9.661	0	(307)	(307)	0,00		
	BOM	01.2023	CAD	56.142	41.810	374	0	374	0,00	
		01.2023	€	12.001	\$ 12.793	0	(21)	(21)	0,00	
01.2023		HUF	3.344.873	8.572	0	(343)	(343)	0,00		
01.2023		\$	4.183	ZAR 72.718	89	0	89	0,00		
02.2023			1.917	IDR 30.149.375	32	0	32	0,00		
02.2023		ZAR	163.442	\$ 9.105	0	(468)	(468)	0,00		
03.2023		PEN	122.503	31.508	0	(405)	(405)	0,00		
03.2023		\$	2.506	COP 12.262.091	0	(10)	(10)	0,00		
03.2023			1.617	INR 134.142	0	(4)	(4)	0,00		
03.2023			512	MXN 10.313	10	0	10	0,00		
04.2023			2.596	CLP 2.377.941	153	0	153	0,00		
BRC		01.2023	HUF	959.129	\$ 2.501	0	(55)	(55)	0,00	
		01.2023	\$	3.114	PEN 11.995	25	0	25	0,00	
		01.2023	CAD	2.771	\$ 2.034	0	(11)	(11)	0,00	
	01.2023		2.984	2.205	3	0	3	0,00		
	01.2023	CLP	17.541.513	19.718	0	(855)	(855)	(0,01)		
	01.2023	€	13.677	14.541	0	(62)	(62)	0,00		
	01.2023	HUF	346.245	868	0	(52)	(52)	0,00		
	01.2023	\$	4.221	BRL 22.155	0	(25)	(25)	0,00		
	01.2023		24.713	CHF 23.343	533	0	533	0,01		
	01.2023		18.403	CLP 17.535.597	2.165	0	2.165	0,02		
	01.2023		20.718	€ 19.583	191	0	191	0,00		
	01.2023		9.858	PEN 39.233	411	0	411	0,00		
	01.2023	ZAR	106.760	\$ 6.093	0	(170)	(170)	0,00		
	02.2023	NOK	22.940	2.347	14	0	14	0,00		
02.2023	PEN	137.357	34.418	0	(1.493)	(1.493)	(0,01)			
BSH	02.2023	\$	6.190	BRL 33.406	103	0	103	0,00		
	02.2023		19.718	CLP 17.638.133	870	0	870	0,01		
	03.2023	PEN	153.584	\$ 38.363	0	(1.609)	(1.609)	(0,02)		
	03.2023	\$	41.497	MXN 814.103	0	(295)	(295)	0,00		
	05.2023	PEN	41.350	\$ 10.324	0	(410)	(410)	0,00		
	07.2023	\$	12.363	PEN 50.187	608	0	608	0,01		
	CLY	01.2023	HUF	3.453.683	\$ 8.782	0	(423)	(423)	0,00	
		01.2023	\$	1.218	HUF 468.104	29	0	29	0,00	
		03.2023		7.326	CLP 6.648.027	404	0	404	0,00	
		03.2023		2.525	PEN 9.714	5	0	5	0,00	
		DUB	01.2023	DKK	86.439	\$ 12.183	0	(228)	(228)	0,00
			01.2023	HUF	7.289.225	16.121	0	(3.249)	(3.249)	(0,03)
			02.2023	ZAR	13.423	804	18	0	18	0,00
			03.2023	\$	5.945	PEN 22.810	0	(3)	(3)	0,00
GLM		01.2023	BRL	22.155	\$ 4.157	0	(39)	(39)	0,00	
		01.2023	CNH	102	15	0	0	0	0,00	

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	01.2023	HUF 4.935.889	\$ 12.639	\$ 0	\$ (515)	\$ (515)	(0,01)
	01.2023	PEN 25.239	6.516	0	(88)	(88)	0,00
	01.2023	PLN 1.587	313	0	(49)	(49)	0,00
	01.2023	ZAR 95.355	5.334	0	(262)	(262)	0,00
	02.2023	\$ 25.574	COP 116.484.309	0	(1.771)	(1.771)	(0,02)
	03.2023	COP 12.262.091	\$ 2.543	47	0	47	0,00
	03.2023	MXN 1.057.412	51.437	0	(2.079)	(2.079)	(0,02)
	03.2023	\$ 2.541	COP 12.262.091	0	(45)	(45)	0,00
	04.2023	4.084	BRL 22.155	40	0	40	0,00
	05.2023	PEN 174.054	\$ 43.642	0	(1.522)	(1.522)	(0,02)
	05.2023	ZAR 23.592	1.412	40	0	40	0,00
JPM	01.2023	HUF 298.983	763	0	(34)	(34)	0,00
	02.2023	\$ 3.305	IDR 52.074.742	62	0	62	0,00
	02.2023	ZAR 469	\$ 26	0	(1)	(1)	0,00
	03.2023	\$ 3.552	IDR 55.599.667	42	0	42	0,00
	03.2023	1.778	MXN 35.326	10	0	10	0,00
MBC	01.2023	AUD 3.747	\$ 2.512	0	(30)	(30)	0,00
	01.2023	CAD 2.424	1.780	0	(10)	(10)	0,00
	01.2023	DKK 78.166	11.042	0	(182)	(182)	0,00
	01.2023	€ 57.384	60.266	0	(1.003)	(1.003)	(0,01)
	01.2023	¥ 588.000	4.340	0	(120)	(120)	0,00
	01.2023	\$ 6.933	CAD 9.378	24	(36)	(12)	0,00
	01.2023	3.791	€ 3.550	0	0	0	0,00
	01.2023	621	HUF 250.652	45	0	45	0,00
	02.2023	IDR 454.705	\$ 29	0	(1)	(1)	0,00
	02.2023	\$ 8.544	MXN 175.798	422	0	422	0,00
	03.2023	2.156	IDR 33.746.125	26	0	26	0,00
	03.2023	132	MXN 2.642	2	0	2	0,00
MYI	01.2023	AUD 118.806	\$ 79.784	0	(804)	(804)	(0,01)
	01.2023	CHF 16	18	0	0	0	0,00
	01.2023	€ 117	125	0	0	0	0,00
	01.2023	£ 19	22	0	0	0	0,00
	01.2023	SGD 8.009	5.937	0	(35)	(35)	0,00
	01.2023	\$ 616	€ 578	0	0	0	0,00
	01.2023	8.462	£ 7.019	0	(17)	(17)	0,00
	01.2023	734	HUF 300.219	64	0	64	0,00
	01.2023	9	SEK 90	0	0	0	0,00
	03.2023	3.032	IDR 47.547.688	42	0	42	0,00
RBC	01.2023	AUD 1.368	\$ 918	0	(11)	(11)	0,00
	02.2023	\$ 16.708	NOK 166.705	244	0	244	0,00
	03.2023	MXN 15.816	\$ 791	0	(11)	(11)	0,00
RYL	01.2023	\$ 225	HUF 84.651	0	0	0	0,00
SCX	01.2023	AUD 1.423	\$ 959	0	(7)	(7)	0,00
	01.2023	CAD 48.977	36.456	308	0	308	0,00
	01.2023	€ 1.411.505	1.469.164	0	(37.906)	(37.906)	(0,36)
	01.2023	KRW 380.588	288	0	(14)	(14)	0,00
	02.2023	3.481	IDR 54.794.297	62	0	62	0,00
	03.2023	4.664	PEN 17.985	23	0	23	0,00
	04.2023	ZAR 143.515	\$ 7.802	0	(563)	(563)	(0,01)
	06.2023	\$ 7	CLP 6.047	0	0	0	0,00
SOG	01.2023	ZAR 36.919	\$ 2.081	0	(88)	(88)	0,00
TOR	01.2023	AUD 6.543	4.416	0	(22)	(22)	0,00
	01.2023	CAD 68.214	50.743	397	0	397	0,00
	01.2023	£ 366.664	440.836	0	(295)	(295)	0,00
UAG	01.2023	HUF 632.402	1.425	0	(256)	(256)	0,00
	01.2023	\$ 841	HUF 331.661	41	0	41	0,00
	01.2023	ZAR 163.781	\$ 9.144	0	(470)	(470)	(0,01)
	02.2023	\$ 5.126	IDR 81.363.597	136	0	136	0,00
	03.2023	ZAR 146.658	\$ 8.205	0	(354)	(354)	0,00
	09.2023	185.425	10.576	0	(102)	(102)	0,00
				\$ 8.312	\$ (60.997)	\$ (52.685)	(0,50)

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional AUD (Hedged) ausschüttend und Investor AUD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	01.2023	\$ 4.073	AUD 6.047	\$ 29	\$ 0	\$ 29	0,00
CBK	01.2023	AUD 130	\$ 88	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 1	AUD 1	0	0	0	0,00
MBC	01.2023	1.577	2.343	14	(2)	12	0,00
MYI	01.2023	3.661	5.451	37	0	37	0,00
UAG	01.2023	2.888	4.278	14	0	14	0,00
				\$ 94	\$ (2)	\$ 92	0,00

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilklassen Institutional CAD (Hedged) ausschüttend und Investor CAD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2023	\$ 72	CAD 98	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
BOM	01.2023	33	45	0	0	0	0,00
CBK	01.2023	11	14	0	0	0	0,00
MBC	01.2023	82	110	0	0	0	0,00
MYI	01.2023	CAD 296	\$ 221	2	0	2	0,00
SCX	01.2023	\$ 21	CAD 29	0	0	0	0,00
				\$ 2	\$ 0	\$ 2	0,00

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilklassen Institutional CHF (Hedged) thesaurierend, Institutional CHF (Hedged) ausschüttend, Investor CHF (Hedged) thesaurierend, Investor CHF (Hedged) ausschüttend, Administrative CHF (Hedged) thesaurierend, Class E CHF (Hedged) thesaurierend und Class W CHF (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2023	CHF 508	\$ 542	\$ 0	\$ (7)	\$ (7)	0,00
	01.2023	\$ 302.931	CHF 286.434	6.859	0	6.859	0,06
BRC	01.2023	801	743	3	0	3	0,00
CBK	01.2023	CHF 427	\$ 460	0	(3)	(3)	0,00
	01.2023	\$ 522.629	CHF 493.801	11.435	0	11.435	0,11
MBC	01.2023	CHF 1.512	\$ 1.624	1	(12)	(11)	0,00
	01.2023	\$ 552	CHF 512	2	0	2	0,00
MYI	01.2023	CHF 1.121	\$ 1.203	0	(10)	(10)	0,00
	01.2023	\$ 554	CHF 524	12	0	12	0,00
SCX	01.2023	CHF 1.751	\$ 1.890	0	(4)	(4)	0,00
	01.2023	\$ 24	CHF 23	0	0	0	0,00
UAG	01.2023	CHF 119	\$ 129	0	0	0	0,00
				\$ 18.312	\$ (36)	\$ 18.276	0,17

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilklasse Institutional CZK (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Counterparty	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CBK	01.2023	\$ 4.337	CZK 101.869	\$ 162	\$ 0	\$ 162	0,00
GLM	01.2023	4.954	116.425	188	0	188	0,01
MBC	01.2023	4.835	113.831	193	0	193	0,00
MYI	01.2023	CZK 1.787	\$ 79	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 530	CZK 12.387	17	0	17	0,00
				\$ 560	\$ 0	\$ 560	0,01

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilklassen Institutional EUR (Currency Exposure) thesaurierend, Institutional USD (Currency Exposure) thesaurierend, Institutional USD (Currency Exposure) ausschüttend, Class E EUR (Currency Exposure) ausschüttend und H Institutional USD (Currency Exposure) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2023	\$ 787	CAD 1.075	\$ 6	\$ 0	\$ 6	0,00
	01.2023	75	CHF 71	2	0	2	0,00
	01.2023	107	€ 101	1	0	1	0,00
	01.2023	3.968	£ 3.265	0	(40)	(40)	0,00
	01.2023	311	¥ 41.064	0	0	0	0,00
BOM	01.2023	1.515	CAD 2.034	0	(14)	(14)	0,00
BPS	01.2023	19.571	€ 18.360	32	0	32	0,00
BRC	01.2023	3.390	£ 2.817	0	(1)	(1)	0,00
	01.2023	59	SEK 613	0	0	0	0,00
CBK	01.2023	€ 247	\$ 263	0	(1)	(1)	0,00
	01.2023	\$ 1.119	AUD 1.667	11	0	11	0,00
	01.2023	621	CHF 587	13	0	13	0,00
	01.2023	1.899	€ 1.794	17	0	17	0,00
	01.2023	5	SEK 53	0	0	0	0,00
CLY	01.2023	2.359	€ 2.217	9	0	9	0,00
JPM	01.2023	7.493	£ 6.205	0	(28)	(28)	0,00
MBC	01.2023	€ 526	\$ 555	0	(6)	(6)	0,00
	01.2023	\$ 429	AUD 638	3	0	3	0,00
	01.2023	514	CAD 694	1	(3)	(2)	0,00
	01.2023	155	CHF 143	0	0	0	0,00
	01.2023	54.914	€ 52.269	894	0	894	0,01
	01.2023	679	£ 557	0	(9)	(9)	0,00
	01.2023	1.673	¥ 225.591	38	0	38	0,00
MYI	01.2023	1.165	AUD 1.735	12	0	12	0,00
	01.2023	402	CAD 544	0	0	0	0,00
	01.2023	182	¥ 24.922	7	0	7	0,00
RBC	01.2023	13	AUD 20	0	0	0	0,00
	01.2023	3.446	CAD 4.687	14	0	14	0,00
SCX	01.2023	78	AUD 116	1	0	1	0,00
	01.2023	1.321	CAD 1.774	0	(11)	(11)	0,00
	01.2023	237	CHF 220	0	0	0	0,00
	01.2023	103	NZD 165	1	0	1	0,00
TOR	01.2023	1.838	CAD 2.471	0	(14)	(14)	0,00
	01.2023	12.793	€ 12.021	41	0	41	0,00
UAG	01.2023	202	£ 164	0	(4)	(4)	0,00
				\$ 1.103	\$ (131)	\$ 972	0,01

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Investor EUR (Hedged) thesaurierend, Investor EUR (Hedged) ausschüttend, Administrative EUR (Hedged) thesaurierend, Administrative EUR (Hedged) ausschüttend, Class E EUR (Hedged) thesaurierend, Class E EUR (Hedged) ausschüttend, Class R EUR (Hedged) ausschüttend, Class T EUR (Hedged) thesaurierend, Class W EUR (Hedged) thesaurierend und Class W EUR (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2023	€ 4.583	\$ 4.833	\$ 0	\$ (60)	\$ (60)	0,00
BPS	01.2023	\$ 2.447	€ 2.294	2	0	2	0,00
CBK	01.2023	€ 73.656	\$ 78.366	0	(277)	(277)	0,00
	01.2023	\$ 851.063	€ 820.317	24.795	0	24.795	0,23
MBC	01.2023	€ 56.433	\$ 59.894	1	(360)	(359)	0,00
	01.2023	\$ 1.006.345	€ 960.260	18.931	0	18.931	0,18
SCX	01.2023	917.363	881.359	23.671	0	23.671	0,22
				\$ 67.400	\$ (697)	\$ 66.703	0,63

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend, Institutional GBP (Hedged) ausschüttend, Investor GBP (Hedged) ausschüttend, Administrative GBP (Hedged) ausschüttend, Class E GBP (Hedged) ausschüttend, Class R GBP (Hedged) ausschüttend, Class W GBP (Hedged) thesaurierend und Class W GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2023	£ 2.620	\$ 3.181	\$ 29	\$ 0	\$ 29	0,00
	01.2023	\$ 1.724	£ 1.396	0	(45)	(45)	0,00
BPS	01.2023	£ 1.043	\$ 1.258	3	0	3	0,00
BRC	01.2023	7.232	8.710	9	0	9	0,00
JPM	01.2023	\$ 385.703	£ 319.416	0	(1.418)	(1.418)	(0,01)
MBC	01.2023	£ 21.134	\$ 25.780	354	0	354	0,00
	01.2023	\$ 385.068	£ 320.881	1.511	(530)	981	0,01
MYI	01.2023	£ 294	\$ 362	8	0	8	0,00
	01.2023	\$ 1.827	£ 1.497	0	(26)	(26)	0,00
TOR	01.2023	385.452	320.598	258	0	258	0,00
UAG	01.2023	£ 228	\$ 280	6	0	6	0,00
	01.2023	\$ 2.025	£ 1.636	0	(57)	(57)	0,00
				\$ 2.178	\$ (2.076)	\$ 102	0,00

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilklasse Institutional NOK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BRC	01.2023	NOK 186	\$ 19	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	01.2023	\$ 7.828	NOK 77.890	81	0	81	0,00
CBK	01.2023	8.656	85.800	56	0	56	0,00
MBC	01.2023	NOK 6	\$ 1	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 988	NOK 9.676	0	(6)	(6)	0,00
RYL	01.2023	0	3	0	0	0	0,00
SCX	01.2023	8.832	87.589	65	(3)	62	0,00
				\$ 202	\$ (9)	\$ 193	0,00

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilklassen Institutional SEK (Hedged) thesaurierend und Administrative SEK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2023	SEK 459	\$ 44	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	01.2023	\$ 2.585	SEK 26.617	0	(30)	(30)	0,00
BRC	01.2023	115.076	1.205.229	637	0	637	0,01
CBK	01.2023	SEK 211.595	\$ 20.374	59	0	59	0,00
	01.2023	\$ 15.335	SEK 159.790	6	0	6	0,00
MBC	01.2023	SEK 3.219	\$ 308	0	(1)	(1)	0,00
	01.2023	\$ 912	SEK 9.389	0	(11)	(11)	0,00
MYI	01.2023	41.998	441.747	413	0	413	0,01
SCX	01.2023	SEK 321	\$ 31	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 354	SEK 3.723	3	0	3	0,00
UAG	01.2023	SEK 163.175	\$ 15.879	213	0	213	0,00
	01.2023	\$ 202.357	SEK 2.122.776	1.449	0	1.449	0,01
				\$ 2.780	\$ (42)	\$ 2.738	0,03

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilklassen Institutional SGD (Hedged) ausschüttend, Investor SGD (Hedged) ausschüttend, Administrative SGD (Hedged) ausschüttend, E Class SGD (Hedged) ausschüttend und W Class SGD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	01.2023	\$ 191	SGD 260	\$ 3	\$ 0	\$ 3	0,00
BOA	01.2023	10.393	14.254	236	0	236	0,00
BPS	01.2023	11.128	15.251	245	0	245	0,01

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BRC	01.2023	\$ 7.037	SGD 9.493	\$ 42	\$ 0	\$ 42	0,00
GLM	01.2023	599	814	7	0	7	0,00
MBC	01.2023	SGD 340	\$ 254	0	0	0	0,00
	01.2023	\$10.480	SGD 14.329	205	0	205	0,00
RYL	01.2023	1.114	1.511	14	0	14	0,00
SCX	01.2023	172	233	1	0	1	0,00
UAG	01.2023	764	1.034	7	0	7	0,00
				\$ 760	\$ 0	\$ 760	0,01
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						\$ 8.362	0,08

LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖGENS
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN			
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA			
2,000 % fällig am 01.01.2053	\$ 68.300	\$ (55.591)	(0,53)
2,000 % fällig am 01.02.2053	99.000	(80.664)	(0,76)
Summe Leerverkaufte Wertpapiere		\$ (136.255)	(1,29)
Summe Anlagen		\$ 10.674.546	101,29
Sonstige Aktiva und Passiva		\$ (136.205)	(1,29)
Nettovermögen		\$ 10.538.341	100,00

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

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

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.

(b) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.

(c) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.

(d) Nullkuponwertpapier.

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

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

(g) Mit dem Fonds verbunden.

(h) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(i) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2021: 0,84 %):

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeits- datum	Kauf- datum	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
Citigroup, Inc.	2,572 %	03.06.2031	05.26.2020 - 07.09.2020	\$ 25.047	\$ 20.032	0,19
Deutsche Bank AG	3,729	14.01.2032	21.01.2021	11.264	8.260	0,08
Morgan Stanley	0,000	02.04.2032	11.02.2020	40.835	26.786	0,25
Oracle Corp.	4,100	25.03.2061	24.03.2021 - 26.03.2021	6.837	4.612	0,04
Oracle Corp.	6,250	09.11.2032	07.11.2022	14.475	15.222	0,14
				\$ 98.458	\$ 74.912	0,70

(j) Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von 4.048 USD (31. Dezember 2021: 7.613 USD) wurden gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen zum 31. Dezember 2022 als Sicherheiten verpfändet.

Barmittel in Höhe von 0 USD (31. Dezember 2021: 20 USD) wurden gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen zum 31. Dezember 2022 als Sicherheiten erhalten.

Barmittel in Höhe von 213.307 USD (31. Dezember 2021: 253.176 USD) wurden zum 31. Dezember 2022 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 55.028 USD (31. Dezember 2021: 21.890 USD) wurden gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. zum 31. Dezember 2022 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 1	\$ 9.770.167	\$ 8.376	\$ 9.778.544
Investmentfonds	782.040	256.286	0	1.038.326
Pensionsgeschäfte	0	75.423	0	75.423
Finanzderivate ⁽³⁾	(44.604)	(36.888)	0	(81.492)
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(136.255)	0	(136.255)
Summen	\$ 737.437	\$ 9.928.733	\$ 8.376	\$ 10.674.546

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

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 1	\$ 16.258.039	\$ 25.151	\$ 16.283.191
Investmentfonds	1.100.873	0	0	1.100.873
Pensionsgeschäfte	0	4.429	0	4.429
Finanzderivate ⁽³⁾	(17.710)	(6.413)	0	(24.123)
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(224.962)	0	(224.962)
Summen	\$ 1.083.164	\$ 16.031.093	\$ 25.151	\$ 17.139.408

⁽¹⁾ Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

⁽²⁾ Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

⁽³⁾ Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions- geschäften	% des Nettovermögens
BRC	3,500 %	08.08.2022	TBD(1)	\$ (2.704)	\$ (2.721)	(0,03)
JML	(0,250)	23.09.2022	TBD(1)	€ (1.348)	(1.433)	(0,01)
Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte					\$ (4.154)	(0,04)

⁽¹⁾ Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung des Marktwerts der außerbörslich gehandelten Finanzderivate und (erhaltenen)/verpfändeten Sicherheiten nach Kontrahenten zum 31. Dezember 2022 und 31. Dezember 2021:

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2022			Zum 31. Dez. 2021		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾
AZD	\$ 32	\$ 0	\$ 32	\$ (17)	\$ 0	\$ (17)
BOA	5.200	(5.790)	(590)	(1.494)	1.800	306
BOM	360	(470)	(110)	k. A.	k. A.	k. A.
BPS	(21.024)	20.550	(474)	(348)	0	(348)
BRC	977	0	977	(951)	660	(291)
BSH	(11)	0	(11)	k. A.	k. A.	k. A.
CBK	36.530	(37.360)	(830)	(214)	530	316
CLY	24	0	24	k. A.	k. A.	k. A.
DUB	(3.383)	3.210	(173)	(19)	600	581
FBF	189	(250)	(61)	282	(250)	32
GLM	(8.272)	8.408	136	(7.021)	8.520	1.499
GSC	k. A.	k. A.	k. A.	(57)	80	23
GST	1.037	(1.030)	7	6.699	(6.500)	199
HUS	k. A.	k. A.	k. A.	1.587	(1.410)	177
JLN	(237)	0	(237)	928	0	928
JPM	(9.156)	8.080	(1.076)	19.399	(19.970)	(571)
MBC	20.345	(19.090)	1.255	k. A.	k. A.	k. A.
MYC	(594)	630	36	1.021	(2.605)	(1.584)
MYI	(342)	280	(62)	20.129	(15.200)	4.929
RBC	236	(350)	(114)	(17.333)	9.420	(7.913)
RYL	14	0	14	k. A.	k. A.	k. A.
SAL	(90)	0	(90)	(253)	280	27
SCX	(14.373)	13.840	(533)	14.282	(8.320)	5.962
SOG	(88)	30	(58)	896	(760)	136
SSB	k. A.	k. A.	k. A.	94	0	94
TOR	365	(2.890)	(2.525)	14.353	(8.910)	5.443
UAG	623	0	623	12.251	(8.960)	3.291

⁽¹⁾ Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2022:

	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	63,86	70,71
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	28,59	23,22
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,33	0,98
Investmentfonds	9,85	6,42
Pensionsgeschäfte	0,72	0,03
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,41)	(0,09)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,44)	(0,42)
Freiverkehrsfinaanzderivate	0,08	0,37
Leerverkaufte Wertpapiere	(1,29)	(1,31)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(0,04)	(0,04)

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2022 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
Australien	1,72	1,36
Österreich	0,21	0,36
Belgien	0,12	0,29
Bermuda	0,66	0,82
Brasilien	0,32	1,15
Kanada	2,14	2,05
Kaimaninseln	3,29	4,90
Chile	0,06	0,05
China	0,27	1,26
Kolumbien	k. A.	0,03
Zypern	0,09	k. A.
Dänemark	0,30	0,47
Finnland	0,20	0,18
Frankreich	2,51	2,51
Deutschland	1,98	2,64
Guernsey, Kanalinseln	0,33	0,46
Hongkong	0,27	0,83
Indien	0,25	0,53
Indonesien	0,17	0,35
Irland	0,78	0,92
Insel Man	k. A.	0,18
Italien	2,62	2,23
Japan	1,59	1,92
Jersey, Kanalinseln	0,53	0,66
Kuwait	k. A.	0,14
Luxemburg	2,33	4,05
Mauritius	0,37	0,33
Mexiko	0,18	0,49
Multinational	0,03	0,12
Niederlande	2,56	3,17
Norwegen	0,13	0,27
Panama	0,18	0,28
Peru	1,25	1,34
Katar	0,10	0,24
Rumänien	0,31	0,26
Russland	0,02	0,43
Saudi-Arabien	0,16	0,23
Singapur	0,17	0,40
Slowakei	0,00	0,00
Slowenien	0,10	k. A.
Südafrika	0,95	0,47
Südkorea	0,07	0,14
Spanien	0,25	0,90
Supranational	0,22	0,15
Schweden	0,32	0,38
Schweiz	2,23	2,51
Thailand	0,07	0,05
Türkei	0,04	0,03
Ukraine	0,02	0,05
Vereinigte Arabische Emirate	0,08	0,20
Großbritannien	5,72	7,19
USA	51,20	44,58
Uruguay	k. A.	0,01
Jungferninseln (Britisch)	0,40	0,31
Kurzfristige Instrumente	2,91	0,04
Investmentfonds	9,85	6,42
Pensionsgeschäfte	0,72	0,03
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,41)	(0,09)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzkauf	0,00	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf	(0,07)	0,01
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,01	0,02
Zinsswaps	(0,38)	(0,45)

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Zinsswapoptionen	0,45	0,10
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaptions auf Kreditindizes	0,00	0,00
Zinsswapoptionen	(0,81)	(0,19)
Optionen auf Wertpapiere	0,00	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf	0,03	0,08
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,05	0,08
Devisenterminkontrakte	(0,50)	(0,28)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,86	0,58
Leerverkaufte Wertpapiere	(1,29)	(1,31)
Sonstige Aktiva und Passiva	(1,29)	0,09
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE			
AUSTRALIEN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Boral Finance Pty. Ltd. 3,750 % fällig am 01.05.2028	\$ 52	\$ 46	0,00
Commonwealth Bank of Australia 3,743 % fällig am 12.09.2039 (g)	200	147	0,01
GPT Wholesale Office Fund 3,222 % fällig am 05.11.2031	AUD 1.440	758	0,06
Lendlease Finance Ltd. 3,400 % fällig am 27.10.2027	1.370	811	0,06
Macquarie University 2,250 % fällig am 22.05.2030	750	404	0,03
Sydney Airport Finance Co. Pty. Ltd. 3,375 % fällig am 30.04.2025	\$ 150	142	0,01
Transurban Finance Co. Pty. Ltd. 2,450 % fällig am 16.03.2031	2.100	1.657	0,12
Vicinity Centres Trust 4,927 % fällig am 02.06.2028	AUD 2.500	1.638	0,12
Summe Australien		5.603	0,41
ÖSTERREICH			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Erste Group Bank AG 0,125 % fällig am 17.05.2028	€ 1.400	1.211	0,09
4,250 % fällig am 15.10.2027 (f)(g)	1.800	1.528	0,11
6,500 % fällig am 15.04.2024 (f)(g)	200	209	0,02
Summe Österreich		2.948	0,22
BELGIEN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
KBC Group NV 1,500 % fällig am 29.03.2026	500	503	0,04
3,000 % fällig am 25.08.2030	2.900	2.847	0,21
Silfin NV 2,875 % fällig am 11.04.2027	2.000	1.815	0,13
Summe Belgien		5.165	0,38
STAATSEMISSIONEN			
Communaute Francaise de Belgique 0,625 % fällig am 11.06.2035	2.000	1.482	0,11
Ministeries van de Vlaamse Gemeenschap 1,500 % fällig am 11.04.2044	300	220	0,01
3,250 % fällig am 12.01.2043	2.100	2.080	0,15
Summe Belgien		3.782	0,27
Summe Belgien		8.947	0,65
BRASILIEN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Itau Unibanco Holding S.A. 2,900 % fällig am 24.01.2023	\$ 300	300	0,02
KANADA			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Bank of Montreal 1,758 % fällig am 10.03.2026	CAD 2.900	1.941	0,14
Brookfield Finance, Inc. 2,724 % fällig am 15.04.2031	\$ 4.850	3.902	0,28
CGI, Inc. 2,300 % fällig am 14.09.2031	1.000	762	0,06
Manulife Financial Corp. 3,703 % fällig am 16.03.2032	1.000	894	0,07
Open Text Corp. 6,900 % fällig am 01.12.2027	2.900	2.904	0,21
Toronto-Dominion Bank 1,952 % fällig am 08.04.2030	€ 3.700	3.415	0,25
TransAlta Corp. 7,750 % fällig am 15.11.2029	\$ 1.350	1.381	0,10
Summe Kanada		15.199	1,11
STAATSEMISSIONEN			
Canada Government International Bond 2,250 % fällig am 01.12.2029	CAD 12.200	8.450	0,62

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Province of Quebec 1,850 % fällig am 13.02.2027	CAD 500	\$ 341	0,02
Summe Kanada		8.791	0,64
Summe Kanada		23.990	1,75
KAIMANINSELN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Alibaba Group Holding Ltd. 2,700 % fällig am 09.02.2041	\$ 2.100	1.346	0,10
Health & Happiness H&H International Holdings Ltd. 5,625 % fällig am 24.10.2024	1.200	1.067	0,08
MAF Sukuk Ltd. 3,933 % fällig am 28.02.2030	400	373	0,03
Xiaomi Best Time International Ltd. 4,100 % fällig am 14.07.2051	1.500	873	0,06
Summe Kaimaninseln		3.659	0,27
CHILE			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Banco de Credito e Inversiones S.A. 2,875 % fällig am 14.10.2031	3.100	2.583	0,19
STAATSEMISSIONEN			
Chile Government International Bond 1,250 % fällig am 22.01.2051	€ 2.200	1.268	0,09
3,500 % fällig am 25.01.2050	\$ 300	218	0,02
3,500 % fällig am 15.04.2053	1.600	1.141	0,08
4,340 % fällig am 07.03.2042	1.000	849	0,06
Summe Chile		3.476	0,25
Summe Chile		6.059	0,44
KOLUMBIEN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
BanColombia S.A. 3,000 % fällig am 29.01.2025	1.300	1.234	0,09
ZYPERN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Atrium Finance PLC 2,625 % fällig am 05.09.2027	€ 1.500	1.122	0,08
DÄNEMARK			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
A.P. Moller – Maersk A/S 0,750 % fällig am 25.11.2031	1.900	1.519	0,11
GN Store Nord A/S 0,875 % fällig am 25.11.2024	700	673	0,05
Nykredit Realkredit A/S 1,375 % fällig am 12.07.2027	1.650	1.567	0,12
Orsted A/S 5,125 % fällig am 13.09.2034	€ 1.300	1.544	0,11
TDC Net A/S 5,056 % fällig am 31.05.2028	€ 5.200	5.466	0,40
Summe Dänemark		10.769	0,79
FINNLAND			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Balder Finland Oyj 1,000 % fällig am 20.01.2029	400	286	0,02
Kemira Oyj 1,000 % fällig am 30.03.2028	1.000	876	0,06
Nordea Bank Abp 1,500 % fällig am 30.09.2026	\$ 3.000	2.594	0,19
3,750 % fällig am 01.03.2029 (f)(g)	3.300	2.556	0,19
SATO Oyj 1,375 % fällig am 24.02.2028	€ 1.200	930	0,07
SBB Treasury Oyj 1,125 % fällig am 26.11.2029	2.100	1.436	0,10
Summe Finnland		8.678	0,63

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
FRANKREICH			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Accor S.A. 2,375 % fällig am 29.11.2028	€ 3.100	\$ 2.838	0,21
Altarea S.C.A. 1,875 % fällig am 17.01.2028	1.400	1.163	0,08
Banque Federative du Credit Mutuel S.A. 0,250 % fällig am 29.06.2028	900	799	0,06
1,750 % fällig am 19.12.2024	€ 100	113	0,01
4,000 % fällig am 21.11.2029	€ 2.000	2.141	0,16
BNP Paribas S.A. 1,675 % fällig am 30.06.2027	\$ 6.150	5.360	0,39
2,219 % fällig am 09.06.2026	1.200	1.103	0,08
3,132 % fällig am 20.01.2033	2.800	2.218	0,16
3,500 % fällig am 16.11.2027	1.800	1.657	0,12
4,625 % fällig am 25.02.2031 (f)(g)	2.100	1.628	0,12
6,875 % fällig am 06.12.2029 (f)(g)	€ 1.000	1.058	0,08
BPCE S.A. 2,045 % fällig am 19.10.2027	\$ 4.000	3.453	0,25
3,116 % fällig am 19.10.2032	300	220	0,02
CNP Assurances 1,250 % fällig am 27.01.2029	€ 1.600	1.380	0,10
Credit Agricole Assurances S.A. 1,500 % fällig am 06.10.2031	3.400	2.670	0,19
Credit Agricole S.A. 0,125 % fällig am 09.12.2027	700	620	0,05
5,800 % fällig am 22.03.2024	\$ 2.000	2.005	0,15
Faurecia SE 2,750 % fällig am 15.02.2027	€ 4.000	3.618	0,26
Holding d'Infrastructures des Metiers de l'Environnement 0,125 % fällig am 16.09.2025	3.500	3.302	0,24
Ile-de-France Mobilités 0,675 % fällig am 24.11.2036	1.900	1.364	0,10
JCDecaux SE 1,625 % fällig am 07.02.2030	2.300	1.966	0,14
L'Oreal S.A. 0,875 % fällig am 29.06.2026	2.300	2.285	0,17
New Immo Holding S.A. 2,750 % fällig am 26.11.2026	200	182	0,01
Societe Generale S.A. 0,500 % fällig am 12.06.2029	400	343	0,03
3,625 % fällig am 01.03.2041	\$ 350	228	0,02
4,000 % fällig am 12.01.2027	2.200	2.040	0,15
7,875 % fällig am 18.12.2023 (f)(g)	200	198	0,01
Suez SACA 4,625 % fällig am 03.11.2028	€ 300	324	0,02
5,000 % fällig am 03.11.2032	1.200	1.315	0,10
Valeo 1,000 % fällig am 03.08.2028	2.900	2.390	0,17
5,375 % fällig am 28.05.2027	1.800	1.875	0,14
Verallia S.A. 1,625 % fällig am 14.05.2028	1.400	1.291	0,09
Vilmorin & Cie S.A. 1,375 % fällig am 26.03.2028	1.400	1.108	0,08
Summe Frankreich		54.255	3,96
STAATSEMISSIONEN			
Action Logement Services 1,375 % fällig am 13.04.2032	2.500	2.216	0,16
Agence Francaise de Developpement 1,625 % fällig am 25.05.2032	2.000	1.813	0,13
Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale 1,375 % fällig am 20.01.2031	\$ 4.000	3.227	0,24
2,750 % fällig am 25.11.2032	€ 1.000	1.008	0,07
France Government International Bond 0,500 % fällig am 25.06.2044	2.100	1.295	0,09
SNCF Reseau 0,750 % fällig am 25.05.2036	500	369	0,03
Societe Nationale SNCF S.A. 3,125 % fällig am 02.11.2027	5.600	5.883	0,43
UNEDIC ASSEO 0,000 % fällig am 19.11.2030 (c)	300	249	0,02
0,250 % fällig am 16.07.2035	500	357	0,03
Summe Frankreich		16.417	1,20
Summe Frankreich		70.672	5,16

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Investment Grade Credit ESG Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
DEUTSCHLAND				IRLAND				JERSEY, KANALINSELN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Amprion GmbH 3,450 % fällig am 22.09.2027	€ 1.500	\$ 1.573	0,11	Jubilee CLO DAC 2,128 % fällig am 12.07.2028	€ 8	\$ 8	0,00	3,010 % fällig am 19.10.2026	\$ 1.395	\$ 1.290	0,09
Deutsche Bahn Finance GmbH 0,625 % fällig am 08.12.2050	750	399	0,03	OCF Euro CLO DAC 0,000 % fällig am 20.01.2033 (b)	2.000	2.124	0,16	3,202 % fällig am 17.09.2029 (g)	400	344	0,03
Deutsche Bank AG 1,447 % fällig am 01.04.2025 (h)	\$ 2.000	1.858	0,13			2.132	0,16	5,087 % fällig am 19.07.2023	100	100	0,01
1,875 % fällig am 23.02.2028	€ 2.500	2.338	0,17	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Summito Mitsui Trust Bank Ltd. 2,800 % fällig am 10.03.2027	1.200	1.093	0,08
2,222 % fällig am 18.09.2024	\$ 100	97	0,01	AIB Group PLC 2,250 % fällig am 04.04.2028	2.800	2.671	0,20	Summe Japan		52.690	3,85
2,311 % fällig am 16.11.2027	3.000	2.547	0,19	5,750 % fällig am 16.02.2029	2.000	2.189	0,16	JERSEY, KANALINSELN			
3,547 % fällig am 18.09.2031	300	241	0,02	6,250 % fällig am 23.06.2025 (f)(g)	300	301	0,02	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
3,742 % fällig am 07.01.2033	2.300	1.638	0,12	Bank of Ireland Group PLC 1,875 % fällig am 05.06.2026	2.900	2.876	0,21	AA Bond Co. Ltd. 4,875 % fällig am 31.07.2043	€ 100	114	0,01
3,961 % fällig am 26.11.2025	500	478	0,03	6,253 % fällig am 16.09.2026	\$ 3.500	3.474	0,25	Aptiv PLC 3,100 % fällig am 01.12.2051	\$ 1.800	1.071	0,08
Eurogrid GmbH 1,113 % fällig am 15.05.2032	€ 300	253	0,02	7,594 % fällig am 06.12.2032	€ 3.000	3.590	0,26	Summe Jersey, Kanalinseln		1.185	0,09
3,279 % fällig am 05.09.2031	1.000	1.026	0,07	CCEP Finance Ireland DAC 0,500 % fällig am 06.09.2029	€ 1.900	1.647	0,12	LUXEMBURG			
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0,750 % fällig am 30.09.2030	\$ 1.100	862	0,06	Smurfit Kappa Acquisitions ULC 2,875 % fällig am 15.01.2026	300	311	0,02	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen 1,000 % fällig am 26.05.2042	€ 900	676	0,05			17.059	1,24	Acef Holding S.C.A. 0,750 % fällig am 14.06.2028	€ 1.700	1.342	0,10
Schaeffler AG 3,375 % fällig am 12.10.2028	3.200	2.983	0,22	Summe Irland		19.191	1,40	1,250 % fällig am 26.04.2030	2.900	2.138	0,16
Sixt SE 1,750 % fällig am 09.12.2024	400	412	0,03	ITALIEN				CBRE Global Investors Open-Ended Fund S.C.A. SICAV-SIF Pan European Core Fund 0,500 % fällig am 27.01.2028	600	496	0,04
Vantage Towers AG 0,000 % fällig am 31.03.2025 (c)	500	512	0,04	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				0,900 % fällig am 12.10.2029	3.700	2.885	0,21
0,375 % fällig am 31.03.2027	400	399	0,03	Intesa Sanpaolo SpA 2,625 % fällig am 11.03.2036	£ 1.000	773	0,06	CPI Property Group S.A. 1,500 % fällig am 27.01.2031	500	310	0,02
Vonovia SE 0,250 % fällig am 01.09.2028	1.600	1.310	0,10	3,875 % fällig am 12.01.2028	\$ 1.400	1.236	0,09	1,750 % fällig am 14.01.2030	3.300	2.149	0,16
1,375 % fällig am 28.01.2026	2.600	2.521	0,18	4,198 % fällig am 01.06.2032	900	663	0,05	2,750 % fällig am 12.05.2026	200	168	0,01
1,875 % fällig am 28.06.2028	1.900	1.730	0,13	4,950 % fällig am 01.06.2042	1.600	1.032	0,08	2,750 % fällig am 22.01.2028	£ 350	282	0,02
2,375 % fällig am 25.03.2032	400	341	0,02	5,017 % fällig am 26.06.2024	3.900	3.751	0,27	Logicor Financing SARL 1,625 % fällig am 17.01.2030	€ 500	390	0,03
ZF Finance GmbH 2,000 % fällig am 06.05.2027	1.500	1.315	0,10	Nexi SpA 2,125 % fällig am 30.04.2029	€ 1.600	1.390	0,10	2,000 % fällig am 17.01.2034	2.900	1.970	0,14
2,250 % fällig am 03.05.2028	2.300	1.926	0,14	Snam SpA 0,750 % fällig am 20.06.2029	500	436	0,03	Prologis International Funding S.A. 2,750 % fällig am 22.02.2032	€ 600	580	0,04
		27.435	2,00	UniCredit SpA 1,982 % fällig am 03.06.2027	\$ 1.900	1.622	0,12	Segro Capital SARL 1,875 % fällig am 23.03.2030	€ 550	501	0,04
STAATSEMISSIONEN				4,625 % fällig am 12.04.2027	2.000	1.875	0,14	SELP Finance SARL 0,875 % fällig am 27.05.2029	2.200	1.776	0,13
Bundesrepublik Deutschland 0,000 % fällig am 15.08.2031 (c)	14.700	12.671	0,93	5,459 % fällig am 30.06.2035	1.300	1.059	0,08	SIG Combibloc Purchase Co. SARL 1,875 % fällig am 18.06.2023	300	318	0,02
Land Nordrhein-Westfalen 0,500 % fällig am 25.11.2039	200	137	0,01	5,850 % fällig am 15.11.2027	€ 300	325	0,02			15.305	1,12
		12.808	0,94	7,296 % fällig am 02.04.2034	\$ 4.400	4.041	0,29	STAATSEMISSIONEN			
Summe Deutschland		40.243	2,94	Summe Italien		18.203	1,33	Großherzogtum Luxemburg			
GUERNSEY, KANALINSELN				JAPAN				Summe Luxemburg			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Summe Mauritius			
Globalworth Real Estate Investments Ltd. 2,950 % fällig am 29.07.2026	2.100	1.785	0,13	Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc. 0,337 % fällig am 08.06.2027	€ 700	654	0,05	MAURITIUS			
Sirius Real Estate Ltd. 1,125 % fällig am 22.06.2026	1.100	919	0,07	0,339 % fällig am 19.07.2024	200	204	0,01	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
1,750 % fällig am 24.11.2028	2.300	1.689	0,12	0,980 % fällig am 09.10.2023	300	316	0,02	India Green Energy Holdings 5,375 % fällig am 29.04.2024	\$ 1.450	1.396	0,10
Summe Guernsey, Kanalinseln		4.393	0,32	1,538 % fällig am 20.07.2027	\$ 2.400	2.084	0,15	India Green Power Holdings 4,000 % fällig am 22.02.2027	1.200	1.028	0,08
HONGKONG				2,494 % fällig am 13.10.2032	2.900	2.267	0,17	Summe Mauritius		2.424	0,18
STAATSEMISSIONEN				2,757 % fällig am 13.09.2026	3.932	3.598	0,26	MEXIKO			
Hong Kong Government International Bond 2,375 % fällig am 02.02.2051	\$ 300	189	0,01	3,273 % fällig am 19.09.2025	€ 2.000	2.102	0,15	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
INDIEN				3,837 % fällig am 17.04.2026	\$ 1.400	1.350	0,10	Banco Mercantil del Norte S.A. 6,625 % fällig am 24.01.2032 (f)(g)	1.800	1.494	0,11
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				Mitsui Fudosan Co. Ltd. 2,950 % fällig am 23.01.2023	3.385	3.381	0,25	Cibanco S.A. Ibm 4,962 % fällig am 18.07.2029	700	639	0,04
Bharti Airtel Ltd. 3,250 % fällig am 03.06.2031	500	423	0,03	Mizuho Financial Group, Inc. 0,214 % fällig am 07.10.2025	€ 100	98	0,01	Metalsa S.A. de C.V. 3,750 % fällig am 04.05.2031	2.900	2.286	0,17
4,375 % fällig am 10.06.2025	1.200	1.167	0,09	2,201 % fällig am 10.07.2031	\$ 2.900	2.270	0,17	Summe Mexiko		4.419	0,32
Indian Railway Finance Corp. Ltd. 3,570 % fällig am 21.01.2032	5.100	4.389	0,32	2,839 % fällig am 13.09.2026	8.261	7.528	0,55	MULTINATIONAL			
JSW Hydro Energy Ltd. 4,125 % fällig am 18.05.2031	3.806	3.177	0,23	3,261 % fällig am 22.05.2030	4.800	4.162	0,30	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
ReNew Power Pvt Ltd. 5,875 % fällig am 05.03.2027	1.550	1.490	0,11	3,490 % fällig am 05.09.2027	€ 1.700	1.768	0,13	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC 3,000 % fällig am 01.09.2029	€ 350	275	0,02
ReNew Wind Energy AP2 4,500 % fällig am 14.07.2028	3.000	2.521	0,18	Nippon Life Insurance Co. 2,900 % fällig am 16.09.2051	\$ 700	562	0,04	NXP BV 2,500 % fällig am 11.05.2031	\$ 2.660	2.125	0,16
Summe Indien		13.167	0,96	Nomura Holdings, Inc. 2,172 % fällig am 14.07.2028	4.100	3.392	0,25	5,000 % fällig am 15.01.2033	6.500	6.158	0,45
				2,329 % fällig am 22.01.2027	3.900	3.420	0,25	Summe Multinational		8.558	0,63
				Norinchukin Bank 1,284 % fällig am 22.09.2026	2.000	1.745	0,13				
				NTT Finance Corp. 4,142 % fällig am 26.07.2024	2.700	2.659	0,19				
				ORIX Corp. 1,919 % fällig am 20.04.2026	€ 3.000	3.011	0,22				
				Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc. 2,472 % fällig am 14.01.2029	\$ 3.900	3.292	0,24				

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS			
NIEDERLANDE				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL						
ABN AMRO Bank NV 2,470 % fällig am 13.12.2029	\$	6.800	5.511	0,40	Stedin Holding NV 0,500 % fällig am 14.11.2029	€	100	\$ 86	0,01	Kookmin Bank 2,500 % fällig am 04.11.2030 (g)	\$	900	\$ 718	0,05
Akzo Nobel NV 2,000 % fällig am 28.03.2032	€	750	681	0,05	TenneT Holding BV 4,250 % fällig am 28.04.2032		1.000	1.092	0,08	Shinhan Bank Co. Ltd. 1,183 % fällig am 29.09.2025	AUD	800	485	0,04
Alcoa Nederland Holding BV 5,500 % fällig am 15.12.2027	\$	1.000	965	0,07	Thermo Fisher Scientific Finance BV 0,000 % fällig am 18.11.2025 (c)		1.000	968	0,07	4,000 % fällig am 23.04.2029 (g)	\$	600	536	0,04
Citycon Treasury BV 1,625 % fällig am 12.03.2028	€	400	312	0,02	2,000 % fällig am 18.10.2051		1.700	1.148	0,08	4,375 % fällig am 13.04.2032 (g)		2.200	1.966	0,14
Compass Group Finance Netherlands BV 3,000 % fällig am 08.03.2030		1.700	1.724	0,13	Vesteda Finance BV 0,750 % fällig am 18.10.2031		3.700	2.876	0,21	5,000 % fällig am 16.11.2025	AUD	1.500	1.028	0,08
Cooperatieve Rabobank UA 1,004 % fällig am 24.09.2026	\$	3.500	3.095	0,23	Vonovia Finance BV 1,125 % fällig am 08.09.2025		200	195	0,01	SK Hynix, Inc. 2,375 % fällig am 19.01.2031	\$	1.000	734	0,05
1,106 % fällig am 24.02.2027		800	700	0,05	Wabtec Transportation Netherlands BV 1,250 % fällig am 03.12.2027		4.200	3.811	0,28				7.721	0,56
3,100 % fällig am 29.06.2028 (f)(g)	€	1.000	828	0,06	WPC Eurobond BV 1,350 % fällig am 15.04.2028		200	178	0,01	STAATSEMISSIONEN				
3,758 % fällig am 06.04.2033	\$	3.450	2.948	0,22				96.534	7,05	Export-Import Bank of Korea 2,125 % fällig am 18.01.2032		2.000	1.602	0,12
4,375 % fällig am 29.06.2027 (f)(g)	€	1.000	953	0,07	NON-AGENCY-MBS				Korea Expressway Corp. 1,125 % fällig am 17.05.2026		1.000	888	0,06	
4,875 % fällig am 29.06.2029 (f)(g)		2.800	2.571	0,19	STAATSEMISSIONEN				Korea Housing Finance Corp. 0,010 % fällig am 05.02.2025	€	400	396	0,03	
5,250 % fällig am 14.09.2027	£	800	930	0,07	STAATSEMISSIONEN				Korea Water Resources Corp. 3,500 % fällig am 27.04.2025	\$	3.500	3.378	0,25	
CTP NV 0,500 % fällig am 21.06.2025	€	3.000	2.688	0,20	STAATSEMISSIONEN							6.264	0,46	
0,875 % fällig am 20.01.2026		2.700	2.349	0,17	STAATSEMISSIONEN				Summe Südkorea			13.985	1,02	
1,250 % fällig am 21.06.2029		400	285	0,02	STAATSEMISSIONEN				SPANIEN					
1,500 % fällig am 27.09.2031		2.500	1.604	0,12	STAATSEMISSIONEN				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
Digital Dutch Finco BV 1,000 % fällig am 15.01.2032		350	263	0,02	STAATSEMISSIONEN				Banco de Sabadell S.A. 0,875 % fällig am 16.06.2028	€	3.400	2.927	0,21	
1,250 % fällig am 01.02.2031		1.100	862	0,06	STAATSEMISSIONEN				5,125 % fällig am 10.11.2028		2.500	2.678	0,20	
Digital Intrepid Holding BV 0,625 % fällig am 15.07.2031		1.650	1.212	0,09	STAATSEMISSIONEN				Banco Santander S.A. 0,625 % fällig am 24.06.2029		800	702	0,05	
1,375 % fällig am 18.07.2032		1.000	763	0,06	STAATSEMISSIONEN				3,490 % fällig am 28.05.2030	\$	400	338	0,02	
EnBW International Finance BV 3,625 % fällig am 22.11.2026		2.050	2.193	0,16	STAATSEMISSIONEN				3,625 % fällig am 21.03.2029 (f)(g)	€	600	446	0,03	
Enel Finance International NV 0,375 % fällig am 28.05.2029		2.000	1.699	0,12	STAATSEMISSIONEN				4,125 % fällig am 12.11.2027 (f)(g)		1.000	856	0,06	
1,875 % fällig am 12.07.2028	\$	1.700	1.353	0,10	STAATSEMISSIONEN				4,175 % fällig am 24.03.2028	\$	2.000	1.858	0,14	
2,250 % fällig am 12.07.2031		2.300	1.679	0,12	STAATSEMISSIONEN				4,375 % fällig am 14.01.2026 (f)(g)	€	400	364	0,03	
2,875 % fällig am 11.04.2029	£	3.100	3.197	0,23	STAATSEMISSIONEN				Bankinter S.A. 0,625 % fällig am 06.10.2027		1.000	901	0,07	
4,625 % fällig am 15.06.2027	\$	5.400	5.117	0,37	STAATSEMISSIONEN				CaixaBank S.A. 0,625 % fällig am 21.01.2028		3.000	2.785	0,20	
7,750 % fällig am 14.10.2052		2.000	2.147	0,16	STAATSEMISSIONEN				1,500 % fällig am 03.12.2026	£	700	736	0,05	
Holcim Sterling Finance Netherlands BV 2,250 % fällig am 04.04.2034	£	1.800	1.487	0,11	STAATSEMISSIONEN				5,375 % fällig am 14.11.2030	€	100	109	0,01	
Iberdrola International BV 6,750 % fällig am 15.09.2033	\$	1.200	1.269	0,09	STAATSEMISSIONEN				5,875 % fällig am 09.10.2027 (f)(g)		800	784	0,06	
ING Groep NV 1,400 % fällig am 01.07.2026		1.800	1.620	0,12	STAATSEMISSIONEN				Cellnex Finance Co. S.A. 3,875 % fällig am 07.07.2041	\$	1.000	686	0,05	
1,726 % fällig am 01.04.2027		1.900	1.679	0,12	STAATSEMISSIONEN							16.170	1,18	
2,125 % fällig am 23.05.2026	€	2.700	2.746	0,20	STAATSEMISSIONEN				STAATSEMISSIONEN					
3,875 % fällig am 16.05.2027 (f)(g)	\$	200	147	0,01	STAATSEMISSIONEN				Spain Government International Bond 1,000 % fällig am 30.07.2042	€	3.170	2.059	0,15	
4,017 % fällig am 28.03.2028		2.300	2.154	0,16	STAATSEMISSIONEN				Xunta de Galicia 0,084 % fällig am 30.07.2027		150	138	0,01	
4,125 % fällig am 24.08.2033	€	2.100	2.114	0,15	STAATSEMISSIONEN							2.197	0,16	
4,250 % fällig am 16.05.2031 (f)(g)	\$	1.000	689	0,05	STAATSEMISSIONEN				Summe Spanien			18.367	1,34	
4,875 % fällig am 16.05.2029 (f)(g)		600	465	0,03	STAATSEMISSIONEN				SUPRANATIONAL					
5,750 % fällig am 16.11.2026 (f)(g)		550	488	0,04	STAATSEMISSIONEN				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
6,500 % fällig am 16.04.2025 (f)(g)		300	284	0,02	STAATSEMISSIONEN				Asian Development Bank 1,500 % fällig am 04.05.2028	CAD	2.000	1.314	0,09	
JAB Holdings BV 4,500 % fällig am 08.04.2052		4.100	2.797	0,20	STAATSEMISSIONEN				6,550 % fällig am 26.01.2025	ZAR	64.000	3.666	0,27	
JDE Peet's NV 0,625 % fällig am 09.02.2028	€	1.300	1.163	0,09	STAATSEMISSIONEN				Banque Ouest Africaine de Developpement 2,750 % fällig am 22.01.2033	€	800	649	0,05	
1,125 % fällig am 16.06.2033		300	233	0,02	STAATSEMISSIONEN				Eisenbahnmaterial					
2,250 % fällig am 24.09.2031	\$	1.000	758	0,06	STAATSEMISSIONEN				0,000 % fällig am 28.07.2026 (c)		1.000	952	0,07	
LeasePlan Corp. NV 0,250 % fällig am 07.09.2026	€	3.500	3.205	0,23	STAATSEMISSIONEN				3,125 % fällig am 09.11.2031		3.200	3.384	0,25	
1,375 % fällig am 07.03.2024		800	830	0,06	STAATSEMISSIONEN				Europäische Investitionsbank 0,750 % fällig am 15.07.2027	AUD	2.100	1.214	0,09	
Mondelez International Holdings Netherlands BV 0,250 % fällig am 09.09.2029		2.000	1.709	0,13	STAATSEMISSIONEN				1,500 % fällig am 15.06.2032	€	3.000	2.787	0,20	
Nationale-Niederlande Bank NV 0,500 % fällig am 21.09.2028		2.800	2.426	0,18	STAATSEMISSIONEN				Europäische Union					
1,875 % fällig am 17.05.2032		500	474	0,03	STAATSEMISSIONEN				0,000 % fällig am 04.10.2030 (c)		3.700	3.134	0,23	
NE Property BV 2,000 % fällig am 20.01.2030		4.200	3.112	0,23	STAATSEMISSIONEN				0,000 % fällig am 04.07.2035 (c)		700	504	0,04	
3,375 % fällig am 14.07.2027		600	556	0,04	STAATSEMISSIONEN				0,300 % fällig am 04.11.2050		1.900	970	0,07	
Prosus NV 2,085 % fällig am 19.01.2030		1.300	1.084	0,08	STAATSEMISSIONEN				0,400 % fällig am 04.02.2037		2.150	1.557	0,11	
2,778 % fällig am 19.01.2034		200	154	0,01	STAATSEMISSIONEN				1,250 % fällig am 04.02.2043		8.000	6.016	0,44	
3,257 % fällig am 19.01.2027	\$	2.200	1.970	0,14	STAATSEMISSIONEN				2,625 % fällig am 04.02.2048		1.300	1.255	0,09	
SGS Nederland Holding BV 0,125 % fällig am 21.04.2027	€	1.900	1.938	0,14	STAATSEMISSIONEN									

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
3,384 % fällig am 02.04.2026	\$ 7.800	\$ 7.456	0,54	FactSet Research Systems, Inc.	\$ 4.100	\$ 3.448	0,25	Low Income Investment Fund	\$ 300	\$ 282	0,02
3,559 % fällig am 23.04.2027	2.600	2.439	0,18	3,450 % fällig am 01.03.2032				Merck & Co., Inc.	2.000	1.721	0,13
6,204 % fällig am 10.11.2028	4.060	4.199	0,31	Farmers Exchange Capital	400	366	0,03	1,900 % fällig am 10.12.2028			
Bank of New York Mellon Corp.				5,454 % fällig am 15.10.2054				Micron Technology, Inc.	1.800	1.350	0,10
5,802 % fällig am 25.10.2028	3.500	3.625	0,26	First American Financial Corp.	3.600	2.640	0,19	2,703 % fällig am 15.04.2032			
BlueHub Loan Fund, Inc.				2,400 % fällig am 15.08.2031	700	588	0,04	Microsoft Corp.	393	251	0,02
3,099 % fällig am 01.01.2030	650	564	0,04	4,000 % fällig am 15.05.2030				2,675 % fällig am 01.06.2060			
Boston Properties LP				Fiserv, Inc.	£ 100	100	0,01	MidAmerican Energy Co.	1.750	1.129	0,08
2,550 % fällig am 01.04.2032	1.930	1.472	0,11	Ford Motor Credit Co. LLC	€ 400	424	0,03	2,700 % fällig am 01.08.2052			
Bush Foundation				1,514 % fällig am 17.02.2023	900	920	0,07	Moody's Corp.	700	555	0,04
2,754 % fällig am 01.10.2050	375	245	0,02	1,744 % fällig am 19.07.2024	\$ 1.000	915	0,07	2,550 % fällig am 18.08.2060	500	283	0,02
CBRE Services, Inc.				2,300 % fällig am 10.02.2025	€ 200	206	0,01	Morgan Stanley	8.900	6.736	0,49
2,500 % fällig am 01.04.2031	1.000	791	0,06	2,684 % fällig am 01.12.2024	\$ 700	560	0,04	1,928 % fällig am 28.04.2032			
Centene Corp.				2,900 % fällig am 10.02.2029	€ 300	315	0,02	Morgan Stanley Domestic Holdings, Inc.	200	189	0,01
3,000 % fällig am 15.10.2030	6.000	4.932	0,36	3,021 % fällig am 06.03.2024	\$ 800	725	0,05	3,800 % fällig am 24.08.2027	1.500	1.461	0,11
Charles Schwab Corp.				3,375 % fällig am 13.11.2025	€ 400	458	0,03	4,500 % fällig am 20.06.2028			
4,000 % fällig am 01.12.2030 (f)	1.400	1.116	0,08	4,535 % fällig am 06.03.2025				MPT Operating Partnership LP	£ 200	229	0,02
Chubb INA Holdings, Inc.				FS KKR Capital Corp.	\$ 1.300	1.050	0,08	2,550 % fällig am 05.12.2023			
0,875 % fällig am 15.06.2027	€ 200	187	0,01	3,125 % fällig am 12.10.2028				National Rural Utilities Cooperative Finance Corp.	\$ 5.100	4.725	0,34
Cigna Corp.				Gap, Inc.	1.050	742	0,05	4,150 % fällig am 15.12.2032			
3,750 % fällig am 15.07.2023	\$ 163	162	0,01	3,625 % fällig am 01.10.2029	€ 200	222	0,02	Netflix, Inc.	€ 4.400	4.402	0,32
Citigroup, Inc.				Goldman Sachs Group, Inc.	€ 800	802	0,06	3,875 % fällig am 15.11.2029			
2,572 % fällig am 03.06.2031 (h)	8.700	7.056	0,51	1,000 % fällig am 16.12.2025	\$ 1.000	764	0,06	NextEra Energy Capital Holdings, Inc.	\$ 4.000	3.422	0,25
4,615 % fällig am 25.01.2026 (h)	2.000	1.956	0,14	1,500 % fällig am 07.12.2027	900	700	0,05	1,900 % fällig am 15.06.2028			
Clearway Energy Operating LLC				1,992 % fällig am 27.01.2032	5.600	4.479	0,33	Niagara Mohawk Power Corp.	3.450	3.458	0,25
3,750 % fällig am 01.01.2032	700	564	0,04	2,383 % fällig am 21.07.2032	3.300	2.943	0,21	5,783 % fällig am 16.09.2052			
Community Preservation Corp.				2,615 % fällig am 22.04.2032	900	713	0,05	Northern States Power Co.	1.300	830	0,06
2,867 % fällig am 01.02.2030	1.225	1.036	0,08	2,640 % fällig am 24.02.2028	1.100	896	0,07	2,600 % fällig am 01.06.2051	1.300	895	0,07
Conagra Brands, Inc.				2,650 % fällig am 21.10.2032	€ 115	123	0,01	2,900 % fällig am 01.03.2050			
1,375 % fällig am 01.11.2027	600	501	0,04	3,102 % fällig am 24.02.2033	\$ 500	465	0,03	NSTAR Electric Co.	1.300	1.264	0,09
Continental Wind LLC				3,250 % fällig am 01.02.2023				NVR, Inc.	2.000	1.683	0,12
6,000 % fällig am 28.02.2033	2.515	2.523	0,18	3,691 % fällig am 05.06.2028	4.100	3.749	0,27	3,000 % fällig am 15.05.2030			
Corebridge Financial, Inc.				Goodman U.S. Finance Five LLC	6.050	5.453	0,40	Oracle Corp.	300	215	0,02
3,900 % fällig am 05.04.2032	6.700	5.870	0,43	4,625 % fällig am 04.05.2032	255	222	0,02	3,950 % fällig am 25.03.2051 (h)			
Corporate Office Properties LP				GSK Consumer Healthcare Capital U.S. LLC				Owens Corning	4.500	4.009	0,29
2,000 % fällig am 15.01.2029	700	538	0,04	3,375 % fällig am 24.03.2029	4.700	4.300	0,31	3,875 % fällig am 01.06.2030			
2,250 % fällig am 15.03.2026	500	439	0,03	HAT Holdings LLC	1.700	1.641	0,12	Pacific Life Global Funding	605	534	0,04
Crown Castle, Inc.				3,375 % fällig am 15.06.2026				1,375 % fällig am 14.04.2026	2.000	1.572	0,11
2,500 % fällig am 15.07.2031	1.000	808	0,06	HCA, Inc.	1.750	1.470	0,11	2,450 % fällig am 11.01.2032	2.000	1.999	0,15
3,250 % fällig am 15.01.2051	600	393	0,03	4,125 % fällig am 15.06.2029				5,051 % fällig am 06.12.2024			
5,200 % fällig am 15.02.2049	100	90	0,01	4,500 % fällig am 15.02.2027	2.200	1.688	0,12	PacifiCorp	1.200	1.195	0,09
CVS Health Corp.				Healthpeak Properties, Inc.	5.400	4.526	0,33	5,350 % fällig am 01.12.2053			
4,300 % fällig am 25.03.2028	192	186	0,01	2,125 % fällig am 01.12.2028	1.370	1.168	0,08	Penn Mutual Life Insurance Co.	1.800	1.196	0,09
Dell International LLC				Host Hotels & Resorts LP	3.600	3.367	0,25	3,800 % fällig am 29.04.2061			
3,375 % fällig am 15.12.2041	1.470	990	0,07	2,900 % fällig am 15.12.2031	1.370	1.168	0,08	PepsiCo, Inc.	1.400	1.238	0,09
5,300 % fällig am 01.10.2029	2.000	1.961	0,14	3,375 % fällig am 15.12.2029	2.000	2.071	0,15	2,625 % fällig am 29.07.2029			
Digital Euro Finco LLC				Hudson Pacific Properties LP				PG&E Recovery Funding LLC	2.200	2.240	0,16
2,500 % fällig am 16.01.2026	€ 850	842	0,06	3,950 % fällig am 01.11.2027				5,536 % fällig am 15.07.2049			
Digital Stout Holding LLC				5,950 % fällig am 15.02.2028	1.900	1.760	0,13	PNC Bank N.A.	600	508	0,04
3,300 % fällig am 19.07.2029	£ 100	101	0,01	Humana, Inc.	2.000	1.732	0,13	2,700 % fällig am 22.10.2029			
3,750 % fällig am 17.10.2030	400	403	0,03	1,350 % fällig am 03.02.2027	3.200	2.936	0,21	Principal Life Global Funding	2.750	2.388	0,17
Discover Bank				3,700 % fällig am 23.03.2029	95	91	0,01	1,250 % fällig am 16.08.2026	2.000	1.852	0,13
3,450 % fällig am 27.07.2026	\$ 3.860	3.559	0,26	3,950 % fällig am 15.03.2027				1,375 % fällig am 10.01.2025			
Discovery Communications LLC				5,875 % fällig am 01.03.2033				Prologis Euro Finance LLC	€ 3.000	2.407	0,18
4,875 % fällig am 01.04.2043	1.900	1.427	0,10	International Flavors & Fragrances, Inc.	1.600	1.345	0,10	1,500 % fällig am 08.02.2034			
Doris Duke Charitable Foundation				1,832 % fällig am 15.10.2027				Prologis LP	\$ 3.000	2.386	0,17
2,345 % fällig am 01.07.2050	400	236	0,02	Interstate Power & Light Co.	1.200	1.100	0,08	2,250 % fällig am 15.01.2032			
DTE Electric Co.				3,600 % fällig am 01.04.2029				Protective Life Global Funding	5.000	5.001	0,36
3,250 % fällig am 01.04.2051	1.100	793	0,06	John Deere Capital Corp.	1.900	1.760	0,13	5,335 % fällig am 11.12.2024			
3,950 % fällig am 01.03.2049	700	577	0,04	3,350 % fällig am 18.04.2029	8.750	6.938	0,51	Public Service Co. of Colorado	625	406	0,03
Duke Energy Florida LLC				JPMorgan Chase & Co.	6.500	5.222	0,38	2,700 % fällig am 15.01.2051	400	286	0,02
2,500 % fällig am 01.12.2029	300	257	0,02	2,545 % fällig am 08.11.2032	3.500	3.348	0,24	3,200 % fällig am 01.03.2050	2.100	2.003	0,15
Elevance Health, Inc.				2,580 % fällig am 22.04.2032	300	283	0,02	3,700 % fällig am 15.06.2028			
2,875 % fällig am 15.09.2029	1.812	1.596	0,12	4,323 % fällig am 26.04.2028				Public Service Co. of Oklahoma	2.200	1.469	0,11
Empower Finance LP				4,565 % fällig am 14.06.2030				3,100 % fällig am 15.03.2032	2.950	2.587	0,19
1,776 % fällig am 17.03.2031	3.400	2.564	0,19	Kaiser Foundation Hospitals	2.850	2.077	0,15	Qorvo, Inc.	4.900	4.519	0,33
Equitable Financial Life Global Funding				2,810 % fällig am 01.06.2041	€ 100	115	0,01	1,750 % fällig am 15.12.2024			
1,300 % fällig am 12.07.2026	3.550	3.077	0,22	Keurig Dr Pepper, Inc.	\$ 500	377	0,03	Quanta Services, Inc.	3.000	2.474	0,18
5,500 % fällig am 02.12.2025	2.000	1.998	0,15	4,050 % fällig am 15.04.2032				Rayonier LP	2.500	2.014	0,15
ERAC USA Finance LLC				Kilroy Realty LP				2,750 % fällig am 17.05.2031			
3,800 % fällig am 01.11.2025	5.000	4.786	0,35	2,650 % fällig am 15.11.2033							
Eversource Energy				Kraft Heinz Foods Co.							
1,650 % fällig am 15.08.2030	800	624	0,05	4,125 % fällig am 01.07.2027							
F&G Global Funding				Liberty Utilities Finance GP							
2,300 % fällig am 11.04.2027	2.000	1.761	0,13	2,050 % fällig am 15.09.2030							

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Investment Grade Credit ESG Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS			
Realty Income Corp. 1,750 % fällig am 13.07.2033	£ 2.000	\$ 1.661	0,12	2,100 % fällig am 22.03.2028	\$ 700	\$ 609	0,04	US-SCHATZ Obligationen						
Regency Centers LP 2,950 % fällig am 15.09.2029	\$ 1.100	926	0,07	2,850 % fällig am 03.09.2041	1.550	1.073	0,08	U.S. Treasury Bonds						
Reliance Steel & Aluminum Co. 2,150 % fällig am 15.08.2030	1.000	790	0,06	3,875 % fällig am 08.02.2029	2.400	2.257	0,16	1,750 % fällig am 15.08.2041	\$ 33.200	\$ 22.736	1,66			
Rexford Industrial Realty LP 2,150 % fällig am 01.09.2031	950	730	0,05	VMware, Inc. 2,200 % fällig am 15.08.2031	1.000	761	0,06	1,875 % fällig am 15.02.2041 (i)	17.500	12.379	0,90			
S&P Global, Inc. 2,700 % fällig am 01.03.2029	5.500	4.852	0,35	4,700 % fällig am 15.05.2030	3.000	2.798	0,20	2,000 % fällig am 15.11.2041	39.500	28.223	2,06			
salesforce.com, Inc. 1,500 % fällig am 15.07.2028	1.750	1.496	0,11	Warnermedia Holdings, Inc. 3,755 % fällig am 15.03.2027	700	631	0,05	2,250 % fällig am 15.05.2041	35.400	26.632	1,95			
San Diego Gas & Electric Co. 2,950 % fällig am 15.08.2051	1.750	1.191	0,09	4,279 % fällig am 15.03.2032	2.500	2.066	0,15	2,375 % fällig am 15.02.2042 (i)	57.200	43.701	3,19			
Santander Holdings USA, Inc. 2,490 % fällig am 06.01.2028	1.400	1.203	0,09	5,391 % fällig am 15.03.2062	500	367	0,03	2,875 % fällig am 15.05.2052 (i)	2.620	2.100	0,15			
SLM Corp. 3,125 % fällig am 02.11.2026	1.400	1.192	0,09	Wells Fargo & Co. 4,540 % fällig am 15.08.2026	6.200	6.082	0,44	3,250 % fällig am 15.05.2042	45.000	39.473	2,88			
Solar Star Funding LLC 5,375 % fällig am 30.06.2035	1.888	1.838	0,13	Welltower, Inc. 3,850 % fällig am 15.06.2032	2.900	2.469	0,18	3,375 % fällig am 15.08.2042 (i)	12.300	10.997	0,80			
Southern California Edison Co. 3,600 % fällig am 01.06.2051	1.200	866	0,06	Weyerhaeuser Co. 6,875 % fällig am 15.12.2033	70	75	0,01	4,000 % fällig am 15.11.2042 (j)	23.300	22.819	1,67			
3,650 % fällig am 01.06.2051	2.500	1.830	0,13	Wisconsin Electric Power Co. 4,750 % fällig am 30.09.2032	1.850	1.819	0,13	U.S. Treasury Inflation Protected Securities (e)	0.625 % fällig am 15.07.2032 (j)	30.869	28.300	2,07		
3,900 % fällig am 01.12.2041	100	75	0,01	Wisconsin Public Service Corp. 2,850 % fällig am 01.12.2051	2.250	1.449	0,11	U.S. Treasury Notes						
5,850 % fällig am 01.11.2027	700	722	0,05	WP Carey, Inc. 2,450 % fällig am 01.02.2032	2.200	1.725	0,13	0,500 % fällig am 30.11.2023	22.700	21.841	1,60			
5,950 % fällig am 01.11.2032	4.500	4.769	0,35	Xylem, Inc. 2,250 % fällig am 30.01.2031	2.100	1.709	0,12	0,750 % fällig am 30.04.2026	7.400	6.617	0,48			
Southwestern Public Service Co. 5,150 % fällig am 01.06.2052	2.000	1.849	0,13	ZF North America Capital, Inc. 2,750 % fällig am 27.04.2023	€ 200	213	0,02	3,125 % fällig am 31.08.2027 (i)	3.250	3.126	0,23			
Sprint LLC 7,875 % fällig am 15.09.2023	100	102	0,01	Zoetis, Inc. 2,000 % fällig am 15.05.2030	\$ 6.100	4.964	0,36	4,250 % fällig am 15.10.2025 (i)	21.700	21.686	1,58			
Standard Industries, Inc. 2,250 % fällig am 21.11.2026	€ 1.600	1.467	0,11			378.370	27,62				290.630	21,22		
State Street Corp. 5,751 % fällig am 04.11.2026	\$ 2.600	2.664	0,19	KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG				Summe USA				766.230	55,93	
SVB Financial Group 4,100 % fällig am 15.02.2031 (f)	1.200	699	0,05	IQVIA, Inc. 4,202 % fällig am 07.03.2024	€ 1.000	1.068	0,08	JUNGFERNINSELN (BRITISCH)						
T-Mobile USA, Inc. 2,550 % fällig am 15.02.2031	2.000	1.639	0,12	TerraForm Power Operating LLC 7,430 % fällig am 21.05.2029	\$ 1.990	1.979	0,14	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL						
2,625 % fällig am 15.02.2029	1.000	848	0,06			3.047	0,22	TSMC Global Ltd. 1,250 % fällig am 23.04.2026	3.600	3.228	0,24			
3,300 % fällig am 15.02.2051	900	605	0,04	KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL				KURZFRISTIGE INSTRUMENTE						
Topaz Solar Farms LLC 5,750 % fällig am 30.09.2039	1.347	1.280	0,09	California Health Facilities Financing Authority Revenue Bonds, Series 2022	4.190 % fällig am 01.06.2037	2.100	1.880	0,14	COMMERCIAL PAPER					
Toyota Motor Credit Corp. 3,050 % fällig am 22.03.2027	1.300	1.214	0,09	University of Michigan Revenue Bonds, Series 2022	3,504 % fällig am 01.04.2052	1.300	1.016	0,07	AT&T, Inc. 4,650 % fällig am 13.01.2023	€ 11.500	11.479	0,84		
5,050 % fällig am 11.12.2023	3.200	3.205	0,23			2.896	0,21	Baxter International, Inc. 4,730 % fällig am 23.01.2023	1.000	997	0,07			
Truist Financial Corp. 1,267 % fällig am 02.03.2027	1.900	1.686	0,12	US-REGIERUNGSBEHÖRDEN				Electricite de France S.A. 5,000 % fällig am 20.01.2023	5.500	5.485	0,40			
UDR, Inc. 2,100 % fällig am 01.08.2032	400	295	0,02	Freddie Mac 1,021 % fällig am 25.08.2029 (a)	2.325	117	0,01	Fidelity National Information Services, Inc. 4,580 % fällig am 10.01.2023	12.000	11.983	0,87			
UnitedHealth Group, Inc. 5,350 % fällig am 15.02.2033	800	828	0,06	Uniform Mortgage-Backed Security 3,000 % fällig am 01.07.2052	6.663	5.857	0,42	Humana, Inc. 4,850 % fällig am 19.01.2023	17.800	17.754	1,30			
5,875 % fällig am 15.02.2053	600	652	0,05	3,500 % fällig am 01.12.2052	100	91	0,01	Medtronic Global Holdings S.C.A. 4,750 % fällig am 27.01.2023	4.000	3.986	0,29			
USAA Capital Corp. 2,125 % fällig am 01.05.2030	1.000	822	0,06	Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,500 % fällig am 01.02.2053	14.900	13.547	0,99	Oracle Corp. 4,580 % fällig am 04.01.2023	10.000	9.994	0,73			
VeriSign, Inc. 2,700 % fällig am 15.06.2031	1.100	899	0,07	4,000 % fällig am 01.02.2053	62.900	59.026	4,31	Walgreens Boots Alliance, Inc. 4,900 % fällig am 11.01.2023	4.000	3.994	0,29			
Verizon Communications, Inc. 1,500 % fällig am 18.09.2030	5.560	4.335	0,32			78.638	5,74	4,950 % fällig am 18.01.2023	1.500	1.496	0,11			
												67.168	4,90	
								AUSTRIA TREASURY BILLS						
								1,267 % fällig am 23.02.2023 (c)(d)	11.725	12.493	0,91			
								Summe kurzfristige Instrumente				79.661	5,81	
								Summe Übertragbare Wertpapiere				\$ 1.489.771	108,75	

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft ⁽¹⁾	% des Netto- vermögens
SSB	1,900 %	30.12.2022	03.01.2023	\$ 15.240	U.S. Treasury Notes 1,875 % fällig am 30.06.2026	\$ (15.545)	\$ 15.240	\$ 15.242	1,11
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (15.545)	\$ 15.240	\$ 15.242	1,11

⁽¹⁾ Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Australia Government 10-Year Bond March Futures	Long	03.2023	134	\$ (600)	(0,04)
Canada Government 10-Year Bond March Futures	Long	03.2023	86	(133)	(0,01)
Euro-Bobl March Futures	Short	03.2023	2	8	0,00
Euro-Bund 10-Year Bond March Futures	Short	03.2023	445	4.118	0,30
Euro-Buxl 30-Year Bond March Futures	Short	03.2023	57	1.432	0,10
Japan Government 10-Year Bond March Futures	Short	03.2023	12	243	0,02
U.S. Treasury 2-Year Note March Futures	Long	03.2023	342	90	0,01
U.S. Treasury 5-Year Note March Futures	Long	03.2023	286	(85)	(0,01)
U.S. Treasury 10-Year Note March Futures	Short	03.2023	238	72	0,01
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond March Futures	Short	03.2023	267	(82)	(0,01)
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond March Futures	Short	03.2023	1.649	2.519	0,19
United Kingdom Long Gilt December Futures	Long	03.2023	295	(2.374)	(0,17)
United Kingdom Long Gilt March Futures	Short	03.2023	135	1.036	0,07
				\$ 6.244	0,46
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate					
				\$ 6.244	0,46

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZKAUF⁽¹⁾

Referenzeinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Koninklijke KPN NV	(1,000) %	20.12.2023	€ 200	\$ (6)	0,00

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽²⁾

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
American International Group, Inc.	1,000 %	20.12.2026	\$ 900	\$ (12)	0,00
American International Group, Inc.	1,000	20.12.2027	1.000	8	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.12.2023	2.100	(23)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2026	3.200	(50)	(0,01)
British Telecommunications PLC	1,000	20.12.2025	€ 100	(1)	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20.12.2027	300	(4)	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20.06.2028	1.600	(46)	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20.12.2028	400	(10)	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20.06.2027	\$ 600	(8)	0,00
General Electric Co.	1,000	20.06.2024	300	7	0,00
General Electric Co.	1,000	20.12.2024	800	20	0,00
Goldman Sachs Group, Inc.	1,000	20.12.2026	3.000	(21)	0,00
Telefonica Emisiones S.A.	1,000	20.06.2026	€ 100	(1)	0,00
Telefonica Emisiones S.A.	1,000	20.06.2028	900	(15)	0,00
Tesco PLC	1,000	20.06.2028	600	(20)	0,00
Valeo S.A.	1,000	20.06.2026	300	(10)	0,00
Valeo S.A.	1,000	20.06.2028	900	(46)	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.06.2026	\$ 700	(15)	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.12.2026	2.200	(52)	(0,01)
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.06.2027	5.000	(8)	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.12.2027	4.100	27	0,00
				\$ (280)	(0,02)

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt	variabler Zinssatz	variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt ⁽⁴⁾		1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	2,000 %	15.03.2053	£ 1.000	\$ 9	0,00
Zahlung		1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS					
			1,750	15.06.2024	\$ 40.600	(1.032)	(0,08)
Zahlung		1-Year BRL-CDI	13,026	02.01.2025	BRL 243.200	252	0,02
Zahlung		3-Month CAD-Bank Bill	1,000	16.06.2026	CAD 13.800	(783)	(0,06)
Zahlung		3-Month CAD-Bank Bill	1,220	03.03.2025	600	(34)	0,00
Zahlung		3-Month CAD-Bank Bill	1,235	04.03.2025	1.100	(63)	(0,01)
Zahlung		3-Month CAD-Bank Bill	1,275	03.03.2025	600	(33)	0,00
Zahlung		3-Month CAD-Bank Bill	1,276	03.03.2025	300	(16)	0,00
Zahlung		3-Month CAD-Bank Bill	1,290	03.03.2025	200	(11)	0,00
Zahlung		3-Month CAD-Bank Bill	1,500	17.06.2030	500	(35)	0,00
Erhalt		3-Month USD-LIBOR	1,785	12.08.2051	\$ 800	263	0,02
Erhalt		6-Month EUR-EURIBOR	0,600	15.12.2050	€ 3.100	1.703	0,12
Zahlung ⁽⁴⁾		6-Month EUR-EURIBOR	1,500	15.03.2025	10.600	(136)	(0,01)

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Investment Grade Credit ESG Fund (Forts.)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	1,500 %	15.03.2028	€ 83.600	\$ (3.791)	(0,28)
Zahlung ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	1,750	15.03.2033	9.800	(311)	(0,02)
Erhalt	CPURNSA	2,475	16.06.2031	\$ 2.600	213	0,02
					\$ (3.805)	(0,28)
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					\$ (4.091)	(0,30)

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

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

⁽³⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definieren.

⁽⁴⁾ Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

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

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

VERKAUFSOPTIONEN

OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
BOA	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.01.2053	\$ 101,891	05.01.2023	6.100	\$ (18)	\$ 0	0,00
SAL	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.01.2053	101,859	05.01.2023	7.700	(23)	0	0,00
					\$ (41)	\$ 0	0,00

⁽¹⁾ Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽²⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettovermögens
BOA	Italy Government International Bond	1,000 %	20.12.2026	\$ 2.300	\$ 11	\$ (20)	\$ (9)	0,00

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

⁽²⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definieren.

DEISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettoerhöhung/ (-abnahme)	% des Nettovermögens		
BOA	02.2023	CAD	20.181	\$ 15.201	\$ 303	\$ 303	0,02		
	02.2023	£	56.617	66.881	28	(1.327)	(0,09)		
	02.2023	SEK	8.284	800	3	3	0,00		
	02.2023	\$	2.911	¥ 400.400	141	0	141	0,01	
	02.2023	1.189	NOK	11.798	11	0	11	0,00	
	03.2023	ZAR	35.698	\$ 2.022	0	(64)	(64)	0,00	
BPS	01.2023	\$	808	€ 758	1	0	1	0,00	
BRC	02.2023	1.803	NOK	17.991	27	0	27	0,00	
CBK	01.2023	BRL	57	\$ 11	0	0	0	0,00	
	01.2023	€	640	666	0	(18)	(18)	0,00	
	01.2023	\$	979	€ 921	4	0	4	0,00	
	01.2023	92	PEN	370	5	0	5	0,00	
	02.2023	AUD	7.521	\$ 5.040	0	(70)	(70)	(0,01)	
	02.2023	£	986	1.197	13	(4)	9	0,00	
GLM	02.2023	\$	1.486	CAD	2.022	7	0	7	0,00
	02.2023	1.162	£	954	0	(13)	(13)	0,00	
	01.2023	11	BRL	57	0	0	0	0,00	
	02.2023	BRL	57	\$ 11	0	0	0	0,00	
	01.2023	€	304.156	318.843	0	(5.907)	(5.907)	(0,43)	
	01.2023	\$	1.238	€ 1.162	3	0	3	0,00	
MBC	02.2023	£	249	\$ 304	4	0	4	0,00	
	02.2023	\$	2.788	AUD	4.126	14	0	14	0,00

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
MYI	02.2023	\$ 1.829	¥ 246.600	\$ 50	\$ 0	\$ 50	0,01
	01.2023	€ 449	\$ 479	0	(1)	(1)	0,00
	01.2023	£ 8	9	0	0	0	0,00
	01.2023	SEK 7.131	683	0	(2)	(2)	0,00
	01.2023	\$ 704	£ 584	0	(1)	(1)	0,00
SCX	02.2023	SEK 5.910	\$ 572	3	0	3	0,00
	02.2023	AUD 192	129	0	(2)	(2)	0,00
	02.2023	CAD 310	229	0	0	0	0,00
	02.2023	\$ 1.898	NOK 18.775	11	0	11	0,00
	04.2023	ZAR 30.062	\$ 1.634	0	(118)	(118)	(0,01)
				\$ 628	\$ (7.527)	\$ (6.899)	(0,50)

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 31. Dezember 2022 standen fur die Anteilsklassen Institutional CHF (Hedged) thesaurierend, Institutional CHF (Hedged) ausschuttend, E CHF (Hedged) thesaurierend und E CHF (Hedged) ausschuttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
BOA	01.2023	CHF 28	\$ 30	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	01.2023	\$ 72.764	CHF 68.802	1.648	0	1.648	0,12
BRC	01.2023	CHF 9	\$ 10	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 5.761	CHF 5.353	29	0	29	0,00
CBK	01.2023	CHF 4	\$ 4	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 125.400	CHF 118.491	2.752	0	2.752	0,20
MBC	01.2023	CHF 156	\$ 169	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 67	CHF 63	0	0	0	0,00
MYI	01.2023	CHF 151	\$ 162	0	(1)	(1)	0,00
	01.2023	\$ 1.023	CHF 966	22	0	22	0,00
SCX	01.2023	CHF 425	\$ 460	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 207	CHF 192	1	0	1	0,00
				\$ 4.452	\$ (1)	\$ 4.451	0,32

Zum 31. Dezember 2022 standen fur die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschuttend, E EUR (Hedged) thesaurierend und E EUR (Hedged) ausschuttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
BOA	01.2023	€ 2.339	\$ 2.467	\$ 0	\$ (30)	\$ (30)	0,00
BPS	01.2023	\$ 259	€ 243	0	0	0	0,00
CBK	01.2023	€ 446	\$ 475	0	(2)	(2)	0,00
	01.2023	\$ 168.665	€ 162.670	5.019	0	5.019	0,37
MBC	01.2023	€ 2.109	\$ 2.249	0	(3)	(3)	0,00
	01.2023	\$ 217.749	€ 207.752	4.069	0	4.069	0,30
SCX	01.2023	188.592	181.190	4.866	0	4.866	0,35
				\$ 13.954	\$ (35)	\$ 13.919	1,02

Zum 31. Dezember 2022 standen fur die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend, Institutional GBP (Hedged) ausschuttend und E GBP (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
BOA	01.2023	£ 832	\$ 1.023	\$ 22	\$ 0	\$ 22	0,00
	01.2023	\$ 60.121	£ 49.947	0	(31)	(31)	0,00
BPS	01.2023	£ 57	\$ 69	0	0	0	0,00
BRC	01.2023	569	685	1	0	1	0,00
	01.2023	\$ 3	£ 2	0	0	0	0,00
JPM	01.2023	66.073	54.717	0	(244)	(244)	(0,02)
MBC	01.2023	£ 32	\$ 39	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 72.114	£ 60.110	288	(84)	204	0,02
MYI	01.2023	£ 2.359	\$ 2.900	61	0	61	0,00
	01.2023	\$ 19	£ 16	0	0	0	0,00
UAG	01.2023	£ 246	\$ 304	9	0	9	0,00
	01.2023	\$ 59	£ 48	0	(1)	(1)	0,00
				\$ 381	\$ (360)	\$ 21	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Investment Grade Credit ESG Fund (Forts.)

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional SEK (Hedged) thesaurierend und Administrative SEK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2023	\$ 5.408	SEK 55.657	\$ 0	\$ (64)	\$ (64)	(0,01)
BRC	01.2023	84.300	882.904	467	0	467	0,03
CBK	01.2023	17.065	177.382	5	(40)	(35)	0,00
MBC	01.2023	SEK 7.225	\$ 694	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 3.098	SEK 32.039	8	(30)	(22)	0,00
MYI	01.2023	24.902	261.784	237	(6)	231	0,02
SCX	01.2023	1.439	14.837	0	(14)	(14)	0,00
UAG	01.2023	159.109	1.668.944	1.141	(16)	1.125	0,08
				\$ 1.858	\$ (170)	\$ 1.688	0,12
Summe Freiverkehrsfinaanzderivate						\$ 13.171	0,96

LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN			
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,000 % fällig am 01.02.2053	\$ 6.700	\$ (5.887)	(0,43)
Summe Leerverkaufte Wertpapiere		\$ (5.887)	(0,43)
Summe Anlagen		\$ 1.514.448	110,55
Sonstige Aktiva und Passiva		\$ (144.558)	(10,55)
Nettovermögen		\$ 1.369.890	100,00

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

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

- (a) Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.
- (b) Wertpapier per Emissionstermin.
- (c) Nullkuponwertpapier.
- (d) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.
- (e) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.
- (f) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.
- (g) Bedingt wandelbares Wertpapier.
- (h) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2021: 1,42 %):

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeitsdatum	Kaufdatum	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
AT&T, Inc.	4,850 %	25.05.2047	23.09.2021	\$ 1.326	\$ 963	0,07
Citigroup, Inc.	2,572	03.06.2031	29.12.2021	8.764	7.056	0,51
Citigroup, Inc.	4,615	25.01.2026	18.01.2022	2.000	1.956	0,14
Deutsche Bank AG	1,447	01.04.2025	23.09.2021	2.005	1.858	0,13
Oracle Corp.	3,950	25.03.2051	22.03.2021	299	215	0,02
				\$ 14.394	\$ 12.048	0,87

(i) Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von 74.895 USD (31. Dezember 2021: 0 USD) wurden gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen zum 31. Dezember 2022 als Sicherheiten verpfändet.

(j) Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von 22.792 USD (31. Dezember 2021: 0 USD) wurden gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte zum 31. Dezember 2022 als Sicherheiten für verzögert gelieferte Wertpapiere oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte verpfändet oder geliefert.

Barmittel in Höhe von 28.652 USD (31. Dezember 2021: 9.154 USD) wurden zum 31. Dezember 2022 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 1.380 USD (31. Dezember 2021: 0 USD) wurden gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. zum 31. Dezember 2022 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 1.489.771	\$ 0	\$ 1.489.771
Pensionsgeschäfte	0	15.240	0	15.240
Finanzderivate ⁽³⁾	3.729	11.595	0	15.324
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(5.887)	0	(5.887)
Summen	\$ 3.729	\$ 1.510.719	\$ 0	\$ 1.514.448

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

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 1.166.597	\$ 0	\$ 1.166.597
Pensionsgeschäfte	0	962	0	962
Finanzderivate ⁽³⁾	987	7.174	0	8.161
Summen	\$ 987	\$ 1.174.733	\$ 0	\$ 1.175.720

⁽¹⁾ Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

⁽²⁾ Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

⁽³⁾ Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions- geschäften	% des Nettovermögens
BOS	4,300 %	01.12.2022	05.01.2023	\$ (11.285)	\$ (11.327)	(0,83)
	4,340	08.12.2022	05.01.2023	(46.868)	(47.003)	(3,43)
	4,430	12.12.2022	05.01.2023	(16.759)	(16.800)	(1,22)
BRC	1,000	26.05.2022	TBD ⁽¹⁾	£ (669)	(798)	(0,06)
Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte					\$ (75.928)	(5,54)

⁽¹⁾ Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

Ausstehende Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zum 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Zahlbar für Rückkauf- Finanzierungs- geschäfte ⁽¹⁾	% des Nettovermögens
BPG	(1,500) %	30.12.2022	03.01.2023	\$ (22.342)	\$ (22.339)	(1,63)
	(1,350)	29.12.2022	30.12.2022	(15.191)	(15.190)	(1,11)
	(1,070)	27.12.2022	28.12.2022	(15.104)	(15.104)	(1,10)
	(1,000)	28.12.2022	29.12.2022	(22.609)	(22.609)	(1,65)
MSC	4,400	09.12.2022	05.01.2023	(682)	(684)	(0,05)
Summe Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte					\$ (75.926)	(5,54)

⁽¹⁾ In dem für Rückkaufgeschäfte zahlbaren Betrag sind 1 USD für einen aufgeschobenen Kursrückgang enthalten.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung des Marktwerts der außerbörslich gehandelten Finanzderivate und (erhaltenen)/verpfändeten Sicherheiten nach Kontrahenten zum 31. Dezember 2022 und 31. Dezember 2021:

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2022			Zum 31. Dez. 2021		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾
BOA	\$ 631	\$ (740)	\$ (109)	\$ 214	\$ (270)	\$ (56)
BPS	1	0	1	3.069	(2.590)	479
BRC	524	(240)	284	1.340	(930)	410
CBK	7.658	(7.770)	(112)	308	(330)	(22)
GLM	k. A.	k. A.	k. A.	323	0	323
HUS	k. A.	k. A.	k. A.	244	0	244
JPM	(244)	0	(244)	91	0	91
MBC	(1.588)	1.380	(208)	k. A.	k. A.	k. A.
MYI	312	(100)	212	295	0	295
SCX	4.744	(4.520)	224	1.264	(1.500)	(236)
UAG	1.133	(520)	613	1.234	(650)	584

⁽¹⁾ Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2022:

	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	81,73	78,12
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	26,66	19,89
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,36	0,06
Pensionsgeschäfte	1,11	0,08
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,46	(0,02)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,30)	0,00
Freiverkehrsfinanzderivate	0,96	0,71
Leerverkaufte Wertpapiere	(0,43)	k. A.
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(5,54)	k. A.
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	(5,54)	k. A.

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2022 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
Australien	0,41	0,94
Österreich	0,22	0,38
Belgien	0,65	0,55
Bermuda	k. A.	0,10
Brasilien	0,02	0,75
Kanada	1,75	0,77
Kaimaninseln	0,27	1,02
Chile	0,44	0,50
China	k. A.	0,26
Kolumbien	0,09	0,11
Kroatien	k. A.	0,03
Zypern	0,08	k. A.
Dänemark	0,79	0,25
Finnland	0,63	1,19
Frankreich	5,16	6,42
Deutschland	2,94	2,04
Guernsey, Kanalinseln	0,32	0,47
Hongkong	0,01	0,29
Indien	0,96	0,50
Indonesien	k. A.	0,51
Irland	1,40	0,51
Insel Man	k. A.	0,06
Italien	1,33	2,72
Japan	3,85	2,61
Jersey, Kanalinseln	0,09	0,15
Luxemburg	1,23	1,52
Mauritius	0,18	0,85
Mexiko	0,32	0,76
Multinational	0,63	0,34
Niederlande	7,21	6,62
Norwegen	0,16	k. A.
Panama	k. A.	0,03
Peru	0,11	0,19
Rumänien	0,29	0,38
Serbien	0,13	0,18
Singapur	0,35	0,20
Südafrika	0,02	k. A.
Südkorea	1,02	1,38
Spanien	1,34	3,09
Supranational	2,90	0,95
Schweden	0,70	0,65
Schweiz	0,63	1,11
Thailand	k. A.	0,06
Großbritannien	8,14	9,79
USA	55,93	44,41
Uruguay	k. A.	0,08
Jungferninseln (Britisch)	0,24	0,30
Kurzfristige Instrumente	5,81	2,05
Pensionsgeschäfte	1,11	0,08
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,46	(0,02)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzkauf	0,00	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf	(0,02)	0,00
Zinsswaps	(0,28)	0,00
Freiverkehrsfinanzderivate		
Verkaufsoptionen		
Optionen auf Wertpapiere	0,00	k. A.
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf	0,00	0,00
Devisenterminkontrakte	(0,50)	(0,26)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	1,46	0,97
Leerverkaufte Wertpapiere	(0,43)	k. A.
Sonstige Aktiva und Passiva	(10,55)	1,16
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTO-VERMÖGENS	% DES
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE				
AUSTRALIEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Sydney Airport Finance Co. Pty. Ltd. 3,900 % fällig am 22.03.2023	\$ 1.100	\$ 1.097	0,08	
STAATSEMISSIONEN				
Australia Government International Bond 0,750 % fällig am 21.11.2027 AUD	19.838	8.357	0,61	
3,000 % fällig am 20.09.2025	8.044	4.359	0,32	
		12.716	0,93	
Summe Australien		13.813	1,01	
KANADA				
STAATSEMISSIONEN				
Canadian Government Real Return Bond 4,250 % fällig am 01.12.2026 (a) CAD	2.626	2.139	0,16	
KAIMANINSELN				
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				
Atlas Senior Loan Fund Ltd. 5,229 % fällig am 16.01.2030	\$ 2.190	2.167	0,16	
Carlyle Global Market Strategies CLO Ltd. 5,179 % fällig am 15.10.2030	1.342	1.329	0,09	
Sound Point CLO Ltd. 5,029 % fällig am 15.04.2029	4.120	4.072	0,30	
Summe Kaimaninseln		7.568	0,55	
DÄNEMARK				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Jyske Realkredit A/S 0,500 % fällig am 01.10.2053 DKK	19.878	1.924	0,14	
1,000 % fällig am 01.10.2050	19	2	0,00	
1,000 % fällig am 01.10.2053	2.763	272	0,02	
1,500 % fällig am 01.10.2050	493	53	0,00	
1,500 % fällig am 01.10.2053	15.181	1.587	0,12	
2,500 % fällig am 01.10.2047	4	1	0,00	
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab 0,500 % fällig am 01.10.2043	10.862	1.192	0,09	
1,000 % fällig am 01.10.2050	29	3	0,00	
2,500 % fällig am 01.10.2047	13	2	0,00	
Nykredit Realkredit A/S 0,500 % fällig am 01.10.2053	3.061	296	0,02	
1,000 % fällig am 01.10.2050	0	0	0,00	
1,000 % fällig am 01.10.2053	0	0	0,00	
1,500 % fällig am 01.10.2050	0	0	0,00	
1,500 % fällig am 01.10.2053	155.516	16.864	1,24	
2,000 % fällig am 01.10.2053	8.647	987	0,07	
2,500 % fällig am 01.10.2047	2	0	0,00	
3,000 % fällig am 01.10.2053	50.615	6.456	0,47	
3,500 % fällig am 01.10.2053	4.979	657	0,05	
5,000 % fällig am 01.10.2053	7.200	1.008	0,07	
Realkredit Danmark A/S 1,000 % fällig am 01.10.2050	29.687	3.143	0,23	
1,000 % fällig am 01.10.2053	6.407	671	0,05	
1,500 % fällig am 01.10.2050	16.276	1.759	0,13	
1,500 % fällig am 01.10.2053	0	0	0,00	
2,500 % fällig am 01.04.2047	9	1	0,00	
3,000 % fällig am 01.10.2053	27.189	3.472	0,26	
		40.350	2,96	
STAATSEMISSIONEN				
Denmark Government International Bond 0,100 % fällig am 15.11.2023 (a)	13.332	1.922	0,14	
Summe Dänemark		42.272	3,10	
FRANKREICH				
STAATSEMISSIONEN				
France Government International Bond 0,100 % fällig am 01.03.2025 (a)	€ 9.854	10.608	0,78	
0,100 % fällig am 01.03.2026 (a)	3.905	4.125	0,30	
0,100 % fällig am 01.03.2028 (a)	13.908	14.860	1,09	
0,100 % fällig am 01.03.2029 (a)	580	601	0,04	
0,100 % fällig am 25.07.2031 (a)	7.936	8.111	0,59	
0,100 % fällig am 25.07.2036 (a)	237	227	0,02	

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTO-VERMÖGENS	% DES
0,100 % fällig am 25.07.2038 (a)	€ 3.275	\$ 3.133	0,23	
0,250 % fällig am 25.07.2024 (a)	15.056	16.186	1,19	
2,100 % fällig am 25.07.2023 (a)	11.308	12.363	0,91	
Summe Frankreich		70.214	5,15	
DEUTSCHLAND				
STAATSEMISSIONEN				
Bundesrepublik Deutschland 0,100 % fällig am 15.04.2023 (a)	16.844	17.832	1,31	
0,100 % fällig am 15.04.2026 (a)	18.216	19.280	1,41	
0,500 % fällig am 15.04.2030 (a)	24.119	26.083	1,91	
Summe Deutschland		63.195	4,63	
IRLAND				
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				
Adagio CLO DAC 4,541 % fällig am 20.07.2036	5.100	5.447	0,40	
Ares European CLO DAC 1,988 % fällig am 15.04.2030	5.634	5.850	0,43	
2,158 % fällig am 15.10.2031	4.200	4.345	0,32	
Bain Capital Euro CLO DAC 2,236 % fällig am 20.04.2032	400	417	0,03	
Cairn CLO DAC 2,158 % fällig am 15.10.2031	1.700	1.776	0,13	
2,688 % fällig am 20.10.2028	582	609	0,04	
Carlyle Euro CLO DAC 2,078 % fällig am 15.01.2031	800	833	0,06	
Harvest CLO DAC 2,228 % fällig am 15.01.2032	1.600	1.655	0,12	
2,433 % fällig am 18.11.2029	649	683	0,05	
Jubilee CLO DAC 2,846 % fällig am 15.12.2029	442	463	0,03	
Palmer Square European Loan Funding DAC 2,428 % fällig am 15.10.2031	5.728	5.971	0,44	
Palmerston Park CLO DAC 2,053 % fällig am 18.04.2030	1.274	1.337	0,10	
St. Paul's CLO DAC 2,373 % fällig am 25.04.2030	4.988	5.184	0,38	
		34.570	2,53	
NON-AGENCY-MBS				
European Loan Conduit DAC 2,803 % fällig am 17.02.2030	1.271	1.297	0,10	
Glenbeigh Issuer DAC 2,875 % fällig am 24.06.2050	6.042	6.265	0,46	
Primrose Residential DAC 2,644 % fällig am 24.03.2061	3.534	3.684	0,27	
Shamrock Residential DAC 2,744 % fällig am 24.12.2059	2.117	2.224	0,16	
3,144 % fällig am 24.02.2071	3.174	3.309	0,24	
		16.779	1,23	
Summe Irland		51.349	3,76	
ITALIEN				
STAATSEMISSIONEN				
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,400 % fällig am 15.05.2030 (a)	3.499	3.269	0,24	
0,650 % fällig am 15.05.2026 (a)	3.678	3.800	0,28	
1,400 % fällig am 26.05.2025 (a)	31.012	32.675	2,39	
2,350 % fällig am 15.09.2024 (a)	33.495	36.840	2,70	
2,600 % fällig am 15.09.2023 (a)	11.006	11.985	0,88	
Summe Italien		88.569	6,49	
JAPAN				
STAATSEMISSIONEN				
Japan Government International Bond 0,005 % fällig am 10.03.2031 (a)	¥ 187.873	1.476	0,11	
0,100 % fällig am 10.09.2024 (a)	579.150	4.499	0,33	
0,100 % fällig am 10.03.2025 (a)	1.364.115	10.597	0,78	
0,100 % fällig am 10.03.2026 (a)	2.836.487	22.260	1,63	
0,100 % fällig am 10.03.2028 (a)	1.572.344	12.328	0,90	
0,100 % fällig am 10.03.2029 (a)	2.223.869	17.495	1,28	
Summe Japan		68.655	5,03	

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTO-VERMÖGENS	% DES
LUXEMBURG				
KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG				
Delos Finance SARL 6,480 % fällig am 06.10.2023	\$ 70	\$ 70	0,01	
NON-AGENCY-MBS				
Miravet SARL 2,758 % fällig am 26.05.2065	€ 2.157	2.225	0,16	
Summe Luxemburg		2.295	0,17	
NIEDERLANDE				
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				
Grosvenor Place CLO BV 2,325 % fällig am 30.10.2029	1.797	1.897	0,14	
NON-AGENCY-MBS				
Eurosaif BV 2,878 % fällig am 17.10.2040	669	711	0,05	
Summe Niederlande		2.608	0,19	
NEUSEELAND				
STAATSEMISSIONEN				
New Zealand Government International Bond 2,000 % fällig am 20.09.2025 NZD	15.401	6.227	0,46	
3,000 % fällig am 20.09.2030	1.930	816	0,06	
Summe Neuseeland		7.043	0,52	
PERU				
STAATSEMISSIONEN				
Peru Government International Bond 5,940 % fällig am 12.02.2029	PEN 4.900	1.180	0,09	
SLOWENIEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Nova Ljubljanska Banka d.d. 3,400 % fällig am 05.02.2030	€ 600	531	0,04	
SPANIEN				
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				
BBVA Consumer Auto 0,270 % fällig am 20.07.2031	431	450	0,03	
STAATSEMISSIONEN				
Spain Government International Bond 0,700 % fällig am 30.11.2033 (a)	4.378	4.370	0,32	
Summe Spanien		4.820	0,35	
SCHWEDEN				
STAATSEMISSIONEN				
Sweden Government International Bond 0,125 % fällig am 01.06.2026 SEK	47.526	4.610	0,34	
0,125 % fällig am 01.12.2027	5.070	488	0,04	
1,000 % fällig am 01.06.2025	61.232	6.079	0,44	
Summe Schweden		11.177	0,82	
GROSSBRITANNIEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
NatWest Group PLC 4,519 % fällig am 25.06.2024	\$ 1.000	991	0,07	
6,274 % fällig am 25.06.2024	1.600	1.601	0,12	
		2.592	0,19	
NON-AGENCY-MBS				
Alba PLC 3,714 % fällig am 17.03.2039	£ 867	983	0,07	
Atlas Funding PLC 3,894 % fällig am 25.07.2058	2.206	2.634	0,19	
Canada Square Funding PLC 3,735 % fällig am 17.01.2059	3.999	4.625	0,34	
4,205 % fällig am 17.06.2058	2.030	2.351	0,17	
4,375 % fällig am 17.06.2058	1.691	1.995	0,15	
Canterbury Finance 3,985 % fällig am 16.05.2058	1.589	1.883	0,14	

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Low Duration Real Return Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Eurosail PLC	€ 950	\$ 994	0,07	0,625 % fällig am 22.10.2050	£ 1.900	\$ 1.022	0,08	Uniform Mortgage-Backed Security, TBA	\$ 500	\$ 423	0,03
2,155 % fällig am 13.03.2045	1.012	1.061	0,08	1,250 % fällig am 22.11.2027 (a)	29.528	37.599	2,76	2,500 % fällig am 01.01.2053	16.300	14.322	1,05
2,240 % fällig am 10.06.2044	1.277	1.331	0,10			136.615	10,01	3,000 % fällig am 01.02.2053	30.500	28.615	2,10
2,240 % fällig am 10.09.2044	1.179	1.394	0,10	Summe Großbritannien		198.657	14,56	4,000 % fällig am 01.02.2053	16.700	16.077	1,18
3,661 % fällig am 13.03.2045								4,500 % fällig am 01.02.2053			
Great Hall Mortgages PLC	27	32	0,00	USA							
3,675 % fällig am 18.03.2039	726	861	0,06	FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE							
3,695 % fällig am 18.06.2038				Aegis Asset-Backed Securities Trust Mortgage Pass-Through Certificates				US-SCHATZOBBLIGATIONEN			
London Wall Mortgage Capital PLC	1.074	1.249	0,09	5,289 % fällig am 25.10.2034	\$ 518	513	0,04	U.S. Treasury Inflation Protected Securities (a)	18.824	18.219	1,34
4,040 % fällig am 15.05.2052				Asset-Backed Securities Corp. Home Equity Loan Trust				0,125 % fällig am 15.07.2024	80.600	77.632	5,69
Mortimer BTL PLC	1.710	2.050	0,15	3,353 % fällig am 25.03.2036	60	59	0,00	0,125 % fällig am 15.10.2024 (c)	53.723	51.209	3,75
4,507 % fällig am 21.06.2052				Fremont Home Loan Trust				0,125 % fällig am 15.04.2025	70.167	66.700	4,89
Polaris PLC	2.871	3.377	0,25	5,124 % fällig am 25.07.2035	7	7	0,00	0,125 % fällig am 15.04.2026	55.936	52.603	3,86
4,232 % fällig am 23.10.2059	749	898	0,07	Renaissance Home Equity Loan Trust				0,125 % fällig am 15.07.2026 (c)	82.287	77.564	5,68
4,682 % fällig am 27.05.2057				5,329 % fällig am 25.05.2034	2.028	1.841	0,13	0,125 % fällig am 15.10.2026 (c)	68.916	64.620	4,74
Precise Mortgage Funding PLC	307	364	0,03	Structured Asset Investment Loan Trust				0,125 % fällig am 15.04.2027 (d)	22.057	20.564	1,51
4,265 % fällig am 16.10.2056	1.627	1.942	0,14	5,339 % fällig am 25.10.2033	804	775	0,06	0,125 % fällig am 15.01.2030	2.200	1.978	0,14
4,587 % fällig am 12.12.2055				Structured Asset Securities Corp.				0,125 % fällig am 15.07.2030	7.206	6.456	0,47
RMAC PLC	1.515	1.813	0,13	5,094 % fällig am 25.02.2035	1.487	1.449	0,11	0,125 % fällig am 15.07.2031	4.758	4.208	0,31
4,206 % fällig am 12.06.2046						4.644	0,34	0,125 % fällig am 15.01.2032	1.612	1.414	0,10
RMAC Securities PLC	1.643	1.847	0,14	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				0,125 % fällig am 15.02.2051	343	221	0,02
3,656 % fällig am 12.06.2044				Nissan Motor Acceptance Co. LLC	100	100	0,01	0,250 % fällig am 15.01.2025	55.480	53.228	3,90
Rochester Financing PLC	3.233	3.750	0,27	3,450 % fällig am 15.03.2023				0,250 % fällig am 15.02.2050	464	313	0,02
4,126 % fällig am 18.12.2044				Sabine Pass Liquefaction LLC	200	200	0,01	0,375 % fällig am 15.07.2023	15.365	15.183	1,11
Stratton BTL Mortgage Funding PLC	4.451	5.225	0,38	5,750 % fällig am 15.05.2024				0,375 % fällig am 15.07.2025	61.318	58.903	4,32
3,656 % fällig am 20.01.2054						300	0,02	0,375 % fällig am 15.01.2027	60.690	57.252	4,20
Stratton Mortgage Funding PLC	817	979	0,07	NON-AGENCY-MBS				0,375 % fällig am 15.07.2027	41.659	39.278	2,88
4,287 % fällig am 12.03.2052				Merrill Lynch Mortgage Investors Trust	147	146	0,01	0,500 % fällig am 15.04.2024	58.340	56.739	4,16
Towd Point Mortgage Funding PLC	2.485	2.957	0,22	4,929 % fällig am 25.08.2036				0,500 % fällig am 15.01.2028 (c)	72.238	67.962	4,98
3,826 % fällig am 20.07.2045	626	750	0,06	5,029 % fällig am 25.10.2028	7	6	0,00	0,625 % fällig am 15.04.2023	30.722	30.409	2,23
4,471 % fällig am 20.02.2054				Structured Asset Mortgage Investments Trust				0,625 % fällig am 15.01.2024	44.855	43.906	3,22
Tower Bridge Funding PLC	2.987	3.524	0,26	4,819 % fällig am 19.04.2035	305	276	0,02	0,625 % fällig am 15.01.2026 (d)	61.235	58.796	4,31
4,051 % fällig am 20.11.2063	1.475	1.731	0,13	4,839 % fällig am 19.07.2035	54	47	0,00	0,750 % fällig am 15.02.2045	1.898	1.537	0,11
4,151 % fällig am 20.12.2063				WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust				0,875 % fällig am 15.02.2047	741	608	0,04
Tudor Rose Mortgages	1.860	2.206	0,16	4,969 % fällig am 25.07.2045	419	384	0,03	1,375 % fällig am 15.02.2044	1.151	1.070	0,08
4,031 % fällig am 20.06.2048				5,029 % fällig am 25.07.2045	80	74	0,01	1,625 % fällig am 15.01.2027	19.514	19.500	1,43
Twin Bridges PLC	1.593	1.912	0,14					2,125 % fällig am 15.02.2041	816	866	0,06
4,386 % fällig am 12.09.2050	2.281	2.732	0,20			933	0,07				
4,637 % fällig am 12.12.2054		59.450	4,36					Summe USA		1.025.608	75,17
								Summe Übertragbare Wertpapiere		\$ 1.661.693	121,79
STAATSEMISSIONEN											
United Kingdom Gilt				US-REGIERUNGSBEHÖRDEN							
0,125 % fällig am 22.03.2024 (a)	41.756	51.062	3,74	Ginnie Mae				AKTIEN			
0,125 % fällig am 22.03.2026 (a)	34.732	42.173	3,09	3,858 % fällig am 20.08.2068	1.126	1.095	0,08	INVESTMENTFONDS			
0,125 % fällig am 22.11.2036 (a)	1.095	1.275	0,09	4,542 % fällig am 20.08.2066	255	254	0,02	ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN			
0,125 % fällig am 22.11.2056 (a)	529	572	0,04	4,626 % fällig am 20.08.2072	5.087	5.071	0,37	PIMCO Select Funds plc - PIMCO			
0,625 % fällig am 22.11.2042 (a)	2.345	2.912	0,21	4,726 % fällig am 20.10.2072	5.013	4.936	0,36	US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (b)	1.248.093	12.424	0,91
								Summe Investmentfonds		\$ 12.424	0,91

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft ⁽¹⁾	% des Nettovermögens
FICC	1,900 %	30.12.2022	03.01.2023	\$ 1.053	U.S. Treasury Bills	\$ (1.074)	\$ 1.053	\$ 1.053	0,08
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (1.074)	\$ 1.053	\$ 1.053	0,08

⁽¹⁾ Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
3-Month Euribor March Futures	Long	03.2023	411	\$ (3.600)	(0,26)
Australia Government 10-Year Bond March Futures	Short	03.2023	16	71	0,01
Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 146,000 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond February 2023 Futures ⁽¹⁾	Short	01.2023	29	23	0,00
Euro-Bobl March Futures	Long	03.2023	163	(715)	(0,05)
Euro-BTP Italy Government Bond March Futures	Short	03.2023	226	1.951	0,14

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Euro-Bund 10-Year Bond March Futures	Short	03.2023	421	\$ 916	0,07
Euro-Buxl 30-Year Bond March Futures	Short	03.2023	79	1.864	0,14
Euro-OAT France Government 10-Year Bond March Futures	Short	03.2023	65	617	0,04
Euro-Schatz March Futures	Short	03.2023	461	670	0,05
Japan Government 10-Year Bond March Futures	Short	03.2023	29	607	0,04
Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 138,500 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond February 2023 Futures ⁽¹⁾	Short	01.2023	29	(148)	(0,01)
U.S. Treasury 2-Year Note March Futures	Long	03.2023	179	(48)	0,00
U.S. Treasury 5-Year Note March Futures	Short	03.2023	29	38	0,00
U.S. Treasury 10-Year Note March Futures	Long	03.2023	228	(137)	(0,01)
U.S. Treasury 30-Year Bond March Futures	Long	03.2023	9	(8)	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond March Futures	Short	03.2023	695	1.445	0,10
				\$ 3.546	0,26
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ 3.546	0,26

(1) Future-Style-Option.

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
General Electric Co.	1,000 %	20.12.2023	\$ 500	\$ (4)	0,00

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung ⁽³⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	2,000 %	15.03.2033	£ 3.000	\$ (435)	(0,03)
Erhalt ⁽³⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	2,000	15.03.2053	2.300	21	0,00
Zahlung	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,500	12.12.2027	10.100	(107)	(0,01)
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000	16.06.2029	¥ 3.582.000	493	0,04
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,435	20.06.2029	1.418.000	161	0,01
Erhalt ⁽³⁾	3-Month USD-LIBOR	1,840	21.11.2028	\$ 11.700	839	0,06
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,880	25.01.2052	4.300	(1.248)	(0,09)
Zahlung ⁽³⁾	3-Month USD-LIBOR	1,888	21.11.2053	2.400	(585)	(0,04)
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,190	04.11.2052	€ 2.100	932	0,07
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,195	04.11.2052	2.200	1.109	0,08
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,197	08.11.2052	4.000	1.768	0,13
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,550	10.08.2024	2.200	(95)	(0,01)
Erhalt ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	0,830	09.12.2052	7.000	208	0,02
Erhalt ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	1,500	15.03.2025	53.700	1.236	0,09
Zahlung ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	1,500	15.03.2028	16.800	(1.310)	(0,10)
Erhalt ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	1,500	15.03.2053	1.800	65	0,01
Zahlung ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	1,750	15.03.2033	28.300	(345)	(0,02)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,500	12.12.2032	10.200	(366)	(0,03)
Erhalt	CPTFEMU	1,005	15.02.2025	18.100	1.762	0,13
Zahlung	CPTFEMU	1,355	15.02.2050	1.200	(72)	(0,01)
Zahlung	CPTFEMU	1,375	15.02.2040	1.600	(159)	(0,01)
Erhalt	CPTFEMU	1,380	15.03.2031	4.800	508	0,04
Erhalt	CPTFEMU	1,500	15.07.2031	7.040	789	0,06
Zahlung	CPTFEMU	1,946	15.03.2048	800	(156)	(0,01)
Erhalt	CPTFEMU	2,359	15.08.2030	1.500	62	0,00
Zahlung	CPTFEMU	2,421	15.05.2052	330	(39)	0,00
Erhalt	CPTFEMU	2,470	15.07.2032	1.600	61	0,00
Zahlung	CPTFEMU	2,488	15.05.2037	2.290	(136)	(0,01)
Erhalt	CPTFEMU	2,550	15.04.2052	300	30	0,00
Erhalt	CPTFEMU	2,570	15.06.2032	1.200	39	0,00
Zahlung	CPTFEMU	2,580	15.03.2052	1.400	(117)	(0,01)
Zahlung	CPTFEMU	2,590	15.12.2052	1.700	(19)	0,00
Erhalt	CPTFEMU	2,600	15.05.2032	3.000	108	0,01
Erhalt	CPTFEMU	2,720	15.06.2032	1.800	42	0,00
Erhalt	CPTFEMU	2,975	15.08.2027	19.700	186	0,01
Erhalt	CPTFEMU	3,000	15.05.2027	5.400	126	0,01
Erhalt	CPTFEMU	3,130	15.05.2027	100	3	0,00
Zahlung	CPTFEMU	3,520	15.09.2024	5.200	(77)	(0,01)
Zahlung	CPTFEMU	3,720	15.09.2024	3.300	(36)	0,00
Zahlung	CPTFEMU	3,850	15.09.2024	7.700	(80)	(0,01)
Erhalt	CPURNSA	1,794	24.08.2027	\$ 6.700	160	0,01
Erhalt	CPURNSA	1,798	25.08.2027	3.400	81	0,01
Zahlung	CPURNSA	1,883	20.11.2029	7.400	(179)	(0,01)
Erhalt	CPURNSA	1,890	27.08.2027	6.500	159	0,01
Zahlung	CPURNSA	1,954	03.06.2029	4.700	(119)	(0,01)
Zahlung	CPURNSA	1,998	25.07.2029	4.300	(112)	(0,01)
Erhalt	CPURNSA	2,210	05.02.2023	17.550	700	0,05
Erhalt	CPURNSA	2,220	13.04.2023	7.440	270	0,02

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Low Duration Real Return Fund (Forts.)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	CPURNSA	2,263 %	27.04.2023	\$ 60	\$ 2	0,00
Erhalt	CPURNSA	2,263	09.05.2023	5.230	184	0,01
Erhalt	CPURNSA	2,281	10.05.2023	6.064	224	0,02
Erhalt	CPURNSA	2,311	24.02.2031	6.600	186	0,01
Zahlung	CPURNSA	2,335	05.02.2028	6.110	(188)	(0,01)
Zahlung	CPURNSA	2,353	09.05.2028	960	(30)	0,00
Zahlung	CPURNSA	2,364	10.05.2028	7.960	(246)	(0,02)
Zahlung	CPURNSA	2,379	09.07.2028	1.900	(59)	0,00
Erhalt	CPURNSA	2,419	05.03.2026	400	11	0,00
Erhalt	CPURNSA	2,690	01.06.2026	1.300	36	0,00
Erhalt	CPURNSA	2,703	25.05.2026	2.450	68	0,01
Erhalt	CPURNSA	2,768	13.05.2026	3.500	98	0,01
Erhalt	CPURNSA	2,813	14.05.2026	1.600	45	0,00
Zahlung	CPURNSA	5,000	03.03.2023	16.000	(231)	(0,02)
Zahlung	FRCPXTOB	1,280	15.11.2034	€ 1.700	(227)	(0,02)
Zahlung	FRCPXTOB	1,410	15.11.2039	2.000	(327)	(0,02)
Zahlung	UKRPI	3,330	15.01.2025	£ 400	(45)	0,00
Zahlung	UKRPI	3,346	15.05.2030	550	(27)	0,00
Zahlung	UKRPI	3,530	15.10.2031	7.260	(488)	(0,04)
Zahlung	UKRPI	3,566	15.03.2036	1.400	2	0,00
Zahlung	UKRPI	3,850	15.09.2024	2.500	(315)	(0,02)
Erhalt	UKRPI	4,125	15.09.2032	480	6	0,00
Erhalt	UKRPI	4,130	15.09.2032	2.120	25	0,00
Zahlung	UKRPI	4,288	15.02.2032	2.200	(28)	0,00
Erhalt	UKRPI	4,480	15.09.2023	1.300	168	0,01
Erhalt	UKRPI	5,330	15.06.2024	8.800	260	0,02
Erhalt	UKRPI	6,440	15.05.2024	1.500	86	0,01
Erhalt	UKRPI	6,600	15.05.2024	2.200	119	0,01
					\$ 5.435	0,40
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					\$ 5.431	0,40

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definieren.

(3) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

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

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

OPTIONSKAUF

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
BPS	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,000 %	15.03.2023	1.400	\$ 157	\$ 759	0,06
BRC	Call – OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,410	02.02.2023	59.900	299	0	0,00
CBK	Call – OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,720	23.02.2023	11.300	62	0	0,00
DUB	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,237	17.11.2023	8.700	540	1.934	0,14
GLM	Call – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,200	26.04.2023	10.000	107	6	0,00
JPM	Call – OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,710	25.01.2023	12.100	74	0	0,00
	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,000	15.03.2023	1.800	198	975	0,07
MYC	Call – OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,428	31.01.2023	59.500	304	0	0,00
	Call – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,200	31.05.2023	28.400	341	34	0,00
							\$ 2.082	\$ 3.708	0,27

VERKAUFSOPTIONEN

INFLATION-CAPPED OPTIONS

Kontrahent	Beschreibung	Anfänglicher Index	Variabler Zinssatz	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
GLM	Cap - OTC CPALEMU	USD 100,152	Maximal [(Index Final/Index Initial – 1) – 3,000 %] oder 0	22.06.2035	1.500	\$ (69)	\$ (76)	(0,01)
JPM	Cap – OTC CPURNSA	USD 233,916	Maximal [(Index Final/Index Initial – 1) – 4,000 %] oder 0	22.04.2024	1.000	(7)	0	0,00
	Cap – OTC CPURNSA	USD 234,781	Maximal [(Index Final/Index Initial – 1) – 4,000 %] oder 0	16.05.2024	100	(1)	0	0,00
						\$ (77)	\$ (76)	(0,01)

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
BPS	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,175 %	15.03.2023	4.200	\$ (154)	\$ (1.291)	(0,09)
BRC	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,558	02.02.2023	13.100	(300)	0	0,00
CBK	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,736	23.02.2023	2.700	(67)	0	0,00
	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Erhalt	4,290	17.01.2023	6.400	(269)	(354)	(0,03)
DUB	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Zahlung	4,290	17.01.2023	6.400	(269)	(15)	0,00
GLM	Put – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,340	17.11.2023	43.000	(542)	(2.787)	(0,20)
	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,350	26.04.2023	5.500	(109)	(9)	0,00
	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,547	07.03.2023	4.200	(92)	(9)	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,547	07.03.2023	4.200	(92)	(265)	(0,02)
	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,067	09.06.2023	11.100	(121)	(28)	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	3,140	09.06.2023	11.100	(156)	(363)	(0,03)
GST	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,950	05.01.2023	13.200	(342)	(4)	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,950	05.01.2023	13.200	(342)	(299)	(0,02)
	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	3,230	18.01.2023	7.600	(204)	(86)	(0,01)
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	3,230	18.01.2023	7.600	(204)	(65)	(0,01)
	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Erhalt	4,670	10.01.2023	6.600	(262)	(596)	(0,04)
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Zahlung	4,670	10.01.2023	6.600	(262)	(1)	0,00
JPM	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,785	25.01.2023	2.800	(78)	0	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,175	15.03.2023	5.400	(194)	(1.660)	(0,12)
MYC	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,579	31.01.2023	13.000	(304)	0	0,00
	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,350	31.05.2023	15.600	(340)	(46)	0,00
							\$ (4.703)	\$ (7.878)	(0,57)

(1) Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Kontrahent	Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag ⁽²⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
GST	CMBX.NA.AAA.8 Index	0,500 %	17.10.2057	\$ 600	\$ (40)	\$ 41	\$ 1	0,00
SAL	CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17.08.2061	1.400	(3)	(8)	(11)	0,00
UAG	CMBX.NA.AAA.9 Index	0,500	17.09.2058	894	(79)	78	(1)	0,00
					\$ (122)	\$ 111	\$ (11)	0,00

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definieren.

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2023	AUD 8.374	\$ 5.672	\$ 0	\$ (9)	(9)	0,00
	01.2023	£ 4.341	\$ 5.338	115	0	115	0,01
	01.2023	¥ 131.600	998	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 1.049	£ 860	0	(15)	(15)	0,00
BPS	01.2023	1.793	€ 1.682	3	0	3	0,00
	03.2023	205	PEN 796	3	0	3	0,00
BRC	01.2023	£ 8.612	\$ 10.575	214	0	214	0,02
	01.2023	SEK 102.229	9.761	0	(54)	(54)	0,00
CBK	01.2023	\$ 1.458	€ 1.371	6	0	6	0,00
	01.2023	CHF 514	\$ 544	0	(12)	(12)	0,00
	01.2023	€ 971	1.035	0	(2)	(2)	0,00
	01.2023	¥ 136.300	989	0	(45)	(45)	0,00
	01.2023	SEK 1.900	182	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 774	DKK 5.390	0	0	0	0,00
	01.2023	1.078	PEN 4.265	38	0	38	0,00
	02.2023	PEN 21.397	\$ 5.331	0	(260)	(260)	(0,02)
DUB	01.2023	DKK 158.014	22.271	0	(417)	(417)	(0,03)
GLM	05.2023	\$ 806	PEN 3.206	26	0	26	0,00
JPM	01.2023	£ 121.578	\$ 146.808	539	0	539	0,04
MBC	01.2023	AUD 311	209	0	(2)	(2)	0,00
	01.2023	CAD 3.093	2.306	23	0	23	0,00
	01.2023	DKK 142.891	20.185	0	(332)	(332)	(0,03)
	01.2023	€ 250.359	262.444	0	(4.866)	(4.866)	(0,36)
MYI	01.2023	¥ 1.400.580	10.172	0	(450)	(450)	(0,03)
	01.2023	AUD 9.868	6.627	0	(67)	(67)	(0,01)
	01.2023	€ 132	141	0	0	0	0,00
	01.2023	£ 156	188	0	0	0	0,00
	01.2023	¥ 6.684.532	48.758	0	(1.938)	(1.938)	(0,14)
	01.2023	\$ 397	€ 373	2	0	2	0,00
	01.2023	446	£ 370	0	(1)	(1)	0,00
	01.2023	AUD 114	\$ 76	0	(1)	(1)	0,00
RBC	01.2023	£ 27.355	33.229	318	0	318	0,02

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Low Duration Real Return Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
SCX	01.2023	AUD 662	\$ 446	\$ 0	\$ (3)	\$ (3)	0,00
	01.2023	¥ 860.800	6.354	0	(175)	(175)	(0,01)
	01.2023	NZD 11.177	6.962	0	(108)	(108)	(0,01)
	01.2023	\$ 72	PEN 278	1	0	1	0,00
	03.2023	118	455	0	0	0	0,00
UAG	01.2023	SEK 6.522	\$ 623	0	(3)	(3)	0,00
	01.2023	\$ 850	£ 700	0	(7)	(7)	0,00
				\$ 1.288	\$ (8.767)	\$ (7.479)	(0,55)

ABGESICHERTE DEVISENTERMIKONTRAKTE

Zum 31. Dezember 2022 standen fur die Anteilsklasse Institutional CHF (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
BOA	01.2023	\$ 11.256	CHF 10.648	\$ 260	\$ 0	\$ 260	0,02
BRC	01.2023	7	7	0	0	0	0,00
CBK	01.2023	19.615	18.529	426	0	426	0,03
JPM	01.2023	CHF 1.428	\$ 1.546	2	0	2	0,00
MBC	01.2023	\$ 11	CHF 10	0	0	0	0,00
MYI	01.2023	CHF 50	\$ 54	0	0	0	0,00
SCX	01.2023	\$ 254	CHF 240	5	0	5	0,00
	01.2023	CHF 5.067	\$ 5.487	7	0	7	0,00
	01.2023	\$ 2	CHF 2	0	0	0	0,00
				\$ 700	\$ 0	\$ 700	0,05

Zum 31. Dezember 2022 standen fur die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschuttend und E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
AZD	01.2023	\$ 34.688	€ 32.825	\$ 360	\$ 0	\$ 360	0,03
BOA	01.2023	34.740	32.939	430	0	430	0,03
BPS	01.2023	€ 1.558	\$ 1.662	0	(1)	(1)	0,00
CBK	01.2023	13.620	14.519	0	(23)	(23)	0,00
MBC	01.2023	\$ 216.030	€ 208.225	6.292	0	6.292	0,46
	01.2023	€ 6.819	\$ 7.263	0	(18)	(18)	0,00
SCX	01.2023	\$ 274.079	€ 261.333	4.948	0	4.948	0,36
	01.2023	208.642	200.453	5.383	0	5.383	0,39
				\$ 17.413	\$ (42)	\$ 17.371	1,27

Zum 31. Dezember 2022 standen fur die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend und Institutional GBP (Hedged) ausschuttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
BOA	01.2023	£ 660	\$ 811	\$ 18	\$ 0	\$ 18	0,00
	01.2023	\$ 2.609	£ 2.141	0	(33)	(33)	0,00
BPS	01.2023	1.096	908	0	(3)	(3)	0,00
BRC	01.2023	£ 334	\$ 403	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 131	£ 109	0	0	0	0,00
JPM	01.2023	46.166	38.232	0	(170)	(170)	(0,01)
MBC	01.2023	£ 1.303	\$ 1.592	24	0	24	0,00
	01.2023	\$ 46.630	£ 38.915	201	(13)	188	0,01
MYI	01.2023	2.446	1.994	0	(47)	(47)	0,00
TOR	01.2023	46.001	38.261	31	0	31	0,00
UAG	01.2023	1.142	925	0	(29)	(29)	0,00
				\$ 274	\$ (295)	\$ (21)	0,00

Zum 31. Dezember 2022 standen fur die Anteilsklasse Institutional SGD (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
AZD	01.2023	\$ 32.941	SGD 45.206	\$ 769	\$ 0	\$ 769	0,05
BOA	01.2023	81.079	111.273	1.899	0	1.899	0,14
GLM	01.2023	110.794	151.659	2.301	0	2.301	0,17
RYL	01.2023	32.937	45.206	773	0	773	0,06
				\$ 5.742	\$ 0	\$ 5.742	0,42

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ 12.056 0,88

Summe Anlagen

\$ 1.696.203 124,32

Sonstige Aktiva und Passiva

\$ (331.828) (24,32)

Nettovermogen

\$ 1.364.375 100,00

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

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

- (a) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.
 (b) Mit dem Fonds verbunden.
 (c) Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von 183.180 USD (31. Dezember 2021: 0 USD) wurden gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen zum 31. Dezember 2022 als Sicherheiten verpfändet.
 (d) Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von 79.359 USD (31. Dezember 2021: 251.028 USD) wurden gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte zum 31. Dezember 2022 als Sicherheiten für verzögert gelieferte Wertpapiere oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte verpfändet oder geliefert.

Barmittel in Höhe von 286 USD (31. Dezember 2021: 390 USD) wurden gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte zum 31. Dezember 2022 als Sicherheiten erhalten.

Barmittel in Höhe von 13.037 USD (31. Dezember 2021: 11.071 USD) wurden zum 31. Dezember 2022 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 5.380 USD (31. Dezember 2021: 1.380 USD) wurden gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. zum 31. Dezember 2022 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 1.661.693	\$ 0	\$ 1.661.693
Investmentfonds	12.424	0	0	12.424
Pensionsgeschäfte	0	1.053	0	1.053
Finanzderivate ⁽³⁾	2.256	18.777	0	21.033
Summen	\$ 14.680	\$ 1.681.523	\$ 0	\$ 1.696.203

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

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 1.420.625	\$ 0	\$ 1.420.625
Investmentfonds	12.363	0	0	12.363
Pensionsgeschäfte	0	1.138	0	1.138
Finanzderivate ⁽³⁾	3.585	4.864	0	8.449
Summen	\$ 15.948	\$ 1.426.627	\$ 0	\$ 1.442.575

⁽¹⁾ Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

⁽²⁾ Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

⁽³⁾ Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions- geschäften	% des Nettovermögens
CIB	4,140 %	13.12.2022	04.01.2023	\$ (6.901)	\$ (6.916)	(0,51)
		4,370	08.12.2022	05.01.2023	(88.626)	(6,51)
		4,400	04.01.2023	19.01.2023	(6.868)	(0,50)
		4,400	05.01.2023	19.01.2023	(87.964)	(6,45)
DEU	4,450	14.12.2022	11.01.2023	(70.923)	(71.081)	(5,21)
Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte					\$ (261.713)	(19,18)

Ausstehende Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zum 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Zahlbar für Rückkauf- Finanzierungs- geschäfte ⁽¹⁾	% des Nettovermögens
BRC	4,180 %	03.11.2022	05.01.2023	\$ (58.420)	\$ (58.827)	(4,31)
		4,250	17.11.2022	12.01.2023	(10.690)	(10.748)
TDM	4,350	05.12.2022	05.01.2023	(9.990)	(10.024)	(0,73)
Summe Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte					\$ (79.599)	(5,83)

⁽¹⁾ In dem für Rückkaufgeschäfte zahlbaren Betrag sind 37 USD für einen aufgeschobenen Kursrückgang enthalten.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung des Marktwerts der außerbörslich gehandelten Finanzderivate und (erhaltenen)/verpfändeten Sicherheiten nach Kontrahenten zum 31. Dezember 2022 und 31. Dezember 2021:

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2022			Zum 31. Dez. 2021		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement ⁽¹⁾	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement ⁽¹⁾
AZD	\$ 1.129	\$ (820)	\$ 309	\$ k. A.	\$ k. A.	\$ k. A.
BOA	2.665	(2.510)	155	573	(640)	(67)
BPS	(530)	450	(80)	1.279	(1.130)	149
BRC	166	0	166	430	(350)	80
CBK	6.045	(6.000)	45	286	(280)	6
DUB	(1.270)	1.230	(40)	(7)	0	(7)
GLM	1.583	(1.500)	83	(116)	0	(116)
GST	(1.050)	1.130	80	4	0	4
HUS	k. A.	k. A.	k. A.	124	0	124
JPM	(314)	640	326	(22)	0	(22)
MBC	(485)	340	(145)	k. A.	k. A.	k. A.
MYC	(12)	30	18	(58)	(170)	(228)
MYI	(2.046)	1.530	(516)	1.358	(1.530)	(172)
RBC	317	(280)	37	2.086	(1.670)	416
RYL	773	(450)	323	k. A.	k. A.	k. A.
SAL	(11)	10	(1)	(23)	0	(23)
SCX	5.105	(4.920)	185	(1.681)	1.380	(301)
TOR	31	(60)	(29)	3.026	(2.080)	946
UAG	(40)	20	(20)	750	(320)	430

⁽¹⁾ Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2022:

	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	114,97	106,67
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	6,69	11,25
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,13	0,56
Investmentfonds	0,91	1,03
Pensionsgeschäfte	0,08	0,09
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,26	0,19
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,40	(0,15)
Freiverkehrsfinanzderivate	0,88	0,67
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(19,18)	k. A.
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	(5,83)	(20,92)

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2022 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
Australien	1,01	0,99
Kanada	0,16	0,20
Kaimaninseln	0,55	0,19
Dänemark	3,10	9,55
Frankreich	5,15	9,96
Deutschland	4,63	k. A.
Guernsey, Kanalinseln	k. A.	0,05
Irland	3,76	1,32
Italien	6,49	9,33
Japan	5,03	5,09
Luxemburg	0,17	0,01
Niederlande	0,19	0,35
Neuseeland	0,52	0,65
Peru	0,09	0,28
Slowenien	0,04	0,06
Spanien	0,35	1,79
Schweden	0,82	1,05
Großbritannien	14,56	11,18
USA	75,17	66,43
Investmentfonds	0,91	1,03
Pensionsgeschäfte	0,08	0,09
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,26	0,19
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf	0,00	0,00
Zinsswaps	0,40	(0,15)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Zinsswapoptionen	0,27	0,19
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes	k. A.	0,00
Inflation-Capped Options	(0,01)	0,00
Zinsswapoptionen	(0,57)	(0,22)
Optionen auf Wertpapiere	k. A.	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf	0,00	0,00
Devisenterminkontrakte	(0,55)	(0,17)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	1,74	0,87
Sonstige Aktiva und Passiva	(24,32)	(20,31)
Nettovermögen	100,00	100,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Real Return Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
JAPAN				SCHWEDEN				GROSSBRITANNIEN			
STAATSEMISSIONEN				STAATSEMISSIONEN				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Japan Government International Bond				Sweden Government International Bond				NatWest Group PLC			
0,005 % fällig am 10.03.2031 (b)	¥ 949.803	\$ 7.461	0,29	0,125 % fällig am 01.06.2026	SEK 110.522	\$ 10.721	0,42	4,519 % fällig am 25.06.2024	\$ 1.400	1.387	0,05
0,100 % fällig am 10.03.2025 (b)	358.700	2.787	0,11	0,125 % fällig am 01.12.2027	16.056	1.547	0,06	6,274 % fällig am 25.06.2024	2.200	2.201	0,09
0,100 % fällig am 10.03.2026 (b)	3.492.763	27.411	1,07	0,125 % fällig am 01.06.2032	54.855	5.184	0,20			3.588	0,14
0,100 % fällig am 10.03.2028 (b)	3.324.923	26.069	1,01	1,000 % fällig am 01.06.2025	123.319	12.242	0,47				
0,100 % fällig am 10.03.2029 (b)	5.853.656	46.050	1,79								
Summe Japan		109.778	4,27	Summe Schweden		29.694	1,15				
LUXEMBURG				GROSSBRITANNIEN				USA			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE			
SES S.A.				Atlas Funding PLC				Accredited Mortgage Loan Trust			
3,600 % fällig am 04.04.2023	\$ 500	497	0,02	3,894 % fällig am 25.07.2058	4.903	5.853	0,23	4,649 % fällig am 25.09.2036	\$ 1.565	1.536	0,06
NIEDERLANDE				NON-AGENCY-MBS				ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust			
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				Alba PLC				5,439 % fällig am 25.12.2033			
Grosvenor Place CLO BV				3,714 % fällig am 17.03.2039	£ 2.063	2.340	0,09	1,266	1.215	0,05	
2,325 % fällig am 30.10.2029	€ 921	972	0,04	Atlas Funding PLC				Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through			
NON-AGENCY-MBS				Eurosaïl BV				Certificates			
Eurosaïl BV				2,878 % fällig am 17.10.2040	1.409	1.497	0,06	5,349 % fällig am 25.10.2035	1.678	1.508	0,06
STAATSEMISSIONEN				BNG Bank NV				AMRESCO Residential Securities Corp. Mortgage Loan Trust			
BNG Bank NV				0,500 % fällig am 21.12.2026	£ 7.700	7.942	0,31	5,329 % fällig am 25.06.2029	9	8	0,00
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				Niederländische Waterschapsbank NV				Asset-Backed Funding Certificates Trust			
Grosvenor Place CLO BV				0,875 % fällig am 30.09.2026	7.500	7.928	0,30	4,529 % fällig am 25.10.2036	6.809	6.173	0,24
NON-AGENCY-MBS				Summe Niederlande				4,989 % fällig am 25.10.2034			
Eurosaïl BV				18.339	0,71			515	514	0,02	
STAATSEMISSIONEN				NEUSEELAND				Asset-Backed Securities Corp. Home Equity Loan Trust			
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				STAATSEMISSIONEN				5,668 % fällig am 15.04.2033			
New Zealand Government International Bond				New Zealand Government International Bond				192	187	0,01	
2,000 % fällig am 20.09.2025	NZD 103.811	41.973	1,63	2,000 % fällig am 20.09.2025				Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust			
3,000 % fällig am 20.09.2030	81	34	0,00	3,000 % fällig am 20.09.2030				4,796 % fällig am 25.05.2035	289	287	0,01
Summe Neuseeland		42.007	1,63	Summe Neuseeland		42.007	1,63	Carrington Mortgage Loan Trust			
PERU				PERU				CIT Mortgage Loan Trust			
STAATSEMISSIONEN				STAATSEMISSIONEN				5,739 % fällig am 25.10.2037			
Peru Government International Bond				Peru Government International Bond				123	123	0,01	
5,940 % fällig am 12.02.2029	PEN 7.900	1.902	0,07	5,940 % fällig am 12.02.2029				Citigroup Mortgage Loan Trust			
SLOWENIEN				SLOWENIEN				4,679 % fällig am 25.09.2036			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				881			
Nova Ljubljanska Banka d.d.				Nova Ljubljanska Banka d.d.				481	458	0,02	
3,400 % fällig am 05.02.2030	€ 1.100	974	0,04	3,400 % fällig am 05.02.2030				Citigroup Mortgage Loan Trust Asset-Backed Pass-Through			
SPANIEN				SPANIEN				Certificates			
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				5,334 % fällig am 25.10.2034			
BBVA Consumer Auto				BBVA Consumer Auto				919	884	0,03	
0,270 % fällig am 20.07.2031	904	943	0,04	0,270 % fällig am 20.07.2031				Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.			
STAATSEMISSIONEN				STAATSEMISSIONEN				4,794 % fällig am 25.08.2036			
Spain Government International Bond				Spain Government International Bond				24	24	0,00	
0,000 % fällig am 31.01.2028 (a)	7.200	6.550	0,26	0,000 % fällig am 31.01.2028 (a)				5,079 % fällig am 25.10.2035 ^	3.100	2.800	0,11
0,500 % fällig am 31.10.2031	600	496	0,02	0,500 % fällig am 31.10.2031				Countrywide Asset-Backed Certificates Trust			
0,700 % fällig am 30.11.2033 (b)	17.396	17.361	0,68	0,700 % fällig am 30.11.2033 (b)				5,349 % fällig am 25.02.2036	8.000	7.793	0,30
1,000 % fällig am 30.11.2030 (b)	2.719	2.879	0,11	1,000 % fällig am 30.11.2030 (b)				1	1	0,00	
1,450 % fällig am 31.10.2027	13.400	13.230	0,51	1,450 % fällig am 31.10.2027				Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.			
2,550 % fällig am 31.10.2032	2.500	2.434	0,09	2,550 % fällig am 31.10.2032				4,598 % fällig am 25.01.2032			
		42.950	1,67					Ellington Loan Acquisition Trust			
Summe Spanien		43.893	1,71	Summe Spanien		43.893	1,71	5,489 % fällig am 25.05.2037	859	825	0,03
SLOWENIEN				SLOWENIEN				Encore Credit Receivables Trust			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				5,289 % fällig am 25.01.2036			
Nova Ljubljanska Banka d.d.				Nova Ljubljanska Banka d.d.				1.400	1.337	0,05	
3,400 % fällig am 05.02.2030	€ 1.100	974	0,04	3,400 % fällig am 05.02.2030				First Franklin Mortgage Loan Trust			
STAATSEMISSIONEN				STAATSEMISSIONEN				4,699 % fällig am 25.07.2036			
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				5,259 % fällig am 25.09.2035			
BBVA Consumer Auto				BBVA Consumer Auto				947	890	0,03	
0,270 % fällig am 20.07.2031	904	943	0,04	0,270 % fällig am 20.07.2031				1.432	1.407	0,06	
STAATSEMISSIONEN				STAATSEMISSIONEN				Home Equity Asset Trust			
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				5,244 % fällig am 25.08.2034			
Spain Government International Bond				Spain Government International Bond				60	58	0,00	
0,000 % fällig am 31.01.2028 (a)	7.200	6.550	0,26	0,000 % fällig am 31.01.2028 (a)				Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust			
0,500 % fällig am 31.10.2031	600	496	0,02	0,500 % fällig am 31.10.2031				5,029 % fällig am 25.03.2036	2.538	2.486	0,10
0,700 % fällig am 30.11.2033 (b)	17.396	17.361	0,68	0,700 % fällig am 30.11.2033 (b)				HSI Asset Securitization Corp. Trust			
1,000 % fällig am 30.11.2030 (b)	2.719	2.879	0,11	1,000 % fällig am 30.11.2030 (b)				4,709 % fällig am 25.05.2037	274	273	0,01
1,450 % fällig am 31.10.2027	13.400	13.230	0,51	1,450 % fällig am 31.10.2027				Lehman XS Trust			
2,550 % fällig am 31.10.2032	2.500	2.434	0,09	2,550 % fällig am 31.10.2032				6,689 % fällig am 25.12.2037	1.792	1.760	0,07
		42.950	1,67					Massachusetts Educational Financing Authority			
Summe Spanien		43.893	1,71	Summe Spanien		43.893	1,71	5,308 % fällig am 25.04.2038	46	46	0,00
SLOWENIEN				SLOWENIEN				Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				5,049 % fällig am 25.01.2035			
Nova Ljubljanska Banka d.d.				Nova Ljubljanska Banka d.d.				1.745	1.678	0,07	
3,400 % fällig am 05.02.2030	€ 1.100	974	0,04	3,400 % fällig am 05.02.2030				New Century Home Equity Loan Trust			
STAATSEMISSIONEN				STAATSEMISSIONEN				5,109 % fällig am 25.10.2035			
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				5,154 % fällig am 25.02.2035			
BBVA Consumer Auto				BBVA Consumer Auto				851	824	0,03	
0,270 % fällig am 20.07.2031	904	943	0,04	0,270 % fällig am 20.07.2031				2.048	1.960	0,08	
STAATSEMISSIONEN				STAATSEMISSIONEN				5,109 % fällig am 25.10.2035			
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				5,154 % fällig am 25.02.2035			
Spain Government International Bond				Spain Government International Bond							
0,000 % fällig am 31.01.2028 (a)	7.200	6.550	0,26	0,000 % fällig am 31.01.2028 (a)							
0,500 % fällig am 31.10.2031	600	496	0,02	0,500 % fällig am 31.10.2031							
0,700 % fällig am 30.11.2033 (b)	17.396	17.361	0,68	0,700 % fällig am 30.11.2033 (b)							
1,000 % fällig am 30.11.2030 (b)	2.719	2.879	0,11	1,000 % fällig am 30.11.2030 (b)							
1,450 % fällig am 31.10.2027	13.400	13.230	0,51	1,450 % fällig am 31.10.2027							
2,550 % fällig am 31.10.2032	2.500	2.434	0,09	2,550 % fällig am 31.10.2032							
		42.950	1,67								
Summe Spanien		43.893	1,71	Summe Spanien		43.893	1,71				

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Nomura Home Equity Loan Trust			
4,824 % fällig am 25.03.2036	\$ 789	\$ 770	0,03
Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates			
5,184 % fällig am 25.07.2035	59	58	0,00
Saxon Asset Securities Trust			
1,799 % fällig am 25.05.2035	3.598	3.358	0,13
4,699 % fällig am 25.09.2037	898	845	0,03
SLM Student Loan Trust			
5,858 % fällig am 25.04.2023	88	88	0,00
		53.129	2,07
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Eversource Energy			
2,900 % fällig am 01.10.2024	100	96	0,00
Lehman Brothers Holdings, Inc.			
0,000 % fällig am 05.03.2010 ^ €	950	6	0,00
0,000 % fällig am 05.04.2011 ^	10	0	0,00
RELX Capital, Inc.			
3,500 % fällig am 16.03.2023	\$ 200	199	0,01
		301	0,01
NON-AGENCY-MBS			
Banc of America Funding Trust			
3,775 % fällig am 20.01.2047	1.078	913	0,03
Bear Stearns ALT-A Trust			
3,729 % fällig am 25.09.2035 ^	60	37	0,00
Citigroup Mortgage Loan Trust			
3,871 % fällig am 25.09.2037 ^	221	190	0,01
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.			
3,440 % fällig am 25.09.2035	2	2	0,00
5,500 % fällig am 25.08.2034	478	440	0,02
Countrywide Alternative Loan Trust			
6,000 % fällig am 25.04.2037	879	746	0,03
Credit Suisse Mortgage Capital Certificates			
3,276 % fällig am 30.11.2037	1.200	1.098	0,04
Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust			
4,919 % fällig am 19.10.2045	2.583	2.138	0,08
GreenPoint Mortgage Funding Trust			
4,829 % fällig am 25.06.2045	78	71	0,00
GSR Mortgage Loan Trust			
3,767 % fällig am 25.09.2035	49	46	0,00
Impac CMB Trust			
5,029 % fällig am 25.03.2035	1.189	1.079	0,04
JPMorgan Mortgage Trust			
3,569 % fällig am 25.07.2035	183	171	0,01
Lehman XS Trust			
4,689 % fällig am 25.11.2035	145	145	0,01
Mellon Residential Funding Corp. Mortgage Pass-Through Trust			
4,392 % fällig am 20.10.2029	11	11	0,00
5,178 % fällig am 15.08.2032	160	143	0,01

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Merrill Lynch Mortgage Investors Trust			
5,079 % fällig am 25.08.2036	\$ 3.768	\$ 3.537	0,14
OBX Trust			
5,039 % fällig am 25.06.2057	184	173	0,01
Opteum Mortgage Acceptance Corp. Asset-Backed Pass-Through Certificates			
6,189 % fällig am 25.04.2035	820	775	0,03
Sequoia Mortgage Trust			
5,039 % fällig am 19.10.2026	5	5	0,00
Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust			
3,903 % fällig am 25.08.2047	1.829	1.680	0,06
3,944 % fällig am 25.09.2034	303	284	0,01
Structured Asset Securities Corp.			
4,739 % fällig am 25.03.2035	205	193	0,01
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust			
4,929 % fällig am 25.12.2045	22	21	0,00
4,949 % fällig am 25.11.2045	693	601	0,02
		14.499	0,56
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN			
Fannie Mae			
2,889 % fällig am 01.09.2044	22	21	0,00
4,633 % fällig am 01.12.2030	1	1	0,00
Freddie Mac			
3,248 % fällig am 25.10.2044	226	226	0,01
3,757 % fällig am 01.09.2036	20	20	0,00
3,928 % fällig am 01.10.2036	25	25	0,00
4,133 % fällig am 01.07.2036	56	57	0,00
4,649 % fällig am 25.08.2031	4	4	0,00
4,669 % fällig am 25.09.2031	7	7	0,00
4,918 % fällig am 15.12.2037	138	137	0,01
Ginnie Mae			
2,875 % fällig am 20.04.2030	3	3	0,00
3,000 % fällig am 20.05.2030	2	2	0,00
3,375 % fällig am 20.05.2030	25	25	0,00
3,858 % fällig am 20.08.2068	1.861	1.810	0,07
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA			
2,500 % fällig am 01.01.2053	1.500	1.271	0,05
3,000 % fällig am 01.02.2053	50.000	43.931	1,71
4,000 % fällig am 01.02.2053	57.400	53.863	2,10
4,500 % fällig am 01.02.2053	35.900	34.560	1,34
		135.963	5,29
US-SCHATZobligationen			
U.S. Treasury Inflation Protected Securities (b)			
0,125 % fällig am 15.07.2024	27.608	26.721	1,04
0,125 % fällig am 15.10.2024	25.783	24.833	0,97
0,125 % fällig am 15.04.2025 (d)	95.979	91.488	3,56
0,125 % fällig am 15.10.2025	24.576	23.362	0,91
0,125 % fällig am 15.04.2026	54.868	51.599	2,01
0,125 % fällig am 15.07.2026	36.895	34.778	1,35
0,125 % fällig am 15.10.2026 (d)	43.182	40.490	1,57
0,125 % fällig am 15.04.2027 (e)	10.237	9.544	0,37
0,125 % fällig am 15.01.2030 (d)	74.585	67.040	2,61

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
0,125 % fällig am 15.07.2030	\$ 25.568	\$ 22.909	0,89
0,125 % fällig am 15.01.2031	8.585	7.630	0,30
0,125 % fällig am 15.07.2031 (d)	195.101	172.529	6,72
0,125 % fällig am 15.01.2032 (d)	36.440	31.945	1,24
0,125 % fällig am 15.02.2051	14.203	9.161	0,36
0,125 % fällig am 15.02.2052	5.031	3.263	0,13
0,250 % fällig am 15.01.2025	15.726	15.087	0,59
0,250 % fällig am 15.07.2029 (d)	71.926	65.887	2,56
0,250 % fällig am 15.02.2050	17.037	11.506	0,45
0,375 % fällig am 15.07.2023	5.378	5.314	0,21
0,375 % fällig am 15.07.2025	31.538	30.296	1,18
0,375 % fällig am 15.01.2027 (d)	24.375	22.994	0,89
0,375 % fällig am 15.07.2027	15.738	14.839	0,58
0,500 % fällig am 15.01.2028 (d)	110.807	104.247	4,05
0,625 % fällig am 15.04.2023 (d)	68.834	68.132	2,65
0,625 % fällig am 15.01.2024	8.266	8.092	0,31
0,625 % fällig am 15.01.2026	11.086	10.644	0,41
0,625 % fällig am 15.07.2032 (d)	5.538	5.077	0,20
0,625 % fällig am 15.02.2043	13.971	11.284	0,44
0,750 % fällig am 15.07.2028 (d)	39.126	37.289	1,45
0,750 % fällig am 15.02.2042	19.912	16.684	0,65
0,750 % fällig am 15.02.2045	36.051	29.188	1,13
0,875 % fällig am 15.01.2029	1.912	1.822	0,07
0,875 % fällig am 15.02.2047	8.517	6.991	0,27
1,000 % fällig am 15.02.2046	28.912	24.583	0,96
1,000 % fällig am 15.02.2048	9.553	8.050	0,31
1,000 % fällig am 15.02.2049	16.223	13.577	0,53
1,375 % fällig am 15.02.2044 (d)	41.642	38.712	1,50
1,625 % fällig am 15.10.2027	64.980	64.934	2,52
2,000 % fällig am 15.01.2026	17.073	17.056	0,66
2,125 % fällig am 15.02.2040	18.391	19.483	0,76
2,125 % fällig am 15.02.2041 (d)	38.602	40.927	1,59
2,375 % fällig am 15.01.2025	26.541	26.568	1,03
3,625 % fällig am 15.04.2028 (d)	54.129	59.019	2,29
		1.395.574	54,27
		1.599.466	62,20
Summe USA			
Summe Übertragbare Wertpapiere	\$ 3.391.396		131,88
AKTIEN			
INVESTMENTFONDS			
ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN			
PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (c)	707.536	7.043	0,27
Summe Investmentfonds	\$ 7.043		0,27

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft ⁽¹⁾	% des Nettovermögens
FICC	1,900 %	30.12.2022	03.01.2023	\$ 2.245	U.S. Treasury Notes	0,125 % fällig am 15.05.2023	\$ (2.290)	\$ 2.245	0,09
Summe Pensionsgeschäfte							\$ (2.290)	\$ 2.245	0,09

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Real Return Fund (Forts.)

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

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
3-Month Euribor March Futures	Long	03.2023	1.299	\$ (11.378)	(0,44)
Australia Government 3-Year Note March Futures	Short	03.2023	205	197	0,01
Australia Government 10-Year Bond March Futures	Long	03.2023	43	(195)	(0,01)
Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 146.000 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond February 2023 Futures ⁽¹⁾	Short	01.2023	54	43	0,00
Euro-Bobl March Futures	Short	03.2023	797	3.215	0,12
Euro-BTP Italy Government Bond March Futures	Short	03.2023	393	3.393	0,13
Euro-Bund 10-Year Bond March Futures	Short	03.2023	36	38	0,00
Euro-Buxl 30-Year Bond March Futures	Long	03.2023	107	(2.924)	(0,11)
Euro-OAT France Government 10-Year Bond March Futures	Long	03.2023	247	(2.407)	(0,09)
Euro-Schatz March Futures	Short	03.2023	2.045	2.355	0,09
Japan Government 10-Year Bond March Futures	Short	03.2023	26	548	0,02
Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 138.500 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond February 2023 Futures ⁽¹⁾	Short	01.2023	54	(276)	(0,01)
U.S. Treasury 2-Year Note March Futures	Short	03.2023	78	59	0,00
U.S. Treasury 5-Year Note March Futures	Long	03.2023	1.449	(1.675)	(0,07)
U.S. Treasury 10-Year Note March Futures	Short	03.2023	1.481	1.512	0,06
U.S. Treasury 30-Year Bond March Futures	Long	03.2023	96	4	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond March Futures	Short	03.2023	1.252	2.707	0,11
United Kingdom Long Gilt March Futures	Short	03.2023	566	2.584	0,10
				\$ (2.200)	(0,09)
				\$ (2.200)	(0,09)

Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate

⁽¹⁾ Future-Style-Option.

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
General Electric Co.	1,000 %	20.12.2023	\$ 800	\$ 49	0,00

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fest- Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung ⁽³⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	2,000 %	15.03.2033	£ 37.000	\$ (1.669)	(0,07)
Zahlung ⁽³⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	2,000	15.03.2053	5.600	(264)	(0,01)
Erhalt ⁽³⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	2,250	15.03.2028	22.000	(487)	(0,02)
Zahlung	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,500	12.12.2027	25.800	(272)	(0,01)
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000	16.06.2029	¥ 10.717.000	1.481	0,06
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,435	20.06.2029	3.683.000	418	0,02
Erhalt ⁽³⁾	3-Month USD-LIBOR	1,840	21.11.2028	\$ 36.400	2.994	0,12
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,880	25.01.2052	13.400	(3.891)	(0,15)
Zahlung ⁽³⁾	3-Month USD-LIBOR	1,888	21.11.2053	7.400	(2.027)	(0,08)
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,190	04.11.2052	€ 7.000	3.108	0,12
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,195	04.11.2052	7.350	3.705	0,14
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,197	08.11.2052	12.800	5.660	0,22
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,550	10.08.2024	6.500	(280)	(0,01)
Erhalt ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	0,830	09.12.2052	13.400	398	0,01
Erhalt ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	1,500	15.03.2025	151.800	3.504	0,14
Zahlung ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	1,500	15.03.2028	49.000	(3.824)	(0,15)
Erhalt ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	1,750	15.03.2033	18.000	355	0,01
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,500	12.12.2032	26.100	(938)	(0,04)
Erhalt	CPTFEMU	1,710	15.03.2033	5.900	1.562	0,06
Erhalt	CPTFEMU	2,359	15.08.2030	25.700	888	0,03
Erhalt	CPTFEMU	2,470	15.07.2032	12.900	493	0,02
Zahlung	CPTFEMU	2,570	15.06.2032	1.300	14	0,00
Erhalt	CPTFEMU	2,600	15.05.2032	20.300	734	0,03
Erhalt	CPTFEMU	2,720	15.06.2032	63.300	969	0,04
Erhalt	CPTFEMU	2,975	15.08.2027	17.800	210	0,01
Zahlung	CPTFEMU	3,520	15.09.2024	23.800	(391)	(0,02)
Zahlung	CPTFEMU	3,720	15.09.2024	6.400	(70)	0,00
Zahlung	CPTFEMU	3,850	15.09.2024	27.600	(288)	(0,01)
Zahlung	CPURNSA	1,760	04.11.2029	\$ 23.300	(3.437)	(0,13)
Zahlung	CPURNSA	1,883	20.11.2029	300	(42)	0,00
Zahlung	CPURNSA	1,954	03.06.2029	6.200	(806)	(0,03)
Zahlung	CPURNSA	1,998	25.07.2029	1.800	(223)	(0,01)
Erhalt	CPURNSA	2,210	05.02.2023	21.840	1.974	0,08

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fest- Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	CPURNSA	2,263 %	09.05.2023	\$ 6.846	\$ 570	0,02
Erhalt	CPURNSA	2,311	24.02.2031	6.500	677	0,03
Erhalt	CPURNSA	2,314	26.02.2026	14.400	1.387	0,05
Zahlung	CPURNSA	2,364	10.05.2028	800	(68)	0,00
Zahlung	CPURNSA	2,370	06.06.2028	12.900	(1.098)	(0,04)
Zahlung	CPURNSA	2,379	09.07.2028	700	(58)	0,00
Erhalt	CPURNSA	2,573	26.08.2028	2.200	133	0,01
Erhalt	CPURNSA	2,645	10.09.2028	3.600	190	0,01
Erhalt	CPURNSA	2,690	01.06.2026	2.300	168	0,01
Erhalt	CPURNSA	2,703	25.05.2026	8.980	656	0,02
Erhalt	CPURNSA	2,768	13.05.2026	13.900	988	0,04
Erhalt	CPURNSA	2,813	14.05.2026	20.100	1.383	0,05
Zahlung	UKRPI	3,835	15.10.2032	£ 22.800	(1.076)	(0,04)
Erhalt	UKRPI	4,140	15.10.2031	14.200	882	0,03
Zahlung	UKRPI	4,143	15.10.2032	22.800	(890)	(0,04)
Erhalt	UKRPI	4,250	15.11.2031	17.860	1.172	0,04
Erhalt	UKRPI	4,300	15.01.2032	6.000	142	0,01
Erhalt	UKRPI	4,615	15.02.2027	12.300	405	0,02
Erhalt	UKRPI	5,200	15.06.2024	5.500	279	0,01
Erhalt	UKRPI	5,330	15.06.2024	11.900	567	0,02
Erhalt	UKRPI	6,290	15.03.2024	5.500	412	0,02
Erhalt	UKRPI	6,440	15.05.2024	2.200	127	0,00
Zahlung	UKRPI	6,500	15.03.2024	26.700	(1.859)	(0,07)
Erhalt	UKRPI	6,600	15.05.2024	5.400	289	0,01
					\$ 14.936	0,58
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					\$ 14.985	0,58

- (1) Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definieren, dann zahlt der Teilfonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.
- (2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definieren.
- (3) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

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

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

OPTIONSKAUF

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
BPS	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,000 %	15.03.2023	4.500	\$ 505	\$ 2.438	0,10
BRC	Call – OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,410	02.02.2023	179.700	898	0	0,00
CBK	Call – OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,720	23.02.2023	27.800	153	0	0,00
DUB	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,237	17.11.2023	27.000	1.676	6.003	0,23
GLM	Call – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,200	26.04.2023	29.200	312	18	0,00
JPM	Call – OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,710	25.01.2023	29.500	180	0	0,00
	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,000	15.03.2023	5.900	650	3.196	0,13
MYC	Call – OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,428	31.01.2023	179.200	915	0	0,00
	Call – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,200	31.05.2023	85.000	1.020	102	0,00
							\$ 6.309	\$ 11.757	0,46

VERKAUFSOPTIONEN

INFLATION-CAPPED OPTIONS

Kontrahent	Beschreibung	Anfänglicher Index	Variabler Zinssatz	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
GLM	Cap – OTC CPALEMU	\$ 100,151	Maximal [(Index Final/Index Initial - 1) - 3,000 %] oder 0	22.06.2035	7.800	\$ (356)	\$ (396)	(0,02)
JPM	Cap – OTC CPURNSA	\$ 233,916	Maximal [(Index Final/Index Initial - 1) - 4,000 %] oder 0	22.04.2024	37.600	(273)	0	0,00
	Cap – OTC CPURNSA	\$ 234,781	Maximal [(Index Final/Index Initial - 1) - 4,000 %] oder 0	16.05.2024	3.100	(22)	0	0,00
						\$ (651)	\$ (396)	(0,02)

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
BPS	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,175 %	15.03.2023	13.500	\$ (495)	\$ (4.149)	(0,16)
BRC	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,558	02.02.2023	39.300	(899)	0	0,00
CBK	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,736	23.02.2023	6.600	(163)	0	0,00
	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Erhalt	4,290	17.01.2023	14.600	(614)	(807)	(0,03)
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Zahlung	4,290	17.01.2023	14.600	(614)	(34)	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Real Return Fund (Forts.)

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
DUB	Put – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,340 %	17.11.2023	133.200	\$ (1.678)	\$ (8.635)	(0,34)
GLM	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,350	26.04.2023	16.600	(328)	(28)	0,00
	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,547	07.03.2023	8.300	(182)	(19)	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,547	07.03.2023	8.300	(182)	(523)	(0,02)
	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,067	09.06.2023	9.600	(114)	(25)	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	3,140	09.06.2023	9.600	(132)	(314)	(0,01)
GST	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,950	05.01.2023	30.500	(790)	(9)	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,950	05.01.2023	30.500	(791)	(691)	(0,03)
	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	3,230	18.01.2023	19.100	(514)	(216)	(0,01)
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	3,230	18.01.2023	19.100	(514)	(163)	(0,01)
	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Erhalt	4,670	10.01.2023	15.000	(596)	(1.355)	(0,05)
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Zahlung	4,670	10.01.2023	15.000	(596)	(2)	0,00
JPM	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,785	25.01.2023	7.000	(194)	0	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,175	15.03.2023	17.700	(638)	(5.440)	(0,21)
MYC	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,579	31.01.2023	39.100	(914)	0	0,00
	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,350	31.05.2023	46.800	(1.020)	(138)	(0,01)
							\$ (11.968)	\$ (22.548)	(0,88)

⁽¹⁾ Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Kontrahent	Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag ⁽²⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
GST	CMBX.NA.AAA.8 Index	0,500 %	17.10.2057	\$ 12.200	\$ (713)	\$ 724	\$ 11	0,00
SAL	CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17.08.2061	2.500	(5)	(15)	(20)	0,00
					\$ (718)	\$ 709	\$ (9)	0,00

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

⁽²⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definieren.

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2023	£	26.304	\$ 32.343	\$ 698	\$ 0	698
	01.2023	PEN	1.992	500	0	(21)	(21)
	01.2023	\$	30.071	£ 25.007	49	(34)	15
BOM	01.2023	CAD	16.816	\$ 12.523	112	0	112
	01.2023	SGD	2	1	0	0	0
BPS	03.2023	\$	342	PEN 1.328	4	0	4
	01.2023	SEK	276.627	\$ 26.413	0	(146)	(146)
BRC	01.2023	\$	2.201	€ 2.069	8	0	8
	01.2023	\$	1.419	£ 1.161	0	(22)	(22)
CBK	01.2023	AUD	312	\$ 212	1	0	1
	01.2023	DKK	19.715	€ 2.778	0	(53)	(53)
DUB	01.2023	€	4.000	4.264	0	(7)	(7)
	01.2023	¥	321.600	2.334	0	(105)	(105)
JPM	01.2023	NZD	66.885	41.759	0	(546)	(546)
	01.2023	SEK	5.850	561	0	0	0
MBC	01.2023	\$	14.736	DKK 103.680	150	0	150
	01.2023	\$	272	PEN 1.093	14	0	14
MBC	02.2023	PEN	16.727	\$ 4.194	0	(179)	(179)
	03.2023	\$	287	PEN 1.155	14	0	14
MBC	01.2023	DKK	464.740	\$ 65.502	0	(1.227)	(1.227)
	01.2023	\$	2.524	DKK 18.025	64	0	64
MBC	01.2023	AUD	6.069	\$ 4.112	10	(15)	(5)
	01.2023	DKK	420.260	59.365	0	(977)	(977)
MBC	01.2023	€	18.506	19.505	0	(254)	(254)
	01.2023	£	24.096	29.367	378	0	378
MBC	01.2023	¥	3.025.134	22.094	0	(848)	(848)
	01.2023	\$	3.794	DKK 27.130	102	0	102
MBC	01.2023	£	31.097	€ 29.472	370	0	370
	01.2023	£	1.156	£ 950	0	(13)	(13)
MYI	01.2023	¥	1.152	¥ 151.400	0	(3)	(3)
	01.2023	AUD	61.303	\$ 41.168	0	(415)	(415)
MYI	01.2023	€	102	109	0	0	0
	01.2023	£	1.046	1.264	6	0	6
MYI	01.2023	¥	11.624.996	84.794	0	(3.371)	(3.371)
	01.2023	\$	1.394	€ 1.319	14	0	14
RBC	01.2023	£	7.479	€ 6.123	0	(113)	(113)
	01.2023	AUD	706	\$ 473	0	(6)	(6)
RBC	01.2023	£	2.839	3.463	47	0	47
	01.2023	\$	850	€ 800	4	0	4
RBC	01.2023	£	241	£ 200	0	(1)	(1)

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
SCX	01.2023	CAD 14.670	\$ 10.919	\$ 92	\$ 0	\$ 92	0,00
	01.2023	€ 676.967	704.621	0	(18.182)	(18.182)	(0,71)
	01.2023	\$ 145	PEN 555	1	0	1	0,00
	03.2023	260	1.002	1	0	1	0,00
TOR	01.2023	CAD 20.432	\$ 15.199	119	0	119	0,01
	01.2023	£ 570.785	686.248	0	(459)	(459)	(0,02)
UAG	01.2023	SEK 17.649	1.686	0	(8)	(8)	0,00
	01.2023	\$ 1.456	€ 1.379	17	0	17	0,00
				\$ 2.275	\$ (27.005)	\$ (24.730)	(0,96)

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 31. Dezember 2022 standen fur die Anteilsklassen Institutional CHF (Hedged) thesaurierend, Institutional CHF (Hedged) ausschuttend und Investor CHF (Hedged) ausschuttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
BOA	01.2023	\$ 34.381	CHF 32.517	\$ 787	\$ 0	\$ 787	0,03
BRC	01.2023	17	16	0	0	0	0,00
CBK	01.2023	59.687	56.385	1.297	0	1.297	0,05
MBC	01.2023	CHF 615	\$ 665	1	(2)	(1)	0,00
	01.2023	\$ 805	CHF 744	0	(1)	(1)	0,00
MYI	01.2023	CHF 73	\$ 77	0	(1)	(1)	0,00
SCX	01.2023	32	34	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 6.341	CHF 5.858	2	(7)	(5)	0,00
				\$ 2.087	\$ (11)	\$ 2.076	0,08

Zum 31. Dezember 2022 standen fur die Anteilsklasse Institutional USD (Currency Exposure) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
BOM	01.2023	\$ 273	CAD 366	\$ 0	\$ (2)	\$ (2)	0,00
BRC	01.2023	271	SEK 2.835	2	0	2	0,00
CBK	01.2023	DKK 583	\$ 82	0	(2)	(2)	0,00
	01.2023	\$ 6	SEK 65	0	0	0	0,00
JPM	01.2023	10.586	£ 8.766	0	(39)	(39)	0,00
MBC	01.2023	13	AUD 20	0	0	0	0,00
	01.2023	331	CAD 444	0	(3)	(3)	0,00
	01.2023	147	DKK 1.050	4	0	4	0,00
	01.2023	8.930	€ 8.520	167	0	167	0,01
	01.2023	507	£ 416	0	(6)	(6)	0,00
	01.2023	231	¥ 31.846	10	0	10	0,00
MYI	01.2023	418	AUD 623	4	0	4	0,00
	01.2023	1.102	¥ 151.034	44	0	44	0,00
RBC	01.2023	5	AUD 7	0	0	0	0,00
SCX	01.2023	28	42	0	0	0	0,00
	01.2023	238	CAD 319	0	(2)	(2)	0,00
UAG	01.2023	257	NZD 412	4	0	4	0,00
	01.2023	17	SEK 181	0	0	0	0,00
				\$ 235	\$ (54)	\$ 181	0,01

Zum 31. Dezember 2022 standen fur die Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschuttend, Investor EUR (Hedged) thesaurierend und E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
BOA	01.2023	\$ 16.920	€ 16.043	\$ 209	\$ 0	\$ 209	0,01
BPS	01.2023	€ 762	\$ 813	0	(1)	(1)	0,00
	01.2023	\$ 151	€ 142	0	0	0	0,00
CBK	01.2023	€ 3.138	\$ 3.328	0	(23)	(23)	0,00
	01.2023	\$ 385.791	€ 371.918	11.309	0	11.309	0,44
MBC	01.2023	€ 4.053	\$ 4.310	0	(18)	(18)	0,00
	01.2023	\$ 469.755	€ 447.988	8.563	0	8.563	0,33
SCX	01.2023	400.712	384.986	10.340	0	10.340	0,40
				\$ 30.421	\$ (42)	\$ 30.379	1,18

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Real Return Fund (Forts.)

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend, Institutional GBP (Hedged) ausschüttend und R GBP (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2023	£ 3.967	\$ 4.832	\$ 60	\$ 0	\$ 60	0,00
	01.2023	\$ 336	£ 278	0	(1)	(1)	0,00
BPS	01.2023	£ 56	\$ 68	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 469	£ 389	0	(1)	(1)	0,00
BRC	01.2023	£ 1.929	\$ 2.323	2	0	2	0,00
	01.2023	\$ 691	£ 574	0	0	0	0,00
JPM	01.2023	£ 105.988	\$ 87.773	0	(389)	(389)	(0,01)
MBC	01.2023	£ 54	\$ 66	1	0	1	0,00
	01.2023	\$ 104.774	£ 87.373	430	(87)	343	0,01
MYI	01.2023	£ 59	\$ 71	1	0	1	0,00
	01.2023	\$ 2.735	£ 2.225	0	(59)	(59)	0,00
RBC	01.2023	£ 4	\$ 5	0	0	0	0,00
TOR	01.2023	\$ 105.205	£ 87.504	70	0	70	0,00
UAG	01.2023	£ 266	\$ 329	9	0	9	0,00
				\$ 573	\$ (537)	\$ 36	0,00

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilsklasse Institutional SGD (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2023	\$ 55.938	SGD 76.768	\$ 1.309	\$ 0	\$ 1.309	0,05
BPS	01.2023	58.636	80.410	1.328	0	1.328	0,05
GLM	01.2023	4.621	6.322	93	0	93	0,00
MBC	01.2023	58.459	79.929	1.145	0	1.145	0,05
				\$ 3.875	\$ 0	\$ 3.875	0,15
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						\$ 621	0,02
Summe Anlagen						\$ 3.414.090	132,75
Sonstige Aktiva und Passiva						\$ (842.228)	(32,75)
Nettovermögen						\$ 2.571.862	100,00

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

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

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Nullkuponwertpapier.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

(c) Mit dem Fonds verbunden.

(d) Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von 734.559 USD (31. Dezember 2021: 778.051 USD) wurden gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen zum 31. Dezember 2022 als Sicherheiten verpfändet.

(e) Wertpapier mit einem Gesamtmarktwert von 9.544 USD (31. Dezember 2021: 336.989 USD) wurde gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte zum 31. Dezember 2022 als Sicherheit für verzögert gelieferte Wertpapiere oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte verpfändet oder geliefert.

Barmittel in Höhe von 0 USD (31. Dezember 2021: 860 USD) wurden gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte zum 31. Dezember 2022 als Sicherheiten erhalten.

Wertpapier mit einem Gesamtmarktwert von 101 USD (31. Dezember 2021: 5.677 USD) und Barmittel in Höhe von 0 USD (31. Dezember 2021: 678 USD) wurden gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen zum 31. Dezember 2022 als Sicherheiten erhalten.

Barmittel in Höhe von 24.192 USD (31. Dezember 2021: 23.175 USD) wurden zum 31. Dezember 2022 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 21.490 USD (31. Dezember 2021: 12.320 USD) wurden gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. zum 31. Dezember 2022 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 3.391.396	\$ 0	\$ 3.391.396
Investmentfonds	7.043	0	0	7.043
Pensionsgeschäfte	0	2.245	0	2.245
Finanzderivate ⁽³⁾	(4.808)	18.214	0	13.406
Summen	\$ 2.235	\$ 3.411.855	\$ 0	\$ 3.414.090

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

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 4.811.615	\$ 0	\$ 4.811.615
Investmentfonds	192	0	0	192
Pensionsgeschäfte	0	5.680	0	5.680
Finanzderivate ⁽³⁾	9.953	7.569	0	17.522
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(311)	0	(311)
Summen	\$ 10.145	\$ 4.824.553	\$ 0	\$ 4.834.698

(1) Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

(2) Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

(3) Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions- geschäften	
						% des Nettovermögens
BOS	4,200 %	14.11.2022	09.01.2023	\$ (14.755)	\$ (14.838)	(0,58)
BRC	1,280	13.10.2022	16.01.2023	€ (2.952)	(3.159)	(0,12)
BSN	4,160	03.11.2022	04.01.2023	\$ (550.793)	(554.549)	(21,56)
CIB	4,140	03.11.2022	04.01.2023	(48.625)	(48.955)	(1,90)
	4,140	01.12.2022	04.01.2023	(14.235)	(14.286)	(0,56)
	4,200	17.11.2022	11.01.2023	(35.663)	(35.850)	(1,39)
	4,370	08.12.2022	05.01.2023	(4.615)	(4.628)	(0,18)
	4,400	04.01.2023	19.01.2023	(63.423)	(63.422)	(2,47)
	4,400	05.01.2023	19.01.2023	(4.550)	(4.550)	(0,18)
GRE	4,350	07.12.2022	05.01.2023	(39.790)	(39.910)	(1,55)
	4,360	07.12.2022	05.01.2023	(11.969)	(12.005)	(0,47)
Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte					\$ (796.152)	(30,96)

Ausstehende Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zum 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Zahlbar für Rückkauf- Finanzierungs- geschäfte ⁽¹⁾	
						% des Nettovermögens
BOS	4,210 %	09.11.2022	09.01.2023	\$ (9.459)	\$ (9.519)	(0,37)
Summe Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte					\$ (9.519)	(0,37)

(1) In dem für Rückkaufgeschäfte zahlbaren Betrag sind 8 USD für einen aufgeschobenen Kursrückgang enthalten.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung des Marktwerts der außerbörslich gehandelten Finanzderivate und (erhaltenen)/verpfändeten Sicherheiten nach Kontrahenten zum 31. Dezember 2022 und 31. Dezember 2021:

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2022			Zum 31. Dez. 2021		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾
BOA	\$ 3.056	\$(2.990)	\$ 66	\$ 2.707	\$ (2.720)	\$ (13)
BOM	110	0	110	k. A.	k. A.	k. A.
BPS	(381)	580	199	5.488	(4.780)	708
BRC	(156)	130	(26)	7	60	67
CBK	11.029	(10.872)	157	835	(1.050)	(215)
DUB	(3.859)	3.720	(139)	422	(280)	142
GLM	(1.194)	610	(584)	(589)	0	(589)
GSC	k. A.	k. A.	k. A.	(6)	0	(6)
GST	(2.425)	2.410	(15)	85	0	85
HUS	k. A.	k. A.	k. A.	729	(460)	269
JPM	(2.608)	2.180	(428)	(318)	0	(318)
MBC	8.954	(8.240)	714	k. A.	k. A.	k. A.
MYC	(36)	90	54	(181)	(47)	(228)
MYI	(3.890)	2.910	(980)	4.565	(5.170)	(605)
RBC	44	0	44	4.250	(3.360)	890
SAL	(20)	130	110	(79)	280	201
SCX	(7.751)	7.310	(441)	8.835	(6.060)	2.775
TOR	(270)	1.420	1.150	(4.742)	2.910	(1.832)
UAG	18	0	18	(12.149)	8.810	(3.339)

(1) Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2022:

	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	115,82	118,77
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	15,81	10,95
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,25	0,21
Investmentfonds	0,27	0,01
Pensionsgeschäfte	0,09	0,15
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,09)	0,24
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,58	(0,04)
Freiverkehrsfinanzderivate	0,02	0,27
Leerverkaufte Wertpapiere	k. A.	(0,01)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(30,96)	(20,86)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	(0,37)	(9,07)

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2022 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
Australien	1,83	1,68
Belgien	0,07	k. A.
Kanada	1,46	1,32
Kaimaninseln	1,58	0,93
Dänemark	4,20	9,64
Frankreich	7,82	12,23
Deutschland	0,86	0,00
Guernsey, Kanalinseln	k. A.	0,07
Irland	8,54	3,63
Italien	7,79	10,58
Japan	4,27	4,17
Luxemburg	0,02	0,01
Multinational	k. A.	0,01
Niederlande	0,71	0,33
Neuseeland	1,63	1,24
Peru	0,07	0,17
Slowenien	0,04	0,03
Spanien	1,71	2,04
Schweden	1,15	0,94
Großbritannien	25,93	30,24
USA	62,20	50,67
Investmentfonds	0,27	0,01
Pensionsgeschäfte	0,09	0,15
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,09)	0,24
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf	0,00	0,00
Zinsswaps	0,58	(0,04)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Zinsswapoptionen	0,46	0,20
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaptions auf Kreditindizes	k. A.	0,00
Inflation-Capped Options	(0,02)	0,00
Zinsswapoptionen	(0,88)	(0,23)
Optionen auf Wertpapiere	k. A.	(0,01)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf	0,00	0,00
Devisenterminkontrakte	(0,96)	(0,49)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	1,42	0,80
Leerverkaufte Wertpapiere	k. A.	(0,01)
Sonstige Aktiva und Passiva	(32,75)	(30,55)
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS							
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE				KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG														
Altair Bidco, Inc. 5,500 % - 7,993 % fällig am 01.02.2029	\$	2.126	\$ 2.037	0,00	Redstone Holdco 2 LP 9,108 % fällig am 27.04.2028	\$	7.228	\$ 5.039	0,01	Asian Development Bank 4,700 % fällig am 12.03.2024	MXN	99.000	\$ 4.674	0,01				
American Airlines, Inc. 8,993 % fällig am 20.04.2028	65.500	65.326	0,11	RegionalCare Hospital Partners Holdings, Inc. 8,165 % fällig am 16.11.2025	5.539	5.235	0,01	Serta Simmons Bedding LLC 7,743 % - 7,827 % fällig am 08.11.2023	1.414	100	0,00	Avolon Holdings Funding Ltd. 2,528 % fällig am 18.11.2027	\$	183.112	146.630	0,25		
Aramark Services, Inc. 6,134 % fällig am 11.03.2025	3.646	3.634	0,01	Sierra Hamilton LLC 15,000 % fällig am 12.09.2023	1	1	0,00	5,250 % fällig am 15.05.2024	11.906	11.675	0,02	Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 1,875 % fällig am 09.01.2026	€	21.500	19.737	0,03		
Avolon TLB Borrower (U.S.) LLC 5,853 % fällig am 12.02.2027	9.968	9.852	0,02	Sigma Bidco BV 3,738 % fällig am 02.07.2025	€	28.800	26.779	0,05	2,625 % fällig am 28.04.2025	5.400	5.230	0,01	6,265 % fällig am 24.09.2024	4.800	4.875	0,01		
6,103 % fällig am 15.01.2025	21.326	21.290	0,04	SkyMiles IP Ltd. 7,993 % fällig am 20.10.2027	\$	61.145	62.441	0,11	5,375 % fällig am 18.01.2028	5.000	4.314	0,01	8,000 % fällig am 22.01.2030	26.444	24.764	0,04		
6,603 % fällig am 01.12.2027	10.562	10.558	0,02	Sotera Health Holdings LLC 7,165 % fällig am 11.12.2026	17.409	16.146	0,03	8,500 % fällig am 10.09.2030	2.800	2.636	0,00	Banco de Credito del Peru S.A. 4,650 % fällig am 17.09.2024	PEN	95.500	23.390	0,04		
Axalta Coating Systems Dutch Holding BV 7,506 % fällig am 20.12.2029	2.337	2.342	0,00	SS&C European Holdings SARL 6,134 % fällig am 16.04.2025	8.613	8.484	0,01	Banco Espirito Santo S.A. 2,625 % fällig am 08.05.2017 ^	€	16.200	2.507	0,00	4,750 % fällig am 15.01.2018 ^	8.100	1.253	0,00		
Caesars Resort Collection LLC 7,134 % fällig am 23.12.2024	138.129	137.996	0,24	SS&C Technologies, Inc. 6,134 % fällig am 16.04.2025	16.146	15.903	0,03	Bank of Ireland Group PLC 7,500 % fällig am 19.05.2025 (h)(j)	102.118	106.197	0,18	Bank of Nova Scotia 4,900 % fällig am 04.06.2025 (h)(j)	\$	3.346	3.216	0,01		
7,884 % fällig am 21.07.2025	10.492	10.479	0,02	Sunshine Luxembourg SARL 8,480 % fällig am 01.10.2026	30.544	29.326	0,05	Bank of Nova Scotia 4,900 % fällig am 04.06.2025 (h)(j)	\$	3.346	3.216	0,01	Barclays PLC 4,972 % fällig am 16.05.2029	79.515	74.819	0,13		
Carnival Corp. 5,648 % fällig am 30.06.2025	€	61.547	63.316	0,11	Surgery Center Holdings, Inc. 8,050 % fällig am 31.08.2026	8.962	8.871	0,02	5,875 % fällig am 15.09.2024 (h)(j)	£	10.517	11.622	0,02	6,125 % fällig am 15.12.2025 (h)(j)	\$	16.588	15.157	0,03
7,384 % fällig am 30.06.2025	\$	129.444	124.474	0,21	Syniverse Holdings, Inc. 11,580 % fällig am 13.05.2027	27.246	23.908	0,04	6,375 % fällig am 15.12.2025 (h)(j)	£	11.100	12.275	0,02	7,125 % fällig am 15.06.2025 (h)(j)	70.960	80.909	0,14	
7,634 % fällig am 18.10.2028	52.409	49.212	0,08	Team Health Holdings, Inc. 7,134 % fällig am 06.02.2024	16.403	14.106	0,02	7,250 % fällig am 15.03.2023 (h)(j)	69.909	83.335	0,14	7,437 % fällig am 02.11.2033	\$	10.700	11.244	0,02		
Cengage Learning, Inc. 7,814 % fällig am 14.07.2026	35.040	31.596	0,05	TransDigm, Inc. 6,980 % fällig am 30.05.2025	32.203	31.914	0,05	7,750 % fällig am 15.09.2023 (h)(j)	85.688	83.871	0,15	8,000 % fällig am 15.06.2024 (h)(j)	36.100	35.165	0,06			
Charter Communications Operating LLC 6,140 % fällig am 01.02.2027	37.147	36.330	0,06	6,980 % fällig am 09.12.2025	65.537	64.865	0,11	Bevco Lux SARL 1,000 % fällig am 16.01.2030	€	15.000	12.064	0,02	BGC Partners, Inc. 3,750 % fällig am 01.10.2024	\$	9.586	9.176	0,02	
Clear Channel Outdoor Holdings, Inc. 7,915 % fällig am 21.08.2026	1.627	1.486	0,00	7,830 % fällig am 22.02.2027	36.942	36.862	0,06	BNP Paribas Issuance BV 0,000 % fällig am 12.04.2024	10	1.631.979	2,82	CIFI Holdings Group Co. Ltd. 4,375 % fällig am 12.04.2027 ^	2.000	531	0,00			
Coherent Corp. 7,134 % fällig am 02.07.2029	12.534	12.434	0,02	U.S. Renal Care, Inc. 9,438 % fällig am 26.06.2026	23.133	13.056	0,02	4,450 % fällig am 17.08.2026 ^	1.700	449	0,00	4,800 % fällig am 17.05.2028 ^	700	190	0,00			
CommScope, Inc. 7,634 % fällig am 06.04.2026	15.818	14.952	0,03	9,938 % fällig am 26.06.2026	6.558	3.701	0,01	4,800 % fällig am 17.05.2028 ^	1.100	291	0,00	5,250 % fällig am 13.05.2026 ^	1.300	344	0,00			
Delos Finance SARL 6,480 % fällig am 06.10.2023	8.226	8.225	0,01	Uber Technologies, Inc. 8,235 % fällig am 04.04.2025	38.837	38.858	0,07	5,950 % fällig am 20.10.2025 ^	2.000	526	0,00	6,000 % fällig am 16.07.2025 ^	3.300	883	0,00			
Diamond Sports Group LLC 12,317 % fällig am 25.05.2026	4.030	3.829	0,01	8,235 % fällig am 25.02.2027	23.768	23.755	0,04	6,450 % fällig am 07.11.2024 ^	3.300	883	0,00	Corestate Capital Holding S.A. 3,500 % fällig am 15.04.2023 ^	€	30.000	5.012	0,01		
DirectTV Financing LLC 9,384 % fällig am 02.08.2027	39.425	38.468	0,07	United Airlines, Inc. 8,108 % fällig am 21.04.2028	38.669	38.290	0,07	Country Garden Holdings Co. Ltd. 2,700 % fällig am 12.07.2026	\$	8.400	4.809	0,01	3,125 % fällig am 22.10.2025	13.400	8.222	0,01		
Emerald TopCo, Inc. 7,884 % fällig am 24.07.2026	3.586	3.295	0,01	Univision Communications, Inc. 7,134 % fällig am 15.03.2024	18.409	18.413	0,03	3,875 % fällig am 22.10.2030	6.400	3.401	0,01	4,800 % fällig am 06.08.2030	1.000	534	0,00			
Envision Healthcare Corp. TBD % fällig am 29.04.2027 u 12,119 % fällig am 29.04.2027	8.862 48.738	8.673 47.703	0,01 0,08	Veritas U.S., Inc. 9,730 % fällig am 01.09.2025	1.996	1.419	0,00	5,125 % fällig am 17.01.2025	1.600	1.084	0,00	5,400 % fällig am 27.05.2025	1.600	1.067	0,00			
7,634 % fällig am 28.04.2028	122.658	100.375	0,17	Westmoreland Coal Co. (15,000 % PIK) 15,000 % fällig am 15.03.2029 (c)	4.799	3.731	0,01	5,625 % fällig am 14.01.2030	700	374	0,00	6,150 % fällig am 17.09.2025	1.000	657	0,00			
GVC Holdings PLC 4,398 % fällig am 29.03.2024	€	5.200	5.506	0,01	Windstream Services LLC 10,673 % fällig am 21.09.2027	16.958	15.423	0,03	6,500 % fällig am 08.04.2024	500	379	0,00	8,000 % fällig am 27.01.2024	2.800	2.170	0,00		
Hilton Domestic Operating Co., Inc. 6,173 % fällig am 22.06.2026	\$	64.007	63.883	0,11	Wm Morrison Supermarkets PLC 6,552 % fällig am 04.11.2027	€	67.914	63.964	0,11	AGFC Capital Trust 5,829 % fällig am 15.01.2067	\$	23.000	12.899	0,02	Ally Financial, Inc. 8,000 % fällig am 01.11.2031	2.846	2.967	0,01
iHeartCommunications, Inc. 7,384 % fällig am 01.05.2026	262.150	241.096	0,42	Zayo Group Holdings, Inc. 7,384 % fällig am 09.03.2027	\$	27.783	22.630	0,04	Ambac Assurance Corp. 5,100 % (h)	0	0	0,00	American Assets Trust LP 3,375 % fällig am 01.02.2031	6.400	5.091	0,01		
7,634 % fällig am 01.05.2026	25.119	23.211	0,04					2.122.239	3.66									
INEOS Finance PLC 3,898 % fällig am 01.04.2024	€	99.239	105.724	0,18	UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL													
Instant Brands Holdings, Inc. 9,735 % fällig am 12.04.2028	\$	256	173	0,00	BANKEN UND FINANZEN													
Intelsat Jackson Holdings S.A. 7,445 % fällig am 01.02.2029	88.028	85.167	0,15	ADLER Group S.A. 2,250 % fällig am 27.04.2027	€	1.100	416	0,00										
IQVIA, Inc. 4,202 % fällig am 07.03.2024	€	5.000	5.342	0,01	2,750 % fällig am 13.11.2026	200	86	0,00										
Lealand Finance Co. BV 7,384 % fällig am 28.06.2024	\$	2.771	1.801	0,00	12,500 % fällig am 31.07.2025 (l)	944	1.001	0,00										
Lealand Finance Co. BV (5,384 % bar und 3,000 % PIK) 8,384 % fällig am 30.06.2025 (c)	6.522	3.501	0,01	AGFC Capital Trust 5,829 % fällig am 15.01.2067	\$	23.000	12.899	0,02										
Marriott Ownership Resorts, Inc. 6,134 % fällig am 29.08.2025	2.034	2.017	0,00	Ally Financial, Inc. 8,000 % fällig am 01.11.2031	2.846	2.967	0,01											
Petco Health & Wellness Co., Inc. 7,976 % fällig am 03.03.2028	9.424	9.162	0,02	Ambac Assurance Corp. 5,100 % (h)	0	0	0,00											
PetSmart, Inc. 8,130 % fällig am 11.02.2028	33.028	32.419	0,06	American Assets Trust LP 3,375 % fällig am 01.02.2031	6.400	5.091	0,01											
Poseidon BidCo S.A.S 5,250 % - 7,452 % fällig am 14.07.2028	€	103.800	95.449	0,16	Armor Holdco, Inc. 8,500 % fällig am 15.11.2029	800	602	0,00										
PUG LLC 7,884 % fällig am 12.02.2027	\$	13.187	10.978	0,02	Army Hawaii Family Housing Trust Certificates 4,718 % fällig am 15.06.2050	103.200	69.788	0,12										
8,634 % fällig am 12.02.2027	983	818	0,00															

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Income Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
NMG Holding Co., Inc. 7,125 % fällig am 01.04.2026	\$ 92.700	\$ 87.053	0,15	Topaz Solar Farms LLC 4,875 % fällig am 30.09.2039	\$ 5.609	\$ 4.992	0,01	3,150 % fällig am 01.01.2026	\$ 60.363	\$ 56.155	0,10
Noble Finance Co. (11,000 % bar oder 15,000 % PIK) 11,000 % fällig am 15.02.2028 (c)	7.107	7.907	0,01	5,750 % fällig am 30.09.2039	47.582	45.228	0,08	3,250 % fällig am 15.06.2023 ^	59.082	58.436	0,10
Norfolk Southern Corp. 4,100 % fällig am 15.05.2121	5.000	3.482	0,01	U.S. Airways Pass-Through Trust 3,950 % fällig am 15.05.2027	3.067	2.790	0,00	3,250 % fällig am 16.02.2024	66.100	64.546	0,11
NPC Ukraine 6,875 % fällig am 09.11.2028 ^	1.000	178	0,00	U.S. Renal Care, Inc. 10,625 % fällig am 15.07.2027	7.490	1.648	0,00	3,250 % fällig am 01.06.2031	37.030	30.189	0,05
Oracle Corp. 3,850 % fällig am 01.04.2060	28.599	19.128	0,03	Uber Technologies, Inc. 7,500 % fällig am 15.05.2025	22.817	22.834	0,04	3,300 % fällig am 15.03.2027 ^	19.465	17.343	0,03
3,950 % fällig am 25.03.2051 (I)	18.539	13.289	0,02	8,000 % fällig am 01.11.2026	1.180	1.186	0,00	3,300 % fällig am 01.12.2027 ^	106.702	94.342	0,16
4,100 % fällig am 25.03.2061 (I)	26.800	18.726	0,03	United Airlines Pass-Through Trust 2,700 % fällig am 01.11.2033	19.734	15.977	0,03	3,400 % fällig am 01.08.2040 ^	5.115	3.481	0,01
PeaceHealth Obligated Group 3,218 % fällig am 15.11.2050	13.300	8.690	0,02	3,500 % fällig am 01.09.2031	809	701	0,00	3,400 % fällig am 15.08.2024 ^	52.193	50.116	0,09
Petroleos de Venezuela S.A. 5,375 % fällig am 12.04.2027 ^	53.114	2.589	0,00	3,750 % fällig am 03.03.2028	8.389	7.733	0,01	3,500 % fällig am 01.07.2025	103.044	97.642	0,17
5,500 % fällig am 12.04.2037 ^	50.574	2.467	0,00	4,000 % fällig am 11.10.2027	530	493	0,00	3,500 % fällig am 15.06.2025 ^	63.544	60.011	0,10
6,000 % fällig am 16.05.2024 ^	47.576	2.438	0,00	4,150 % fällig am 11.10.2025	349	338	0,00	3,500 % fällig am 01.08.2050	12.179	7.611	0,01
6,000 % fällig am 15.11.2026 ^	63.177	3.080	0,01	4,150 % fällig am 25.02.2033	773	686	0,00	3,750 % fällig am 01.08.2050 ^	29.892	29.287	0,05
9,750 % fällig am 17.05.2035 ^	28.330	1.452	0,00	5,875 % fällig am 15.04.2029	95.833	94.619	0,16	3,750 % fällig am 15.02.2024 ^	113.694	101.049	0,17
Petroleos Mexicanos 2,750 % fällig am 21.04.2027	€ 7.200	6.031	0,01	United Group BV 4,875 % fällig am 01.07.2024	€ 6.077	6.060	0,01	3,850 % fällig am 15.11.2023 ^	17.368	17.126	0,03
5,950 % fällig am 28.01.2031	\$ 112.761	85.601	0,15	Valaris Ltd. (8,250 % bar oder 12,000 % PIK) 8,250 % fällig am 30.04.2028 (c)	\$ 1.983	1.997	0,00	3,950 % fällig am 01.12.2047 ^	4.700	3.205	0,01
6,700 % fällig am 16.02.2032	383.028	301.520	0,52	Venture Global Calcasieu Pass LLC 3,875 % fällig am 15.08.2029	38.600	33.843	0,06	4,000 % fällig am 01.12.2046 ^	16.783	11.298	0,02
6,750 % fällig am 21.09.2047	2.466	1.579	0,00	3,875 % fällig am 01.11.2033	164.200	134.438	0,23	4,200 % fällig am 01.03.2029	32.300	28.907	0,05
6,950 % fällig am 28.01.2060	60.850	38.603	0,07	4,125 % fällig am 15.08.2031	37.800	32.272	0,06	4,200 % fällig am 01.06.2041	4.900	3.646	0,01
7,890 % fällig am 23.01.2050	9.240	6.414	0,01	Veritas U.S., Inc. 7,500 % fällig am 01.09.2025	4.090	2.826	0,00	4,250 % fällig am 01.08.2023	30.771	30.620	0,05
Prime Healthcare Services, Inc. 7,250 % fällig am 01.11.2025	35.984	30.463	0,05	ViaSat, Inc. 5,625 % fällig am 15.09.2025	28.739	26.709	0,05	4,250 % fällig am 15.02.2046 ^	25.035	17.509	0,03
Prosus NV 1,207 % fällig am 19.01.2026	€ 7.100	6.844	0,01	Viking Cruises Ltd. 13,000 % fällig am 15.05.2025	31.212	32.980	0,06	4,300 % fällig am 15.03.2045 ^	66.234	47.205	0,08
1,985 % fällig am 13.07.2033	10.500	7.610	0,01	13,000 % fällig am 15.05.2025	31.212	32.980	0,06	4,400 % fällig am 01.03.2032	33.000	28.891	0,05
2,085 % fällig am 19.01.2030	3.900	3.252	0,01	Viking Ocean Cruises Ship Ltd. 5,625 % fällig am 15.02.2029	4.400	3.548	0,01	4,450 % fällig am 15.02.2044 ^	33.949	25.391	0,04
2,778 % fällig am 19.01.2034	8.700	6.708	0,01	VOC Escrow Ltd. 5,000 % fällig am 15.02.2028	10.500	9.048	0,02	4,500 % fällig am 01.07.2040	87.391	68.621	0,12
3,061 % fällig am 13.07.2031	\$ 4.600	3.558	0,01	Wabtec Transportation Netherlands BV 1,250 % fällig am 03.12.2027	€ 9.496	8.617	0,01	4,500 % fällig am 15.12.2041 ^	4.657	3.304	0,01
3,257 % fällig am 19.01.2027	10.800	9.670	0,02	Weir Group PLC 2,200 % fällig am 13.05.2026	\$ 20.600	18.293	0,03	4,650 % fällig am 01.07.2030	210.515	191.303	0,33
4,193 % fällig am 01.01.2032	3.700	3.072	0,01	Wesco Aircraft Holdings, Inc. (7,500 % bar und 3,000 % PIK) 10,500 % fällig am 15.11.2026 (c)	30.072	27.742	0,05	4,600 % fällig am 15.06.2043 ^	41.543	31.538	0,05
RegionalCare Hospital Partners Holdings, Inc. 9,750 % fällig am 01.12.2026	2.700	2.178	0,00	Wesleyan University 4,781 % fällig am 01.07.2116	2.100	1.647	0,00	4,650 % fällig am 01.08.2028	4.100	3.777	0,01
Roadster Finance DAC 2,375 % fällig am 08.12.2032	€ 7.000	5.607	0,01	Western Midstream Operating LP 5,041 % fällig am 13.01.2023	5.587	5.579	0,01	4,750 % fällig am 15.02.2044 ^	31.088	23.904	0,04
Rolls-Royce PLC 1,625 % fällig am 09.05.2028	3.987	3.387	0,01	Windstream Escrow LLC 7,750 % fällig am 15.08.2028	36.560	29.876	0,05	4,950 % fällig am 08.06.2025	15.300	15.078	0,03
3,375 % fällig am 18.06.2026	€ 24.703	25.705	0,04	Wynn Las Vegas LLC 5,250 % fällig am 15.05.2027	7.180	6.491	0,01	4,950 % fällig am 01.07.2050	160.171	124.793	0,21
3,625 % fällig am 14.10.2025	\$ 17.903	16.560	0,03	5,500 % fällig am 01.03.2025	21.637	20.586	0,04	5,250 % fällig am 01.03.2052	33.000	27.091	0,05
4,625 % fällig am 16.02.2026	€ 72.915	75.678	0,13	Wynn Macau Ltd. 4,875 % fällig am 01.10.2024	5.648	5.341	0,01	5,450 % fällig am 15.06.2027	12.900	12.742	0,02
5,750 % fällig am 15.10.2027	€ 24.271	26.875	0,05	5,125 % fällig am 15.12.2029	23.790	19.287	0,03	5,900 % fällig am 15.06.2032	10.000	9.787	0,02
Royal Caribbean Cruises Ltd. 11,500 % fällig am 01.06.2025	\$ 41.527	44.629	0,08	5,500 % fällig am 15.01.2026	53.600	49.254	0,09	Peru LNG SRL 5,375 % fällig am 22.03.2030	600	502	0,00
Russian Railways Via RZD Capital PLC 7,487 % fällig am 25.03.2031 ^	€ 13.950	9.067	0,02	5,500 % fällig am 10.10.2027	7.174	6.755	0,01	Petrobras Global Finance BV 6,250 % fällig am 14.12.2026	€ 37.833	44.203	0,08
Sands China Ltd. 2,900 % fällig am 08.03.2027	\$ 15.600	13.381	0,02	5,625 % fällig am 26.08.2028	43.978	37.658	0,07	6,625 % fällig am 16.01.2034	6.800	7.113	0,01
3,350 % fällig am 08.03.2029	11.200	9.165	0,02	Wynn Resorts Finance LLC 7,750 % fällig am 15.04.2025	6.593	6.567	0,01	PG&E Wildfire Recovery Funding LLC 4,263 % fällig am 01.06.2038	\$ 20.100	18.689	0,03
3,750 % fällig am 08.08.2031	9.900	7.804	0,01	4,875 % fällig am 01.10.2024	5.648	5.341	0,01	4,377 % fällig am 03.06.2041	22.200	19.865	0,03
4,300 % fällig am 08.01.2026	15.937	14.728	0,03	5,125 % fällig am 15.12.2029	23.790	19.287	0,03	4,451 % fällig am 01.12.2049	22.830	19.900	0,03
4,875 % fällig am 18.06.2030	11.980	10.544	0,02	5,500 % fällig am 15.01.2026	53.600	49.254	0,09	Rio Oil Finance Trust 8,200 % fällig am 06.04.2028	16.939	17.189	0,03
5,625 % fällig am 08.08.2025	46.640	44.653	0,08	5,500 % fällig am 14.10.2052	9.400	10.092	0,02	9,250 % fällig am 06.07.2024	10.994	11.160	0,02
5,900 % fällig am 08.08.2028	47.410	44.455	0,08	Gazprom PJSC Via Gaz Finance PLC 2,950 % fällig am 27.01.2029	183.800	127.741	0,22	9,750 % fällig am 06.01.2027	7.687	7.997	0,01
Seagate HDD Cayman 4,091 % fällig am 01.06.2029	1.300	1.080	0,00	Pacific Gas & Electric Co. 1,700 % fällig am 15.11.2023	46.400	44.923	0,08	Sprint Capital Corp. 8,750 % fällig am 15.03.2032	12.200	14.547	0,02
Spirit Airlines Pass-Through Trust 4,100 % fällig am 01.10.2029	612	546	0,00	2,100 % fällig am 01.08.2027	7.177	6.140	0,01	Sprint LLC 7,125 % fällig am 15.06.2024	94.180	96.227	0,17
Sprint Spectrum Co. LLC 4,738 % fällig am 20.09.2029	25.473	25.185	0,04	2,500 % fällig am 01.02.2031	12.391	9.642	0,02	7,625 % fällig am 01.03.2026	20.490	21.607	0,04
Studio City Finance Ltd. 5,000 % fällig am 15.01.2029	11.340	8.389	0,01	2,950 % fällig am 01.03.2026 ^	100.075	91.832	0,16	7,875 % fällig am 15.09.2023	220.500	224.069	0,39
Surgery Center Holdings, Inc. 10,000 % fällig am 15.04.2027	960	978	0,00	3,000 % fällig am 15.06.2028	31.800	27.552	0,05	Summe Unternehmensanleihen und Wechsel		13.122.408	22,63
Sutter Health 3,161 % fällig am 15.08.2040	2.900	2.178	0,00	VERSORGUNGSUNTERNEHMEN		4.843.856	8,35	WANDELANLEIHEN & WECHSEL			
3,361 % fällig am 15.08.2050	19.400	13.234	0,02	Enel Finance America LLC 7,100 % fällig am 14.10.2027	18.600	19.265	0,03	Multiplan Corp. (6,000 % bar oder 7,000 % PIK) 6,000 % fällig am 15.10.2027 (c)	30.000	19.275	0,03
Syngenta Finance NV 4,441 % fällig am 24.04.2023	1.900	1.892	0,00	Enel Finance International NV 7,500 % fällig am 14.10.2032	14.500	15.367	0,03	KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL			
4,892 % fällig am 24.04.2025	4.948	4.797	0,01	7,750 % fällig am 14.10.2052	9.400	10.092	0,02	Chicago, Illinois General Obligation Bonds, Series 2015 7,750 % fällig am 01.01.2042	952	968	0,00
Times Square Hotel Trust 8,528 % fällig am 01.08.2026	1.680	1.660	0,00	Gazprom PJSC Via Gaz Finance PLC 2,950 % fällig am 27.01.2029	183.800	127.741	0,22	Chicago, Illinois General Obligation Bonds, Series 2017 7,045 % fällig am 01.01.2029	2.205	2.236	0,00

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Russia Government International Bond				STAMMIAKTIE				KURZFRISTIGE INSTRUMENTE			
0,000 % fällig am 24.04.2024	RUB 18.336.201	\$ 77.866	0,13	KOMMUNIKATIONSDIENSTE				KURZFRISTIGE SCHULDITITEL			
1,850 % fällig am 20.11.2032 ^	€ 2.800	867	0,00	Clear Channel Outdoor Holdings, Inc. (d)	26.868.244	\$ 28.212	0,05	Corestate Capital Holding S.A.			
4,250 % fällig am 23.06.2027 ^	\$ 116.200	40.670	0,07	iHeartMedia, Inc. 'A' (d)	6.332.872	38.820	0,07	8,000 % fällig am 15.04.2023 (l)	€ 1.000	\$ 1.068	0,00
4,375 % fällig am 21.03.2029 ^	6.000	1.800	0,00	iHeartMedia, Inc. 'B' (d)	4.913.662	27.109	0,04	Federal Home Loan Bank			
4,750 % fällig am 27.05.2026 ^	115.600	40.460	0,07			94.141	0,16	4,310 % fällig am 03.01.2023	\$ 144.400	144.400	0,25
4,875 % fällig am 16.09.2023 ^	7.400	6.105	0,01	BASISKONSUMGÜTER				4,310 % fällig am 04.01.2023	98.500	98.500	0,17
5,100 % fällig am 28.03.2035 ^	20.000	6.600	0,01	Neiman Marcus Group Ltd. LLC (d)(l)	1.179.713	207.693	0,36	4,310 % fällig am 20.01.2023	100.000	100.000	0,17
5,250 % fällig am 23.06.2047 ^	345.400	127.798	0,22	ENERGIE				4,310 % fällig am 25.01.2023	478.600	478.623	0,83
5,625 % fällig am 04.04.2042 ^	98.400	62.484	0,11	Constellation Oil Services Holding S.A. 'B' (d)(l)	3.258.324	353	0,00	4,320 % fällig am 06.01.2023	470.500	470.500	0,81
5,875 % fällig am 16.09.2043 ^	26.600	15.883	0,03	Noble Corp. PLC (d)	1.786.917	67.385	0,12	4,320 % fällig am 24.01.2023	67.200	67.201	0,12
7,150 % fällig am 12.11.2025	RUB 20.520.713	87.143	0,15			67.738	0,12	4,325 % fällig am 06.02.2023	237.500	237.503	0,41
7,500 % fällig am 31.03.2030 ^	\$ 16.872	10.943	0,02	FINANZWERTE				4,340 % fällig am 10.02.2023	59.300	59.302	0,10
7,950 % fällig am 07.10.2026	RUB 7.973.492	33.860	0,06	Cairo Mezz PLC (d)	3.408.327	323	0,00	4,345 % fällig am 23.02.2023	69.300	69.304	0,12
12,750 % fällig am 24.06.2028 ^	\$ 41.736	32.632	0,06	Credit Suisse Group AG	2.843.931	8.486	0,02	4,345 % fällig am 06.03.2023	123.300	123.309	0,21
				Eurobank Ergasias Services and Holdings S.A. 'A' (d)	40.899.918	45.930	0,08				
Serbia Government International Bond				Intelsat Emergence S.A. (d)(l)	4.649.159	111.580	0,19	ARGENTINA TREASURY BILLS			
3,125 % fällig am 15.05.2027	€ 9.758	8.985	0,02	Stearns Holdings LLC 'B' (d)	1.114.539	0	0,00	(105,064) % fällig am 17.02.2023 (e)(f)	ARS 279.872	851	0,00
				Voyager Aviation Holdings LLC (d)	2.155	0	0,00	(5,093) % fällig am 16.06.2023 (e)(f)	10.029.792	30.159	0,05
						166.319	0,29	2,749 % fällig am 18.09.2023 (e)(f)	7.801.290	23.092	0,04
South Africa Government International Bond										54.102	0,09
10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR 12.158.400	755.436	1,30	INDUSTRIEWERTE				JAPAN TREASURY BILLS			
State Agency of Roads of Ukraine				Sierra Hamilton Holder LLC (d)(l)	2.210.032	0	0,00	(0,249) % fällig am 11.01.2023 (e)(f)	¥ 847.000	6.420	0,01
6,250 % fällig am 24.06.2030	\$ 1.300	231	0,00	Westmoreland Mining Holdings LLC (d)(l)	82.938	622	0,00	(0,242) % fällig am 23.01.2023 (e)(f)	6.905.000	52.338	0,09
						622	0,00	(0,204) % fällig am 06.01.2023 (e)(f)	9.090.000	68.893	0,12
Turkey Government International Bond								(0,200) % fällig am 06.03.2023 (e)(f)	153.000	1.160	0,00
4,250 % fällig am 13.03.2025	259.500	243.255	0,42	BEZUGSRECHTE				(0,185) % fällig am 13.03.2023 (e)(f)	14.368.000	108.930	0,19
5,250 % fällig am 13.03.2030	155.000	125.163	0,22	Intelsat Jackson Holdings S.A. – Exp. 05.12.2025	1.026.237	7.288	0,01	(0,182) % fällig am 20.03.2023 (e)(f)	17.278.000	130.997	0,23
6,125 % fällig am 24.10.2028	28.900	25.894	0,04	OPTIONSSCHEINE				(0,181) % fällig am 13.03.2023 (e)(f)	2.662.000	20.182	0,03
7,625 % fällig am 26.04.2029	94.000	88.932	0,15	Constellation Oil Services Holding S.A. – Exp. 10.06.2071 (l)	4	0	0,00	(0,171) % fällig am 20.03.2023 (e)(f)	20.099.000	152.385	0,26
Ukraine Government International Bond				Guaranteed Rate, Inc. – Exp. 31.12.2060	5.339	0	0,00	(0,170) % fällig am 06.01.2023 (e)(f)	10.300.000	78.064	0,13
4,375 % fällig am 27.01.2032 ^	€ 18.760	3.729	0,01	Intelsat Emergence S.A. – Exp. 17.02.2027	160.093	515	0,00	(0,170) % fällig am 16.01.2023 (e)(f)	18.180.000	137.793	0,24
United Kingdom Gilt				Windstream Holdings II, LLC - Exp. 21.09.2055	2.022.886	40.951	0,07	(0,169) % fällig am 11.01.2023 (e)(f)	14.540.000	110.201	0,19
1,250 % fällig am 31.07.2051	£ 14.980	9.744	0,02			41.466	0,07	(0,166) % fällig am 13.03.2023 (e)(f)	13.365.000	101.326	0,18
1,500 % fällig am 22.07.2047	6.910	5.079	0,01	VORZUGSWERTPAPIERE				(0,165) % fällig am 20.02.2023 (e)(f)	25.380.000	192.400	0,33
1,750 % fällig am 22.01.2049	13.820	10.650	0,02	Nationwide				(0,160) % fällig am 30.01.2023 (e)(f)	330.000	2.501	0,00
3,250 % fällig am 22.01.2044	12.410	13.273	0,02	Building Society	859.974	129.567	0,22	(0,151) % fällig am 13.03.2023 (e)(f)	9.257.000	70.181	0,12
3,500 % fällig am 22.01.2045	11.860	13.148	0,02	Voyager Aviation Holdings LLC				(0,140) % fällig am 06.03.2023 (e)(f)	424.000	3.214	0,01
Venezuela Government International Bond				9,500 %	12.927	3.469	0,01	(0,135) % fällig am 06.03.2023 (e)(f)	19.830.000	150.335	0,26
6,000 % fällig am 09.12.2020 ^	\$ 9.289	650	0,00			133.036	0,23	(0,131) % fällig am 06.03.2023 (e)(f)	56.310.000	426.897	0,74
7,000 % fällig am 31.03.2038 ^	14.228	1.280	0,00	REAL ESTATE INVESTMENT TRUSTS				(0,130) % fällig am 20.02.2023 (e)(f)	121.200.000	918.789	1,58
7,650 % fällig am 21.04.2025 ^	28.167	2.465	0,00	CBL & Associates Properties, Inc.	95.496	2.204	0,01			2.733.006	4,71
7,750 % fällig am 13.10.2019 ^	5.850	468	0,00	Uniti Group, Inc.	979.763	5.418	0,01				
8,250 % fällig am 13.10.2024 ^	35.331	3.091	0,01	VICI Properties, Inc.	5.793.243	187.701	0,32				
9,000 % fällig am 07.05.2023 ^	13.516	1.183	0,00			195.323	0,34				
9,250 % fällig am 15.09.2027 ^	34.519	3.279	0,01								
9,250 % fällig am 07.05.2028 ^	39.817	3.584	0,01								
11,750 % fällig am 21.10.2026 ^	3.990	369	0,00								
12,750 % fällig am 23.08.2022 ^	6.170	509	0,00								
		3.067.062	5,29								

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Income Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
U.S. TREASURY BILLS				INVESTMENTFONDS				BÖRSENGEHANDELTE FONDS			
ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN				PIMCO Select Funds plc –				PIMCO ETFs plc – PIMCO			
3,775 % fällig am 12.01.2023 (e)(f)	\$ 3.500	\$ 3.497	0,01	PIMCO US Dollar Short- Term Floating NAV Fund (i)	180.213.210	\$ 1.793.842	3,09	US Dollar Short Maturity UCITS ETF (i)	2.903.000	\$ 287.586	0,50
Summe kurzfristige Instrumente		4.640.315	8,00					Summe Investmentfonds		\$ 2.081.428	3,59
Summe Übertragbare Wertpapiere		\$ 67.246.471	115,99								

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kapital- betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions- geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions- geschäft ⁽¹⁾	% des Nettovermögens
BOS	4,290 %	29.12.2022	05.01.2023	\$ 500.000	U.S. Treasury Bonds 2,750 % – 3,750 % fällig am 15.11.2043 – 15.11.2047	\$ (513.518)	\$ 500.000	\$ 500.417	0,86
DEU	4,230	30.12.2022	03.01.2023	116.100	U.S. Treasury Bonds 2,750 % fällig am 15.11.2047	(118.445)	116.100	116.155	0,20
FICC	1,900	30.12.2022	03.01.2023	82.859	U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 29.06.2023	(82.219)	82.859	82.868	0,14
	4,280	30.12.2022	03.01.2023	1.954.800	U.S. Treasury Notes 1,250 % fällig am 31.03.2028	(2.298)			
					U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % – 0,250 % fällig am 15.01.2025 – 15.04.2025	(323.152)	1.954.800	1.955.730	3,37
					U.S. Treasury Notes 0,250 % – 3,000 % fällig am 15.05.2024 – 30.06.2025	(1.670.744)			
MBC	4,320	30.12.2022	03.01.2023	394.900	U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 05.01.2023	(404.498)	394.900	395.090	0,68
	4,330	30.12.2022	06.01.2023	250.000	U.S. Treasury Notes 1,250 % – 3,500 % fällig am 15.09.2025 – 31.08.2029	(257.998)	250.000	250.210	0,43
SGY	4,290	30.12.2022	03.01.2023	113.800	U.S. Treasury Bonds 2,000 % – 3,250 % fällig am 5.11.2041	(115.784)	113.800	113.854	0,20
SOG	4,380	16.12.2022	15.12.2024	9.239	U.S. Treasury Bonds 4,375 % fällig am 23.11.2026	(9.894)	9.239	9.239	0,02
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (3.498.550)	\$ 3.421.698	\$ 3.423.563	5,90

⁽¹⁾ Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
3-Month SOFR December Futures	Short	03.2024	2.299	\$ 10.628	0,02
3-Month SOFR December Futures	Short	03.2025	1.188	3.260	0,01
3-Month SOFR December Futures	Short	03.2026	1.289	3.303	0,01
3-Month SOFR June Futures	Short	09.2024	1.498	5.102	0,01
3-Month SOFR June Futures	Short	09.2025	1.206	3.143	0,01
3-Month SOFR March Futures	Short	06.2024	1.990	7.941	0,01
3-Month SOFR March Futures	Short	06.2025	1.087	2.899	0,01
3-Month SOFR March Futures	Short	06.2026	1.206	3.048	0,01
3-Month SOFR September Futures	Short	12.2024	1.390	4.125	0,01
3-Month SOFR September Futures	Short	12.2025	986	2.524	0,00
Australia Government 10-Year Bond March Futures	Short	03.2023	230	1.019	0,00
Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 146.000 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond February 2023 Futures ⁽¹⁾	Short	01.2023	700	560	0,00
Euro-Bund 10-Year Bond March Futures	Short	03.2023	4.096	37.705	0,06
Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 138.500 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond February 2023 Futures ⁽¹⁾	Short	01.2023	700	(3.579)	(0,01)
U.S. Treasury 2-Year Note March Futures	Long	03.2023	793	107	0,00
U.S. Treasury 5-Year Note March Futures	Long	03.2023	13.167	(2.055)	(0,01)
U.S. Treasury 10-Year Note March Futures	Short	03.2023	5.678	2.323	0,00
U.S. Treasury 30-Year Bond March Futures	Short	03.2023	6.395	6.621	0,01
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond March Futures	Long	03.2023	881	(933)	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond March Futures	Short	03.2023	6.106	3.559	0,01
				\$ 91.300	0,16

⁽¹⁾ Future-Style-Option.

VERKAUFSOPTIONEN**OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE**

Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
Call – CME Kaufoptionen mit Ausübungskurs von USD 98,000 auf 3-Month SOFR December Futures	\$ 98,000	15.12.2023	1.218	\$ (359)	\$ (105)	0,00
Put – CME Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von USD 96,500 auf 3-Month SOFR December Futures	96,500	15.12.2023	1.218	(479)	(3.694)	(0,01)
				\$ (838)	\$ (3.799)	(0,01)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate					\$ 87.501	0,15

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽³⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Airbus Finance BV	1,000 %	20.06.2028	€ 13.400	\$ (380)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2023	\$ 30.900	42	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.12.2023	11.100	(123)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2024	69.900	116	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.12.2025	9.500	(114)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2026	24.100	(367)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.12.2026	6.600	(101)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2027	9.100	26	0,00
Barclays Bank PLC	1,000	20.12.2023	€ 25.600	45	0,00
Boeing Co.	1,000	20.06.2023	\$ 57.100	(114)	0,00
Boeing Co.	1,000	20.12.2023	20.400	65	0,00
Boeing Co.	1,000	20.12.2024	5.570	129	0,00
Boeing Co.	1,000	20.06.2025	19.600	207	0,00
Boeing Co.	1,000	20.12.2025	11.700	122	0,00
Boeing Co.	1,000	20.06.2026	3.200	(6)	0,00
Boeing Co.	1,000	20.12.2026	24.000	(136)	0,00
Boeing Co.	1,000	20.06.2027	30.200	831	0,00
Bombardier, Inc.	5,000	20.06.2024	4.600	223	0,00
Bombardier, Inc.	5,000	20.12.2024	4.900	378	0,00
Bombardier, Inc.	5,000	20.06.2025	200	23	0,00
Devon Energy Corp.	1,000	20.12.2026	6.500	17	0,00
Energy Transfer Operating LP	1,000	20.06.2026	2.900	73	0,00
Expedia Group, Inc.	1,000	20.12.2026	3.700	(56)	0,00
Ford Motor Co.	5,000	20.12.2024	12.100	(616)	0,00
Ford Motor Co.	5,000	20.06.2026	3.300	(183)	0,00
Ford Motor Co.	5,000	20.12.2026	4.400	(297)	0,00
Ford Motor Co.	5,000	20.06.2027	3.300	(136)	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20.06.2023	3.400	(206)	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20.06.2024	18.900	(14)	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20.12.2024	44.900	(543)	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20.06.2025	24.800	(594)	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20.12.2025	25.300	464	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20.06.2026	8.200	(367)	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20.12.2026	6.600	(292)	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20.06.2027	11.500	(423)	0,00
General Electric Co.	1,000	20.12.2023	109.900	6.305	0,01
General Electric Co.	1,000	20.12.2024	15.800	412	0,00
General Electric Co.	1,000	20.06.2026	73.100	(119)	0,00
General Electric Co.	1,000	20.12.2026	23.900	(161)	0,00
General Motors Co.	5,000	20.12.2026	12.700	(1.046)	0,00
Hess Corp.	1,000	20.12.2026	3.500	24	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20.06.2025	€ 15.000	512	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20.12.2025	26.300	1.331	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20.06.2026	57.700	1.155	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20.12.2026	122.800	(3.560)	(0,01)
Rolls-Royce PLC	1,000	20.06.2027	28.200	(353)	0,00
Tesco PLC	1,000	20.06.2028	3.800	(91)	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.06.2026	\$ 6.700	(145)	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.12.2026	32.300	(758)	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.06.2027	18.800	41	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.12.2027	17.300	118	0,00
				\$ 1.358	0,00

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF⁽²⁾

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽³⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.IG-35 5-Year Index	(1,000) %	20.12.2025	\$ 107.200	\$ 1.239	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Income Fund (Forts.)

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽³⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.EM-29 5-Year Index	1,000 %	20.06.2023	\$109.514	\$ 2.225	0,00
CDX.EM-30 5-Year Index	1,000	20.12.2023	378.250	4.759	0,01
CDX.EM-31 5-Year Index	1,000	20.06.2024	99.588	3.391	0,01
CDX.EM-32 5-Year Index	1,000	20.12.2024	71.910	2.727	0,00
CDX.EM-34 5-Year Index	1,000	20.12.2025	218.224	1.323	0,00
CDX.EM-35 5-Year Index	1,000	20.06.2026	1.380	0	0,00
CDX.EM-36 5-Year Index	1,000	20.12.2026	743.636	27.808	0,05
CDX.EM-37 5-Year Index	1,000	20.06.2027	6.958	226	0,00
CDX.EM-38 5-Year Index	1,000	20.12.2027	276.300	6.882	0,01
CDX.HY-34 5-Year Index	5,000	20.06.2025	5.096	(330)	0,00
CDX.HY-35 5-Year Index	5,000	20.12.2025	8.415	(493)	0,00
CDX.HY-36 5-Year Index	5,000	20.06.2026	421.839	(25.132)	(0,04)
CDX.HY-37 5-Year Index	5,000	20.12.2026	151.173	(3.596)	(0,01)
CDX.HY-38 5-Year Index	5,000	20.06.2027	921.393	33.713	0,06
CDX.HY-39 5-Year Index	5,000	20.12.2027	4.926.200	165.953	0,29
CDX.IG-37 5-Year Index	1,000	20.12.2026	1.400	(15)	0,00
CDX.IG-38 5-Year Index	1,000	20.06.2027	33.800	201	0,00
CDX.IG-39 5-Year Index	1,000	20.12.2027	91.300	640	0,00
iTraxx Asia Ex-Japan 38 5-Year Index	1,000	20.12.2027	152.600	3.285	0,01
iTraxx Crossover 38 5-Year Index	5,000	20.12.2027	€ 177.250	9.229	0,01
iTraxx Europe Main 37 5-Year Index	1,000	20.06.2027	680.600	1.536	0,00
iTraxx Europe Main 38 5-Year Index	1,000	20.12.2027	234.250	3.663	0,01
				\$ 237.975	0,41

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	0,500 %	16.09.2030	£ 254.700	\$ 60.508	0,10
Zahlung	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	1,060	21.02.2052	14.400	(7.358)	(0,01)
Zahlung	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	1,096	14.02.2052	31.300	(15.743)	(0,03)
Zahlung	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	1,101	21.02.2052	14.400	(7.225)	(0,01)
Zahlung	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	1,175	28.02.2052	28.800	(13.955)	(0,02)
Erhalt ⁽⁴⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	2,000	15.03.2033	1.007.500	15.156	0,03
Erhalt ⁽⁴⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	2,000	15.03.2053	26.200	228	0,00
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000	20.09.2026	¥ 48.830.000	928	0,00
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000	15.03.2029	344.670.000	105.478	0,19
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,020	20.09.2028	395.820.000	114.326	0,20
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,176	27.04.2027	22.270.000	(2.328)	0,00
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,400	15.06.2032	52.440.000	15.742	0,03
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,500	15.03.2042	27.980.000	18.143	0,03
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,711	27.04.2042	5.840.000	3.866	0,01
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,000	15.06.2027	\$ 386.590	34.876	0,06
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,000	15.06.2029	495.770	55.097	0,10
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,250	15.06.2032	15.560	2.362	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,250	15.06.2032	635.270	(67.811)	(0,11)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,573	28.02.2027	96.300	(8.461)	(0,01)
Erhalt ⁽⁴⁾	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,600	16.01.2026	943.900	22.522	0,04
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,618	09.02.2029	27.100	(3.004)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,620	18.04.2027	153.700	(13.558)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,650	08.02.2032	91.900	(13.380)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,730	24.02.2032	86.300	(12.084)	(0,02)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2029	190.144	10.902	0,02
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2032	209.290	12.894	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2032	96.400	(8.281)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,765	16.03.2032	30.400	(4.185)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,770	14.02.2032	81.500	(11.084)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,783	22.04.2027	114.300	(9.221)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,788	03.05.2027	114.800	(9.329)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,817	05.04.2032	318.600	(42.843)	(0,06)

Zahlung/ Erhalt	variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung		1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,872 %	06.04.2032	\$ 160.000	\$ (20.742)	(0,04)
Zahlung		1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,928	25.03.2027	159.500	(11.680)	(0,02)
Erhalt		1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,000	21.12.2027	193.480	1.396	0,00
Erhalt		1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,000	21.12.2029	731.800	5.146	0,01
Erhalt		1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,000	21.12.2032	1.082.160	9.376	0,02
Zahlung		1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,185	21.04.2029	96.000	(7.735)	(0,01)
Erhalt ⁽⁴⁾		1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,300	17.01.2026	678.900	16.037	0,03
Erhalt ⁽⁴⁾		1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,350	17.01.2025	1.204.900	17.726	0,03
Zahlung		1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,370	21.06.2027	159.400	(9.050)	(0,02)
Erhalt		1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,385	08.06.2032	26.800	2.273	0,00
Erhalt		1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,430	30.09.2027	230.020	14.013	0,02
Erhalt ⁽⁴⁾		1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,450	20.12.2024	2.408.100	36.016	0,06
Erhalt		1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,450	04.10.2027	221.690	13.305	0,02
Erhalt		1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,451	08.06.2032	90.600	7.278	0,01
Zahlung		1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,605	28.06.2027	158.600	(7.198)	(0,01)
Zahlung		1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,680	11.07.2032	27.300	(1.591)	0,00
Zahlung		1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,690	11.07.2032	27.300	(1.563)	0,00
Zahlung		1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,850	30.08.2027	137.400	(4.979)	(0,01)
Zahlung		1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,880	30.09.2027	657.200	(21.619)	(0,04)
Zahlung		1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,900	04.10.2027	633.400	(20.436)	(0,04)
Zahlung		1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,955	04.10.2027	141.800	(4.259)	(0,01)
Zahlung		1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,050	07.09.2027	69.900	(1.898)	0,00
Zahlung		1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,050	08.09.2029	69.900	(2.076)	0,00
Zahlung		1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,050	06.09.2032	104.600	(3.594)	(0,01)
Zahlung		1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,100	09.09.2029	70.000	(1.865)	0,00
Erhalt		1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,350	14.12.2032	28.200	624	0,00
Erhalt		1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,610	12.12.2032	56.700	45	0,00
Erhalt		1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,750	13.12.2027	141.600	393	0,00
Zahlung		1-Year BRL-CDI	5,830	02.01.2023	BRL 1.005.200	(3.411)	(0,01)
Zahlung		1-Year BRL-CDI	5,836	02.01.2023	782.600	(2.613)	0,00
Zahlung		1-Year BRL-CDI	5,855	02.01.2023	260.500	(843)	0,00
Zahlung		1-Year BRL-CDI	11,140	02.01.2025	26.500	(164)	0,00
Zahlung		1-Year BRL-CDI	11,160	02.01.2025	17.600	(108)	0,00
Zahlung		1-Year BRL-CDI	11,220	04.01.2027	32.000	(236)	0,00
Zahlung		1-Year BRL-CDI	11,245	04.01.2027	16.100	(116)	0,00
Zahlung		1-Year BRL-CDI	11,260	04.01.2027	16.200	(116)	0,00
Zahlung		1-Year BRL-CDI	11,350	02.01.2025	21.800	(117)	0,00
Zahlung		1-Year BRL-CDI	11,700	04.01.2027	8.300	(39)	0,00
Zahlung		1-Year BRL-CDI	11,715	04.01.2027	35.900	(167)	0,00
Zahlung		1-Year BRL-CDI	11,870	04.01.2027	85.800	(327)	0,00
Zahlung		1-Year BRL-CDI	12,000	02.01.2025	59.500	(170)	0,00
Zahlung		1-Year BRL-CDI	12,080	02.01.2025	98.900	(252)	0,00
Zahlung		1-Year BRL-CDI	12,140	02.01.2025	49.800	(116)	0,00
Zahlung		1-Year BRL-CDI	12,145	02.01.2025	48.800	(113)	0,00
Zahlung		1-Year BRL-CDI	12,160	02.01.2025	99.600	(224)	0,00
Erhalt		1-Year BRL-CDI	12,670	02.01.2023	80.300	49	0,00
Erhalt		1-Year BRL-CDI	12,690	02.01.2023	53.400	31	0,00
Erhalt		1-Year BRL-CDI	12,740	02.01.2023	138.300	69	0,00
Erhalt		1-Year BRL-CDI	12,750	02.01.2023	66.300	33	0,00
Erhalt		1-Year BRL-CDI	12,760	02.01.2023	138.000	65	0,00
Erhalt		1-Year BRL-CDI	12,900	02.01.2023	282.400	73	0,00
Erhalt		1-Year BRL-CDI	12,930	02.01.2023	35.000	9	0,00
Erhalt		1-Year BRL-CDI	12,939	02.01.2023	141.200	29	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Income Fund (Forts.)

Zahlung/ Erhalt	variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
Erhalt		1-Year BRL-CDI	12,946 %	02.01.2023	BRL	354.500	\$ 74	0,00
Erhalt		1-Year BRL-CDI	12,960	02.01.2023		282.400	51	0,00
Erhalt		1-Year BRL-CDI	12,970	02.01.2023		464.100	86	0,00
Erhalt		3-Month CAD-Bank Bill	1,000	16.06.2047	CAD	2.600	705	0,00
Erhalt		3-Month CAD-Bank Bill	1,300	16.06.2047		2.500	651	0,00
Zahlung		3-Month CAD-Bank Bill	3,400	20.06.2029		6.300	(649)	0,00
Erhalt		3-Month USD-LIBOR	0,250	30.03.2023	\$	492.700	5.572	0,01
Zahlung		3-Month USD-LIBOR	0,500	16.06.2026		1.090.500	(99.208)	(0,17)
Zahlung		3-Month USD-LIBOR	0,500	16.06.2028		2.503.737	(288.896)	(0,50)
Erhalt		3-Month USD-LIBOR	0,550	15.01.2031		4.567.800	1.059.739	1,83
Erhalt		3-Month USD-LIBOR	0,674	05.08.2030		62.900	13.938	0,02
Erhalt		3-Month USD-LIBOR	0,678	29.07.2030		65.200	14.407	0,02
Erhalt		3-Month USD-LIBOR	0,711	28.07.2030		69.000	15.113	0,03
Erhalt		3-Month USD-LIBOR	0,715	27.07.2030		200.000	43.773	0,08
Erhalt		3-Month USD-LIBOR	0,750	30.03.2031		963.600	204.050	0,35
Zahlung		3-Month USD-LIBOR	0,750	16.06.2031		3.358.883	(438.769)	(0,76)
Erhalt		3-Month USD-LIBOR	0,800	15.01.2051		1.479.300	737.317	1,27
Erhalt		3-Month USD-LIBOR	0,928	06.05.2026		150.100	16.438	0,03
Erhalt		3-Month USD-LIBOR	0,975	17.06.2052		52.200	18.824	0,03
Erhalt		3-Month USD-LIBOR	0,990	24.06.2052		75.000	26.694	0,05
Zahlung		3-Month USD-LIBOR	1,000	26.01.2024		154.700	(6.928)	(0,01)
Erhalt		3-Month USD-LIBOR	1,000	16.12.2030		120.615	23.304	0,04
Erhalt		3-Month USD-LIBOR	1,035	28.06.2052		25.900	8.991	0,02
Zahlung		3-Month USD-LIBOR	1,144	04.11.2050		49.600	(20.482)	(0,04)
Erhalt		3-Month USD-LIBOR	1,150	30.03.2051		191.500	37.175	0,06
Zahlung		3-Month USD-LIBOR	1,215	13.10.2050		83.500	(34.325)	(0,06)
Erhalt		3-Month USD-LIBOR	1,235	12.05.2028		75.400	10.460	0,02
Zahlung		3-Month USD-LIBOR	1,250	15.12.2026		1.654.500	(196.391)	(0,34)
Erhalt		3-Month USD-LIBOR	1,250	16.06.2051		1.456.600	323.472	0,56
Zahlung		3-Month USD-LIBOR	1,270	04.11.2023		7.957.500	(249.852)	(0,43)
Zahlung		3-Month USD-LIBOR	1,280	24.03.2028		423.400	(52.067)	(0,09)
Erhalt		3-Month USD-LIBOR	1,306	02.11.2051		48.000	16.099	0,03
Zahlung		3-Month USD-LIBOR	1,317	16.12.2050		33.800	(12.813)	(0,02)
Erhalt		3-Month USD-LIBOR	1,350	20.01.2027		109.100	11.467	0,02
Erhalt		3-Month USD-LIBOR	1,360	15.02.2027		387.430	40.573	0,07
Erhalt		3-Month USD-LIBOR	1,360	20.07.2031		91.400	16.986	0,03
Erhalt		3-Month USD-LIBOR	1,370	19.07.2031		61.300	11.348	0,02
Zahlung		3-Month USD-LIBOR	1,380	04.01.2027		212.800	(21.532)	(0,04)
Erhalt		3-Month USD-LIBOR	1,405	07.09.2031		154.300	28.424	0,05
Zahlung		3-Month USD-LIBOR	1,418	20.01.2027		71.900	(7.239)	(0,01)
Erhalt		3-Month USD-LIBOR	1,420	24.02.2027		269.100	27.450	0,05
Zahlung		3-Month USD-LIBOR	1,425	18.01.2027		146.000	(14.522)	(0,02)
Zahlung		3-Month USD-LIBOR	1,443	18.01.2027		157.300	(15.523)	(0,03)
Erhalt		3-Month USD-LIBOR	1,450	17.02.2027		361.600	36.496	0,06
Erhalt		3-Month USD-LIBOR	1,450	16.07.2031		137.000	24.750	0,04
Zahlung		3-Month USD-LIBOR	1,485	13.01.2051		78.100	(28.270)	(0,05)
Zahlung		3-Month USD-LIBOR	1,500	15.12.2028		473.684	(71.590)	(0,12)
Erhalt		3-Month USD-LIBOR	1,500	12.01.2029		85.443	11.295	0,02
Zahlung		3-Month USD-LIBOR	1,500	05.10.2031		89.100	(15.787)	(0,03)
Zahlung		3-Month USD-LIBOR	1,518	20.01.2029		43.100	(5.578)	(0,01)
Zahlung		3-Month USD-LIBOR	1,535	15.10.2031		88.600	(15.517)	(0,03)
Zahlung		3-Month USD-LIBOR	1,535	22.10.2031		59.100	(10.342)	(0,02)
Zahlung		3-Month USD-LIBOR	1,545	26.10.2031		58.900	(10.274)	(0,02)
Zahlung		3-Month USD-LIBOR	1,550	20.01.2027		485.100	(45.292)	(0,08)
Zahlung		3-Month USD-LIBOR	1,570	11.01.2027		121.400	(11.340)	(0,02)
Zahlung		3-Month USD-LIBOR	1,570	12.01.2027		76.200	(7.123)	(0,01)
Zahlung		3-Month USD-LIBOR	1,580	16.02.2027		150.400	(13.973)	(0,02)
Zahlung		3-Month USD-LIBOR	1,595	13.01.2051		82.600	(28.145)	(0,05)
Zahlung		3-Month USD-LIBOR	1,600	15.02.2027		1.549.700	(141.592)	(0,24)
Zahlung		3-Month USD-LIBOR	1,630	20.01.2029		60.000	(7.375)	(0,01)
Zahlung		3-Month USD-LIBOR	1,630	26.01.2029		72.000	(8.823)	(0,02)
Zahlung		3-Month USD-LIBOR	1,650	24.02.2027		897.000	(79.753)	(0,14)
Zahlung		3-Month USD-LIBOR	1,655	24.01.2032		72.000	(11.893)	(0,02)
Zahlung ⁽⁴⁾		3-Month USD-LIBOR	1,700	06.03.2024		344.400	(10.961)	(0,02)
Zahlung		3-Month USD-LIBOR	1,700	17.02.2027		1.446.200	(125.600)	(0,22)
Zahlung		3-Month USD-LIBOR	1,700	12.01.2029		310.700	(36.276)	(0,06)
Zahlung		3-Month USD-LIBOR	1,735	12.01.2032		57.800	(9.146)	(0,02)
Erhalt		3-Month USD-LIBOR	1,785	12.08.2051		76.100	25.033	0,04
Zahlung		3-Month USD-LIBOR	1,815	24.01.2052		14.400	(4.368)	(0,01)
Zahlung		3-Month USD-LIBOR	1,867	26.01.2052		14.400	(4.214)	(0,01)
Erhalt		3-Month USD-LIBOR	1,945	23.06.2051		127.800	37.654	0,06
Erhalt		3-Month USD-LIBOR	1,988	09.02.2032		22.000	2.969	0,01
Zahlung		3-Month USD-LIBOR	2,000	18.02.2032		133.700	(17.832)	(0,03)
Erhalt		3-Month USD-LIBOR	2,000	15.12.2051		324.000	103.566	0,18
Erhalt		3-Month USD-LIBOR	2,008	09.02.2032		36.700	4.970	0,01
Erhalt		3-Month ZAR-JIBAR	7,710	23.11.2025	ZAR	657.100	112	0,00
Zahlung		3-Month ZAR-JIBAR	7,750	19.09.2028		937.900	(1.782)	0,00
Zahlung		6-Month AUD-BBR-BBSW	2,750	17.06.2026	AUD	72.880	(2.001)	0,00
Zahlung		6-Month AUD-BBR-BBSW	3,000	21.03.2027		1.179.040	(54.398)	(0,09)
Zahlung		6-Month AUD-BBR-BBSW	3,250	17.12.2024		197.200	(8.404)	(0,01)
Zahlung		6-Month AUD-BBR-BBSW	3,500	17.06.2025		361.600	(19.931)	(0,03)

Zahlung/ Erhalt	variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung		6-Month AUD-BBR-BBSW	4,250 %	17.12.2024	AUD 97.200	\$ (8.151)	(0,01)
Zahlung		6-Month AUD-BBR-BBSW	4,750	18.06.2024		(12.608)	(0,02)
Erhalt		6-Month EUR-EURIBOR	0,150	18.03.2030	€ 907.700	199.536	0,34
Erhalt		6-Month EUR-EURIBOR	0,150	17.06.2030	244.000	54.348	0,09
Erhalt		6-Month EUR-EURIBOR	0,294	30.06.2026	6.200	785	0,00
Erhalt		6-Month EUR-EURIBOR	0,329	30.12.2025	13.200	1.453	0,00
Erhalt		6-Month EUR-EURIBOR	0,363	30.06.2025	20.500	1.973	0,00
Erhalt		6-Month EUR-EURIBOR	0,395	30.12.2024	10.800	840	0,00
Erhalt		6-Month EUR-EURIBOR	0,425	28.06.2024	24.600	1.514	0,00
Erhalt		6-Month EUR-EURIBOR	0,453	29.12.2023	25.200	978	0,00
Erhalt		6-Month EUR-EURIBOR	0,500	17.06.2050	126.900	58.030	0,10
Zahlung		6-Month EUR-EURIBOR	0,650	12.04.2027	331.900	(34.037)	(0,06)
Zahlung		6-Month EUR-EURIBOR	0,700	11.04.2027	113.000	(11.336)	(0,02)
Erhalt ⁽⁴⁾		6-Month EUR-EURIBOR	0,830	09.12.2052	876.100	25.922	0,04
Zahlung		6-Month EUR-EURIBOR	1,000	13.05.2027	243.100	(21.496)	(0,04)
Zahlung		6-Month EUR-EURIBOR	1,000	18.05.2027	116.300	(10.275)	(0,02)
Zahlung ⁽⁴⁾		6-Month EUR-EURIBOR	1,500	15.03.2053	300	(32)	0,00
Zahlung		6-Month EUR-EURIBOR	1,750	21.09.2027	355.500	(23.537)	(0,04)
Erhalt ⁽⁴⁾		6-Month EUR-EURIBOR	1,750	15.03.2033	857.400	37.741	0,07
Erhalt		6-Month EUR-EURIBOR	2,000	17.09.2024	149.000	21.681	0,04
Zahlung		6-Month EUR-EURIBOR	2,000	21.09.2032	1.052.480	(125.280)	(0,22)
Zahlung		28-Day MXN-TIE	7,165	06.09.2032	MXN 266.600	(1.402)	0,00
Zahlung		28-Day MXN-TIE	7,360	21.08.2037	285.500	(1.217)	0,00
Erhalt		28-Day MXN-TIE	7,380	14.08.2037	111.200	231	0,00
Zahlung		28-Day MXN-TIE	7,480	18.06.2037	337.300	(1.878)	0,00
Zahlung		28-Day MXN-TIE	7,495	14.01.2032	2.373.500	(9.287)	(0,02)
Zahlung		28-Day MXN-TIE	7,498	15.01.2032	5.192.600	(20.259)	(0,03)
Zahlung		28-Day MXN-TIE	7,498	19.06.2037	810.000	(4.473)	(0,01)
Erhalt		28-Day MXN-TIE	8,103	04.01.2038	3.750.800	8.248	0,01
Zahlung		28-Day MXN-TIE	8,280	28.11.2036	690.000	(5.051)	(0,01)
Zahlung		28-Day MXN-TIE	8,310	28.11.2036	1.066.400	(7.958)	(0,01)
Erhalt		28-Day MXN-TIE	8,410	31.03.2027	1.182.800	1.043	0,00
Erhalt		28-Day MXN-TIE	8,660	04.04.2024	2.723.700	3.405	0,01
Erhalt		28-Day MXN-TIE	8,675	03.04.2024	9.876.200	12.270	0,02
Erhalt		28-Day MXN-TIE	8,701	31.03.2032	905.900	94	0,00
Erhalt		28-Day MXN-TIE	8,730	06.04.2027	787.600	231	0,00
Erhalt		28-Day MXN-TIE	8,732	30.03.2032	394.000	3	0,00
Erhalt		28-Day MXN-TIE	8,750	05.04.2024	1.956.500	2.331	0,00
Zahlung		UKRPI	4,000	15.09.2031	£ 53.800	(7.686)	(0,01)
Zahlung		UKRPI	4,020	15.10.2031	69.900	(9.501)	(0,02)
Zahlung		UKRPI	4,055	15.09.2031	49.800	(7.022)	(0,01)
Zahlung		UKRPI	4,066	15.09.2031	96.800	(11.926)	(0,02)
Zahlung		UKRPI	4,140	15.10.2031	135.400	(16.468)	(0,03)
Zahlung		UKRPI	4,250	15.11.2031	135.600	(13.052)	(0,02)
Zahlung		UKRPI	4,400	15.10.2031	60.700	(6.090)	(0,01)
						\$ 973.632	1,68
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate						\$ 1.214.204	2,09

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

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

⁽³⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definieren.

⁽⁴⁾ Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

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

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

OPTIONSKAUF

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
FAR	Call – OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,243 %	05.08.2024	291.100	\$ 3.930	\$ 1.652	0,00
	Put – OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,243	05.08.2024	291.100	3.930	7.230	0,01
GLM	Call – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,110	26.07.2032	59.200	9.590	7.639	0,01
	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,110	26.07.2032	85.900	13.916	17.711	0,03
MYC	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,053	20.07.2023	869.400	5.216	346	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,053	20.07.2023	869.400	5.216	12.868	0,02

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Income Fund (Forts.)

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,620 %	22.07.2024	869.400	\$ 6.520	\$ 3.070	0,01
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,620	22.07.2024	869.400	6.521	9.724	0,02
	Call – OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,590	19.07.2024	616.200	8.473	4.518	0,01
	Put – OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,590	19.07.2024	616.200	8.473	12.658	0,02
	Call – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,400	20.07.2027	68.100	8.986	6.585	0,01
	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,400	20.07.2027	76.800	10.134	14.020	0,02
	Call – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,170	19.07.2032	68.100	10.801	8.948	0,02
	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,170	19.07.2032	76.800	12.180	15.376	0,03
							\$ 113.886	\$ 122.345	0,21

VERKAUFSOPTIONEN

CREDIT DEFAULT SWAPPTIONS AUF KREDITINDIZES

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/ -verkauf	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
GST	Put – OTC iTraxx Europe 37 5-Year Index	Verkauf	3,000 %	15.03.2023	77.600	\$ (137)	\$ (15)	0,00

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
BOA	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,150 %	01.12.2023	158.300	\$ (491)	\$ (113)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	01.12.2023	158.300	(491)	(1.198)	0,00
	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,000	19.01.2023	50.900	(220)	(20)	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,500	19.01.2023	50.900	(220)	(616)	0,00
BPS	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,550	11.04.2023	72.300	(73)	0	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,100	11.04.2023	72.300	(221)	(1.124)	0,00
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,700	28.04.2023	184.500	(320)	0	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,250	28.04.2023	184.500	(320)	(2.618)	(0,01)
	Call – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,150	09.01.2023	103.000	(363)	(1)	0,00
	Put – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	09.01.2023	103.000	(363)	(620)	0,00
	Call – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,270	23.01.2023	48.200	(121)	(30)	0,00
	Put – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,770	23.01.2023	48.200	(121)	(246)	0,00
BRC	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,000	19.01.2023	50.900	(217)	(20)	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,500	19.01.2023	50.900	(218)	(616)	0,00
	Call – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,200	12.01.2023	77.400	(238)	(9)	0,00
	Put – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,800	12.01.2023	77.400	(238)	(260)	0,00
CBK	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,690	02.04.2024	41.500	(326)	(123)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,690	02.04.2024	41.500	(326)	(521)	0,00
	Call – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,150	09.01.2023	106.100	(374)	(1)	0,00
	Put – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	09.01.2023	106.100	(374)	(639)	0,00
GLM	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,765	25.07.2023	377.400	(2.359)	(168)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,765	25.07.2023	377.400	(2.359)	(6.614)	(0,01)
	Call – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,468	25.07.2023	79.800	(1.907)	(345)	0,00
	Put – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,468	25.07.2023	79.800	(1.907)	(4.180)	(0,01)
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,920	13.10.2023	96.700	(595)	(98)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,920	13.10.2023	96.700	(595)	(1.328)	0,00
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,018	20.10.2023	77.900	(504)	(96)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,018	20.10.2023	77.900	(504)	(996)	0,00
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,140	23.10.2023	77.500	(544)	(111)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,140	23.10.2023	77.500	(544)	(915)	0,00
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,190	23.10.2023	77.500	(539)	(118)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,190	23.10.2023	77.500	(539)	(885)	0,00
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,225	23.10.2023	77.500	(538)	(122)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,225	23.10.2023	77.500	(538)	(864)	0,00
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,973	25.10.2023	77.700	(534)	(94)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,973	25.10.2023	77.700	(534)	(1.017)	0,00
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,841	27.10.2023	77.400	(530)	(83)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,841	27.10.2023	77.400	(530)	(1.086)	0,00
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,088	03.11.2023	77.800	(564)	(118)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,088	03.11.2023	77.800	(564)	(928)	0,00
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,910	10.11.2023	78.600	(522)	(105)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,910	10.11.2023	78.600	(522)	(1.034)	0,00
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,250	17.11.2023	155.600	(564)	(108)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	17.11.2023	155.600	(564)	(1.112)	0,00
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,150	20.11.2023	155.600	(543)	(98)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	20.11.2023	155.600	(543)	(1.206)	0,00
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,250	07.12.2023	159.200	(497)	(134)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	07.12.2023	159.200	(497)	(1.100)	0,00
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,697	02.04.2024	249.100	(1.954)	(744)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,697	02.04.2024	249.100	(1.954)	(3.115)	(0,01)
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,721	08.04.2024	80.600	(608)	(250)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,721	08.04.2024	80.600	(608)	(986)	0,00

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,550 %	05.04.2023	197.900	\$ (368)	\$ 0	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,100	05.04.2023	197.900	(368)	(3.055)	(0,01)
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,550	11.04.2023	335.500	(646)	0	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,100	11.04.2023	335.500	(646)	(5.215)	(0,01)
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,700	24.04.2023	200.100	(216)	0	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,250	24.04.2023	200.100	(565)	(2.822)	(0,01)
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,700	26.04.2023	184.600	(325)	0	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,250	26.04.2023	184.600	(325)	(2.615)	(0,01)
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,550	15.05.2023	183.200	(322)	0	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,100	15.05.2023	183.200	(322)	(2.909)	(0,01)
	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,547	07.03.2023	127.800	(2.809)	(287)	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,547	07.03.2023	127.800	(2.809)	(8.048)	(0,01)
	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,067	09.06.2023	168.300	(1.972)	(430)	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	3,140	09.06.2023	168.300	(2.324)	(5.506)	(0,01)
	Call – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,230	23.01.2023	141.900	(351)	(70)	0,00
	Put – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,730	23.01.2023	141.900	(351)	(842)	0,00
JPM	Call – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,200	12.01.2023	77.400	(240)	(9)	0,00
	Put – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,800	12.01.2023	77.400	(240)	(260)	0,00
MYC	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,050	19.07.2023	377.000	(2.262)	(206)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,050	19.07.2023	377.000	(2.262)	(5.689)	(0,01)
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,052	20.07.2023	376.700	(2.317)	(213)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,052	20.07.2023	376.700	(2.317)	(5.640)	(0,01)
	Call – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,700	19.07.2023	79.700	(1.857)	(458)	0,00
	Put – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,700	19.07.2023	79.700	(1.857)	(3.492)	(0,01)
	Call – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,675	20.07.2023	81.100	(1.885)	(455)	0,00
	Put – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,675	20.07.2023	81.100	(1.885)	(3.621)	(0,01)
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,993	11.10.2023	82.900	(560)	(110)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,993	11.10.2023	82.900	(560)	(1.122)	0,00
	Call – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,550	19.07.2023	20.300	(1.464)	(465)	0,00
	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,550	19.07.2023	20.300	(1.464)	(2.710)	(0,01)
	Call – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,537	20.07.2023	20.300	(1.478)	(458)	0,00
	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,537	20.07.2023	20.300	(1.478)	(2.748)	(0,01)
							\$ (71.084)	\$ (98.388)	(0,17)

ZINSCAPS

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens	
FAR	Call – OTC 2-Year Interest Rate Floor ⁽²⁾	2-Year USD-LIBOR	0,022 %	08.08.2026	291.100	\$ (5.021)	\$ (8.275)	(0,01)	
	Put – OTC 2-Year Interest Rate Floor ⁽²⁾	2-Year USD-LIBOR	0,022	08.08.2026	291.100	(5.021)	(2.736)	0,00	
MYC	Call – OTC 1-Year Interest Rate Floor ⁽²⁾	1-Year USD-LIBOR	0,030	24.07.2024	869.400	(6.506)	(13.586)	(0,02)	
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Floor ⁽²⁾	1-Year USD-LIBOR	0,030	24.07.2024	869.400	(6.506)	(1.186)	0,00	
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Floor ⁽²⁾	1-Year USD-LIBOR	0,026	23.07.2025	869.400	(7.615)	(10.774)	(0,02)	
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Floor ⁽²⁾	1-Year USD-LIBOR	0,026	23.07.2025	869.400	(7.615)	(4.188)	(0,01)	
	Call – OTC 2-Year Interest Rate Floor ⁽²⁾	2-Year USD-LIBOR	0,026	23.07.2026	616.200	(10.898)	(15.199)	(0,03)	
	Put – OTC 2-Year Interest Rate Floor ⁽²⁾	2-Year USD-LIBOR	0,026	23.07.2026	616.200	(10.897)	(6.963)	(0,01)	
							\$ (60.079)	\$ (62.907)	(0,10)

OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens		
BOA	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.01.2053	\$ 101,891	05.01.2023	38.600	\$ (115)	\$ 0	0,00		
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.02.2053	99,813	06.02.2023	11.900	(80)	(75)	0,00		
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.02.2053	100,000	06.02.2023	9.000	(60)	(63)	0,00		
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.02.2053	101,813	06.02.2023	11.900	(73)	(25)	0,00		
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.02.2053	102,000	06.02.2023	9.000	(55)	(16)	0,00		
JPM	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.03.2053	97,000	06.03.2023	30.300	(260)	(466)	0,00		
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.03.2053	97,156	06.03.2023	30.300	(260)	(491)	0,00		
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.03.2053	99,000	06.03.2023	30.300	(223)	(77)	0,00		
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.03.2053	99,156	06.03.2023	30.300	(220)	(68)	0,00		
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fällig am 01.03.2053	98,766	06.03.2023	29.500	(249)	(403)	0,00		
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fällig am 01.03.2053	100,766	06.03.2023	29.500	(212)	(97)	0,00		
SAL	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fällig am 01.03.2053	97,578	06.03.2023	15.600	(124)	(146)	0,00		
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fällig am 01.03.2053	99,578	06.03.2023	15.600	(112)	(114)	0,00		
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.01.2053	101,859	05.01.2023	48.400	(144)	0	0,00		
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.01.2053	102,250	05.01.2023	53.100	(158)	0	0,00		
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.02.2053	99,750	06.02.2023	92.600	(661)	(561)	(0,01)		
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.02.2053	100,000	06.02.2023	27.200	(187)	(190)	0,00		
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.02.2053	101,750	06.02.2023	92.600	(531)	(212)	0,00		
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.02.2053	102,000	06.02.2023	27.200	(162)	(48)	0,00		
							\$ (3.886)	\$ (3.052)	(0,01)

⁽¹⁾ Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.⁽²⁾ Das zugrunde liegende Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Income Fund (Forts.)

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZKAUF⁽¹⁾

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽³⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	HSBC Holdings PLC	(1,000) %	20.06.2024	€ 1.300	\$ 22	\$ (28)	\$ (6)	0,00
	UBS AG	(1,000)	20.06.2024	\$ 19.300	1.254	(1.317)	(63)	0,00
BPS	UBS AG	(1,000)	20.06.2024	7.000	458	(481)	(23)	0,00
					\$ 1.734	\$ (1.826)	\$ (92)	0,00

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽²⁾

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽³⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	South Africa Government International Bond	1,000 %	20.12.2026	\$ 5.500	\$ (241)	\$ 28	\$ (213)	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.12.2023	60.500	(4.393)	2.961	(1.432)	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.06.2024	10.800	(998)	542	(456)	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.12.2024	23.000	(2.501)	1.126	(1.375)	0,00
BPS	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2027	14.700	(705)	(170)	(875)	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2027	2.900	(259)	49	(210)	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.12.2023	17.900	(1.564)	1.140	(424)	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.12.2024	4.000	(287)	48	(239)	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.06.2025	1.300	(223)	122	(101)	0,00
BRC	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2023	8.750	(538)	558	20	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.06.2024	7.070	(658)	360	(298)	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.12.2024	84.600	(11.485)	6.428	(5.057)	(0,01)
BYL	Turkey Government International Bond	1,000	20.12.2023	22.450	(1.502)	971	(531)	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.12.2024	15.260	(1.322)	410	(912)	0,00
CBK	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2024	168.400	(2.908)	2.418	(490)	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2024	10.000	(102)	49	(53)	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2024	29.600	116	(392)	(276)	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2026	42.900	(1.989)	16	(1.973)	(0,01)
	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2027	10.600	(381)	(250)	(631)	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2024	52.400	(847)	1.173	326	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2026	31.000	(203)	252	49	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.06.2024	12.600	(1.154)	622	(532)	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.12.2024	4.700	(490)	209	(281)	0,00
GST	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2024	13.700	(441)	436	(5)	0,00
	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2024	176.800	(2.751)	2.237	(514)	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2023	32.600	(488)	452	(36)	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2027	17.600	(687)	(361)	(1.048)	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2027	8.200	(731)	136	(595)	0,00
	Equinix, Inc.	5,000	20.06.2027	9.000	1.258	(19)	1.239	0,00
	Indonesia Government International Bond	1,000	20.12.2027	24.600	(477)	486	9	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2023	17.650	(156)	217	61	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2024	60.300	(502)	932	430	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2027	38.200	(1.602)	1.100	(502)	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2023	8.700	(449)	464	15	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2025	10.200	(565)	368	(197)	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2026	4.800	(215)	29	(186)	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.06.2024	37.500	(3.786)	2.203	(1.583)	(0,01)
	Turkey Government International Bond	1,000	20.12.2024	58.600	(6.583)	3.080	(3.503)	(0,01)
HUS	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2023	30.100	(953)	1.020	67	0,00
	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2024	255.100	(7.463)	7.364	(99)	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2024	32.400	(94)	(78)	(172)	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2023	261.150	(4.180)	5.563	1.383	0,00
JPM	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2026	2.200	(101)	0	(101)	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2027	3.500	(135)	(73)	(208)	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2026	33.200	(259)	311	52	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2023	37.600	(2.111)	2.177	66	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.12.2023	2.200	(151)	99	(52)	0,00
MBC	Turkey Government International Bond	1,000	20.12.2024	6.200	(676)	305	(371)	0,00
MYC	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2027	21.700	(781)	(511)	(1.292)	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2027	24.900	(2.220)	413	(1.807)	(0,01)
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2024	47.400	(418)	756	338	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2025	5.300	(73)	97	24	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2026	56.100	(326)	414	88	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2026	44.400	68	(130)	(62)	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2027	40.600	(137)	(161)	(298)	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2027	82.700	(2.870)	1.784	(1.086)	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2026	124.200	(5.441)	631	(4.810)	(0,01)
	Turkey Government International Bond	1,000	20.12.2023	12.500	(1.123)	827	(296)	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.06.2024	17.500	(1.945)	1.206	(739)	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.12.2024	4.600	(518)	243	(275)	0,00
					\$ (84.716)	\$ 52.687	\$ (32.029)	(0,06)

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF⁽²⁾

Kontrahent	Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽³⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	ABX.HE.AA.6-1 Index	0,320 %	25.07.2045	\$ 762	\$ (263)	\$ 204	\$ (59)	0,00
	ABX.HE.AAA.6-2 Index	0,110	25.05.2046	33.582	(8.426)	8.094	(332)	0,00

Kontrahent	Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽¹⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BRC	CMBX.NA.AS.6 Index	1,000 %	11.05.2063	\$ 232	\$ (1)	\$ 1	\$ 0	0,00
	ABX.HE.AAA.6-2 Index	0,110	25.05.2046	2.641	(661)	635	(26)	0,00
	CMBX.NA.AAA.13 Index	0,500	16.12.2072	100.000	(1.840)	582	(1.258)	0,00
	CMBX.NA.AS.6 Index	1,000	11.05.2063	1.598	(54)	54	0	0,00
CBK	PRIMEX.ARM.2-AAA Index	4,580	25.12.2037	213	9	(6)	3	0,00
	CDX.HY-33 5-Year Index 35-100 %	5,000	20.12.2024	57.942	9.647	(4.415)	5.232	0,01
DUB	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	233.645	(4.705)	4.184	(521)	0,00
FBF	CMBX.NA.AAA.11 Index	0,500	18.11.2054	688.600	(4.427)	1.165	(3.262)	(0,01)
	CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17.08.2061	162.200	(1.133)	(162)	(1.295)	0,00
GST	ABX.HE.AAA.6-2 Index	0,110	25.05.2046	867	(205)	196	(9)	0,00
	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	1.176.350	(15.149)	12.528	(2.621)	(0,01)
	CMBX.NA.AAA.11 Index	0,500	18.11.2054	735.600	4.507	(7.992)	(3.485)	(0,01)
	CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17.08.2061	436.500	(12.201)	8.715	(3.486)	(0,01)
JPS	CMBX.NA.AAA.13 Index	0,500	16.12.2072	86.300	(1.494)	408	(1.086)	0,00
	CMBX.NA.AAA.15 Index	0,500	18.11.2064	37.200	(315)	(564)	(879)	0,00
	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	171.400	(2.957)	2.575	(382)	0,00
	CMBX.NA.AAA.11 Index	0,500	18.11.2054	171.700	(1.351)	538	(813)	0,00
	CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17.08.2061	45.500	(336)	(27)	(363)	0,00
MYC	CDX.HY-33 5-Year Index 35-100 %	5,000	20.12.2024	117.250	19.539	(8.951)	10.588	0,02
	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	66.700	(1.419)	1.270	(149)	0,00
	CMBX.NA.AAA.11 Index	0,500	18.11.2054	364.800	(3.092)	1.364	(1.728)	0,00
	CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17.08.2061	923.900	(14.119)	6.741	(7.378)	(0,01)
	CMBX.NA.AAA.13 Index	0,500	16.12.2072	379.100	507	(5.277)	(4.770)	(0,01)
	CMBX.NA.AAA.14 Index	0,500	16.12.2072	171.300	(4.147)	1.190	(2.957)	(0,01)
	CMBX.NA.AAA.15 Index	0,500	18.11.2064	74.400	(631)	(1.127)	(1.758)	0,00
	CMBX.NA.AS.6 Index	1,000	11.05.2063	139	(4)	4	0	0,00
	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	810.495	(7.907)	6.101	(1.806)	0,00
	CMBX.NA.AAA.11 Index	0,500	18.11.2054	152.400	(785)	63	(722)	0,00
SAL	CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17.08.2061	1.386.500	(13.794)	2.722	(11.072)	(0,02)
	CMBX.NA.AAA.13 Index	0,500	16.12.2072	88.800	0	(1.117)	(1.117)	0,00
	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	15.500	(445)	410	(35)	0,00
					\$ (67.652)	\$ 30.106	\$ (37.546)	(0,06)

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

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

⁽³⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert.

TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES

Kontrahent	Zahlung/Erhalt	Wertpapier	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Variabler Zinssatz	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	Erhalt	iBoxx USD Liquid High Yield Index	k. A.	1,059 %	\$ 2.100	20.03.2023	\$ (3)	\$ 83	\$ 80	0,00
GST	Erhalt	iBoxx USD Liquid High Yield Index	k. A.	1,058	39.500	20.06.2023	(305)	(430)	(735)	0,00
							\$ (308)	\$ (347)	\$ (655)	0,00

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens	
BOA	01.2023	CHF	2.340	\$ 2.489	\$ 0	\$ (42)	0,00	
	01.2023	€	1.409	1.486	0	(18)	0,00	
	01.2023	£	650	782	0	0	0,00	
	01.2023	¥	847.000	6.171	0	(254)	0,00	
	01.2023	\$	703.480	AUD 1.038.688	1.079	0	1.079	0,00
	01.2023		1.642	€ 1.551	14	0	14	0,00
	01.2023		80.262	£ 65.992	0	(869)	(869)	0,00
	01.2023		18.006	¥ 2.374.400	2	(1)	1	0,00
	01.2023		32.020	KRW 41.798.908	1.204	0	1.204	0,00
	01.2023		4.564	PEN 17.525	22	0	22	0,00
	02.2023	¥	121.200.000	\$ 865.356	0	(58.976)	(58.976)	(0,10)
	02.2023	\$	119.776	NOK 1.188.796	1.114	0	1.114	0,00
	02.2023	ZAR	47.553	\$ 2.653	0	(131)	(131)	0,00
	03.2023	¥	153.000	1.121	0	(48)	(48)	0,00
	03.2023	TWD	1.367.745	46.454	1.625	0	1.625	0,00
	03.2023	\$	29	IDR 455.111	0	0	0	0,00
	03.2023	ZAR	244.817	\$ 13.865	0	(440)	(440)	0,00
05.2023	PEN	68.686	17.573	0	(230)	(230)	0,00	
BOM	01.2023	\$	183.983	CAD 247.052	0	(1.644)	(1.644)	0,00
BPS	01.2023	AUD	6	\$ 4	0	0	0	0,00
	01.2023	BRL	337.287	64.085	202	0	202	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Income Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
	01.2023	CNH	\$ 3	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00	
	01.2023	ILS	430	126	3	3	0,00	
	01.2023	\$	22.511	€ 21.114	32	32	0,00	
	01.2023		9.566	£ 7.926	0	(30)	0,00	
	01.2023		17.796	ILS 57.408	0	(1.526)	0,00	
	01.2023		548.117	KRW 714.634.849	19.918	0	19.918	0,03
	01.2023		238.331	NZD 372.508	0	(2.723)	(2.723)	(0,01)
	01.2023		56.289	ZAR 978.178	1.126	0	1.126	0,00
	02.2023		50.554	IDR 794.962.417	851	0	851	0,00
	02.2023	ZAR	678.005	\$ 37.771	0	(1.940)	(1.940)	0,00
	03.2023	INR	88.429	1.066	3	0	3	0,00
	03.2023	TWD	53.559	1.776	21	0	21	0,00
	03.2023	\$	36.192	CLP 34.512.636	3.892	0	3.892	0,01
	03.2023		16.350	MXN 329.523	327	0	327	0,00
	03.2023		9.182	PEN 35.404	47	0	47	0,00
	04.2023		48.467	CLP 43.472.673	1.848	0	1.848	0,00
	09.2023		528	ZAR 9.322	9	0	9	0,00
BRC	01.2023	CNH	9.049	\$ 1.298	0	(12)	(12)	0,00
	01.2023	€	2.060	2.190	0	(10)	(10)	0,00
	01.2023	¥	10.300.000	73.011	0	(5.062)	(5.062)	(0,01)
	01.2023	PEN	126.465	32.367	0	(766)	(766)	0,00
	01.2023	\$	5.499	€ 5.140	0	(11)	(11)	0,00
	01.2023		26.021	£ 21.323	0	(368)	(368)	0,00
	01.2023		12.354	PEN 47.591	98	0	98	0,00
	01.2023		434	SGD 585	2	0	2	0,00
	02.2023		20.662	PEN 79.880	212	0	212	0,00
	03.2023	¥	37.377.000	\$ 278.273	0	(7.870)	(7.870)	(0,01)
	03.2023	\$	48	IDR 749.896	1	0	1	0,00
CBK	01.2023	AUD	17.995	\$ 12.094	0	(112)	(112)	0,00
	01.2023	CHF	21.764	23.042	0	(497)	(497)	0,00
	01.2023	CLP	11.560.210	13.291	0	(259)	(259)	0,00
	01.2023	€	2.928.969	3.036.743	0	(90.535)	(90.535)	(0,16)
	01.2023	ILS	87.391	27.696	2.928	0	2.928	0,01
	01.2023	PEN	115.522	28.784	0	(1.443)	(1.443)	0,00
	01.2023	\$	84.132	AUD 124.065	49	(25)	24	0,00
	01.2023		45.319	€ 42.622	189	0	189	0,00
	01.2023		8.549	¥ 1.137.000	74	0	74	0,00
	01.2023		22.156	NZD 34.653	0	(238)	(238)	0,00
	01.2023		479	PEN 1.841	4	0	4	0,00
	01.2023		10.897	ZAR 190.919	304	0	304	0,00
	02.2023	COP	20.000.000	\$ 4.118	37	0	37	0,00
	02.2023	PEN	4.743	1.193	0	(47)	(47)	0,00
	02.2023	ZAR	19.518	1.120	0	(22)	(22)	0,00
	03.2023	PEN	19.383	5.017	0	(32)	(32)	0,00
	03.2023	\$	44.896	MXN 882.630	69	(291)	(222)	0,00
	03.2023		14.075	PEN 56.583	681	0	681	0,00
	04.2023		13.291	CLP 11.734.992	263	0	263	0,00
	04.2023		55.617	PEN 222.288	2.174	0	2.174	0,00
	04.2023	ZAR	700.958	\$ 37.854	0	(3.000)	(3.000)	(0,01)
	05.2023	\$	39.911	MXN 806.724	541	0	541	0,00
CLY	03.2023		13.564	PEN 52.180	29	0	29	0,00
DUB	01.2023	¥	41.810.000	\$ 296.709	0	(20.485)	(20.485)	(0,04)
	01.2023	\$	8.145	DKK 57.791	153	0	153	0,00
	02.2023	MXN	996.199	\$ 50.000	0	(680)	(680)	0,00
	02.2023	ZAR	64.861	3.884	85	0	85	0,00
GLM	01.2023	BRL	3.227.418	620.508	9.310	(84)	9.226	0,02
	01.2023	CNH	9.392	1.350	0	(9)	(9)	0,00
	01.2023	\$	289.956	BRL 1.564.705	6.403	0	6.403	0,01
	01.2023		11.672	CLP 11.500.000	1.808	0	1.808	0,00
	01.2023		3.633	HKD 28.283	0	(8)	(8)	0,00
	01.2023		9.241	ILS 29.712	0	(820)	(820)	0,00
	01.2023	ZAR	48.579	\$ 2.717	0	(134)	(134)	0,00
	02.2023	\$	34.476	BRL 180.119	0	(546)	(546)	0,00
	03.2023	MXN	761.736	\$ 38.322	0	(274)	(274)	0,00
	03.2023	\$	6.501	CLP 5.759.159	196	0	196	0,00
	03.2023		602.098	MXN 12.360.807	23.486	0	23.486	0,04
	04.2023	MXN	26.017	\$ 1.293	0	(16)	(16)	0,00
	04.2023	\$	575.565	BRL 3.047.299	85	(8.399)	(8.314)	(0,01)
	05.2023	PEN	17.723	\$ 4.379	0	(221)	(221)	0,00
	05.2023	ZAR	113.996	6.821	193	0	193	0,00
JPM	01.2023	€	17.225	17.911	0	(480)	(480)	0,00
	01.2023	\$	375.863	BRL 2.000.000	2.943	0	2.943	0,01
	01.2023		1.235	£ 1.022	0	(5)	(5)	0,00
	01.2023		4.635	ZAR 81.283	136	0	136	0,00
	02.2023	NOK	8.470	\$ 856	0	(5)	(5)	0,00
	02.2023	TWD	1.583.060	52.143	429	0	429	0,00
	02.2023	\$	371.257	BRL 2.000.000	5.485	0	5.485	0,01
	02.2023		87.141	IDR 1.373.078.956	1.647	0	1.647	0,00
	02.2023		36.000	MXN 736.421	1.560	0	1.560	0,00
	03.2023	MXN	784.858	\$ 38.174	15	(1.563)	(1.548)	0,00
	03.2023	\$	93.592	IDR 1.464.908.549	1.102	0	1.102	0,00
	03.2023		1.810	MXN 35.902	7	0	7	0,00

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
MBC	01.2023	AUD 10.637	\$ 7.111	\$ 0	\$ (105)	\$ (105)	0,00
	01.2023	CAD 411	306	3	0	3	0,00
	01.2023	€ 21.548	22.757	0	(250)	(250)	0,00
	01.2023	£ 2.850.877	3.415.812	697	(14.749)	(14.052)	(0,02)
	01.2023	PEN 1.396	360	0	(5)	(5)	0,00
	01.2023	\$ 67.857	AUD 99.072	88	(743)	(655)	0,00
	01.2023	7.382	DKK 52.260	122	0	122	0,00
	01.2023	22.446	€ 21.138	124	0	124	0,00
	01.2023	22.677	£ 18.599	0	(301)	(301)	0,00
	01.2023	15.079	HKD 117.390	0	(33)	(33)	0,00
	01.2023	270.266	¥ 36.876.671	9.533	(125)	9.408	0,02
	01.2023	1.174	NZD 1.847	0	(6)	(6)	0,00
	01.2023	461	ZAR 7.892	2	0	2	0,00
	01.2023	ZAR 2.441.468	\$ 140.910	0	(2.382)	(2.382)	0,00
	02.2023	IDR 11.967.146	758	0	(16)	(16)	0,00
	02.2023	\$ 479	MXN 9.865	24	0	24	0,00
	03.2023	TWD 1.918.464	\$ 65.194	2.314	0	2.314	0,00
	03.2023	\$ 56.799	IDR 889.123.953	676	0	676	0,00
	03.2023	2.881	MXN 57.631	36	0	36	0,00
	05.2023	CNH 5.907	\$ 880	18	0	18	0,00
	09.2023	\$ 1.492	ZAR 26.404	28	0	28	0,00
	09.2023	ZAR 2.863.258	\$ 158.281	0	(6.604)	(6.604)	(0,01)
MYI	01.2023	AUD 298	201	0	(1)	(1)	0,00
	01.2023	CHF 3.503	3.794	7	0	7	0,00
	01.2023	€ 12.102	12.883	0	(32)	(32)	0,00
	01.2023	£ 21.338	26.085	414	0	414	0,00
	01.2023	HKD 700	90	0	0	0	0,00
	01.2023	¥ 10.450	78	0	(1)	(1)	0,00
	01.2023	SGD 7.203	5.363	0	(7)	(7)	0,00
	01.2023	\$ 174.459	AUD 259.787	1.758	0	1.758	0,00
	01.2023	574	€ 537	0	0	0	0,00
	01.2023	2.735	£ 2.268	0	(6)	(6)	0,00
	01.2023	15	HKD 117	0	0	0	0,00
	01.2023	960.905	¥ 131.737.985	38.204	0	38.204	0,07
	01.2023	1.035	ZAR 17.867	14	0	14	0,00
	02.2023	TWD 2.926.743	\$ 96.000	391	0	391	0,00
	02.2023	ZAR 1.272.524	69.555	0	(4.996)	(4.996)	(0,01)
	03.2023	TWD 1.744.706	59.243	2.058	0	2.058	0,00
	03.2023	\$ 79.880	IDR 1.252.759.749	1.101	0	1.101	0,00
	03.2023	639	MXN 12.662	2	0	2	0,00
RBC	01.2023	CAD 815.648	\$ 597.100	0	(4.897)	(4.897)	(0,01)
	01.2023	€ 5	5	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 2.006	AUD 2.992	23	0	23	0,00
	01.2023	1.766	£ 1.462	0	(7)	(7)	0,00
	01.2023	368	ZAR 6.487	13	0	13	0,00
	02.2023	MXN 3.597.357	\$ 181.448	0	(2.027)	(2.027)	0,00
	02.2023	\$ 181.671	NOK 1.812.645	2.656	0	2.656	0,00
	03.2023	128.178	MXN 2.563.736	1.722	0	1.722	0,00
RYL	01.2023	€ 555	\$ 586	0	(7)	(7)	0,00
	01.2023	¥ 7.235.000	52.874	0	(2.092)	(2.092)	0,00
	01.2023	\$ 5.163	¥ 690.400	73	0	73	0,00
	02.2023	¥ 25.380.000	\$ 185.131	0	(8.428)	(8.428)	(0,01)
	02.2023	SEK 15.910	1.545	14	0	14	0,00
SCX	01.2023	\$ 1.956	AUD 2.903	13	0	13	0,00
	01.2023	160.423	CAD 215.519	0	(1.357)	(1.357)	0,00
	01.2023	3.329	€ 3.127	10	0	10	0,00
	01.2023	13.540	£ 10.936	0	(383)	(383)	0,00
	01.2023	1.771	¥ 240.000	49	0	49	0,00
	01.2023	24.618	PEN 94.512	159	0	159	0,00
	02.2023	8.284	CLP 7.429.737	397	0	397	0,00
	02.2023	91.779	IDR 1.444.786.639	1.644	0	1.644	0,00
	03.2023	CLP 266.478	\$ 299	0	(11)	(11)	0,00
	03.2023	\$ 9.206	CLP 8.218.119	350	0	350	0,00
	03.2023	649	MXN 12.889	4	0	4	0,00
	03.2023	9.390	PEN 36.132	29	0	29	0,00
	04.2023	ZAR 2.566.031	\$ 139.587	0	(9.966)	(9.966)	(0,02)
	09.2023	2.911.476	165.943	0	(1.628)	(1.628)	0,00
SOG	01.2023	\$ 506	ZAR 8.776	9	0	9	0,00
SSB	01.2023	PEN 1.990	\$ 516	0	(6)	(6)	0,00
	01.2023	\$ 515	PEN 1.990	6	0	6	0,00
TOR	01.2023	9.406	AUD 13.936	47	0	47	0,00
	01.2023	223.294	CAD 300.172	0	(1.749)	(1.749)	0,00
	01.2023	29.423	NZD 45.613	0	(573)	(573)	0,00
	01.2023	3.646	SGD 4.938	37	0	37	0,00
	01.2023	13.308	ZAR 231.921	307	0	307	0,00
	01.2023	ZAR 106.003	\$ 5.757	0	(462)	(462)	0,00
	03.2023	\$ 31.317	CLP 28.219.523	1.498	0	1.498	0,00
UAG	01.2023	24.446	£ 19.797	0	(628)	(628)	0,00
	01.2023	357	ZAR 6.238	10	0	10	0,00
	01.2023	ZAR 679.412	\$ 37.931	0	(1.952)	(1.952)	0,00
	02.2023	\$ 134.914	IDR 2.141.407.014	3.567	0	3.567	0,01
	03.2023	¥ 144.201.986	\$ 1.061.929	0	(39.962)	(39.962)	(0,07)
				\$ 166.288	\$ (319.698)	\$ (153.410)	(0,26)

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Income Fund (Forts.)

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilklassen Institutional AUD (Hedged) thesaurierend, Investor AUD (Hedged) ausschüttend, Administrative AUD (Hedged) ausschüttend, E AUD (Hedged) ausschüttend und Z AUD (Hedged) ausschüttend II die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	01.2023	\$ 406.226	AUD 603.039	\$ 2.825	\$ 0	\$ 2.825	0,01
BOA	01.2023	AUD 20.375	\$ 13.790	0	(30)	(30)	0,00
	01.2023	\$ 696	AUD 1.032	3	0	3	0,00
CBK	01.2023	AUD 523	\$ 353	0	(2)	(2)	0,00
	01.2023	\$ 19.296	AUD 28.339	25	(98)	(73)	0,00
MBC	01.2023	196.775	292.639	1.881	(154)	1.727	0,00
MYI	01.2023	477.013	710.318	4.808	0	4.808	0,01
RBC	01.2023	AUD 39	\$ 26	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 77.512	AUD 115.600	902	0	902	0,00
SCX	01.2023	AUD 4.334	\$ 2.947	7	0	7	0,00
TOR	01.2023	\$ 430.689	AUD 638.107	2.149	0	2.149	0,00
				\$ 12.600	\$ (284)	\$ 12.316	0,02

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilklasse Institutional BRL (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2023	\$ 1.987	BRL 10.347	\$ 0	\$ (27)	\$ (27)	0,00
BPS	01.2023	BRL 36.777	\$ 6.793	0	(173)	(173)	0,00
	01.2023	\$ 45.741	BRL 248.057	1.271	(29)	1.242	0,00
	02.2023	BRL 911	\$ 171	0	0	0	0,00
BSH	01.2023	10.583	2.013	9	0	9	0,00
	01.2023	\$ 1.843	BRL 9.605	0	(24)	(24)	0,00
CBK	01.2023	BRL 975.203	\$ 184.570	744	(881)	(137)	0,00
	01.2023	\$ 96.713	BRL 532.962	4.231	0	4.231	0,01
	02.2023	183.434	975.203	940	(674)	266	0,00
GLM	01.2023	BRL 500.010	\$ 94.471	35	(268)	(233)	0,00
	01.2023	\$ 93.312	BRL 512.917	3.836	0	3.836	0,01
	02.2023	BRL 4.791	\$ 904	2	0	2	0,00
	02.2023	\$ 92.407	BRL 492.247	336	(18)	318	0,00
JPM	01.2023	BRL 52.431	\$ 9.866	38	(102)	(64)	0,00
	01.2023	\$ 47.694	BRL 261.116	1.774	(12)	1.762	0,00
	02.2023	BRL 6.428	\$ 1.227	16	0	16	0,00
	02.2023	\$ 1.296	BRL 6.761	0	(22)	(22)	0,00
				\$ 13.232	\$ (2.230)	\$ 11.002	0,02

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilklassen Institutional CAD (Hedged) thesaurierend und Institutional CAD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2023	\$ 8.672	CAD 11.726	\$ 0	\$ (18)	\$ (18)	0,00
BOM	01.2023	22.698	30.479	0	(203)	(203)	0,00
CBK	01.2023	CAD 1.210	\$ 895	2	0	2	0,00
	01.2023	\$ 142	CAD 194	1	0	1	0,00
MBC	01.2023	CAD 1.367	\$ 1.003	0	(6)	(6)	0,00
	01.2023	\$ 55.522	CAD 75.121	0	(78)	(78)	0,00
MYI	01.2023	CAD 609	\$ 449	0	(1)	(1)	0,00
	01.2023	\$ 616	CAD 834	0	(1)	(1)	0,00
RBC	01.2023	CAD 111	\$ 81	0	0	0	0,00
SCX	01.2023	\$ 14.198	CAD 19.075	0	(120)	(120)	0,00
TOR	01.2023	49.958	67.158	0	(391)	(391)	0,00
				\$ 3	\$ (818)	\$ (815)	0,00

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilklassen Institutional CHF (Hedged) thesaurierend, Institutional CHF (Hedged) ausschüttend, E CHF (Hedged) thesaurierend und E CHF (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2023	\$ 227.990	CHF 215.608	\$ 5.199	\$ 0	\$ 5.199	0,01
BRC	01.2023	CHF 486	\$ 524	0	(3)	(3)	0,00
	01.2023	\$ 279	CHF 259	1	0	1	0,00
CBK	01.2023	395.597	373.693	8.568	0	8.568	0,01
MBC	01.2023	CHF 245	\$ 264	0	(1)	(1)	0,00
	01.2023	\$ 3.894	CHF 3.598	5	(8)	(3)	0,00
MYI	01.2023	CHF 1.148	\$ 1.221	0	(21)	(21)	0,00
	01.2023	\$ 1.563	CHF 1.455	11	0	11	0,00
SCX	01.2023	CHF 7.096	\$ 7.655	0	(20)	(20)	0,00
	01.2023	\$ 3.797	CHF 3.521	11	0	11	0,00
UAG	01.2023	74	68	0	0	0	0,00
				\$ 13.795	\$ (53)	\$ 13.742	0,02

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend II, Investor EUR (Hedged) thesaurierend, Investor EUR (Hedged) ausschüttend, Investor EUR (Hedged) ausschüttend A, Administrative EUR (Hedged) thesaurierend, Administrative EUR (Hedged) ausschüttend, E EUR (Hedged) thesaurierend, E EUR (Hedged) ausschüttend, E EUR (Hedged) ausschüttend II, E EUR (Hedged) ausschüttend II Q, G Retail EUR (Hedged) ausschüttend, R EUR (Hedged) ausschüttend, T EUR (Hedged) thesaurierend und T EUR (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2023	\$ 8.975	€ 8.510	\$ 111	\$ 0	\$ 111	0,00
BPS	01.2023	\$ 113.529	€ 107.183	911	0	911	0,00
CBK	01.2023	€ 141.354	\$ 149.111	0	(1.815)	(1.815)	0,00
	01.2023	\$ 4.824.842	€ 4.650.972	141.028	0	141.028	0,24
JPM	01.2023	\$ 14.779	\$ 14.213	396	0	396	0,00
MBC	01.2023	€ 51.949	\$ 55.271	3	(198)	(195)	0,00
	01.2023	\$ 5.559.995	€ 5.304.027	103.144	0	103.144	0,18
SCX	01.2023	\$ 5.077.201	\$ 4.877.939	131.001	0	131.001	0,23
				\$ 376.594	\$ (2.013)	\$ 374.581	0,65

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend, Institutional GBP (Hedged) ausschüttend, Investor GBP (Hedged) ausschüttend, Administrative GBP (Hedged) ausschüttend, E GBP (Hedged) ausschüttend und R GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2023	£ 5.744	\$ 7.014	\$ 103	\$ 0	\$ 103	0,00
	01.2023	\$ 2.312	£ 1.893	0	(34)	(34)	0,00
BPS	01.2023	£ 120	\$ 145	1	0	1	0,00
	01.2023	\$ 525	£ 436	0	(1)	(1)	0,00
BRC	01.2023	£ 4.426	\$ 5.330	5	0	5	0,00
	01.2023	\$ 154	£ 128	0	0	0	0,00
JPM	01.2023	\$ 410.289	\$ 339.777	0	(1.507)	(1.507)	0,00
MBC	01.2023	£ 7.729	\$ 9.428	129	0	129	0,00
	01.2023	\$ 406.532	£ 339.000	1.667	(351)	1.316	0,00
MYI	01.2023	£ 390	\$ 476	7	0	7	0,00
	01.2023	\$ 11.138	£ 9.062	0	(236)	(236)	0,00
TOR	01.2023	\$ 406.990	\$ 338.513	272	0	272	0,00
UAG	01.2023	£ 35.618	\$ 44.062	1.210	0	1.210	0,00
				\$ 3.394	\$ (2.129)	\$ 1.265	0,00

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilklassen E JPY (Hedged) thesaurierend und E JPY (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2023	\$ 2.423	¥ 331.869	\$ 93	\$ 0	\$ 93	0,00
BRC	01.2023	\$ 37	\$ 4.883	0	0	0	0,00
CBK	01.2023	¥ 352.633	\$ 2.581	0	(94)	(94)	0,00
MBC	01.2023	\$ 27.885	\$ 204	0	(7)	(7)	0,00
	01.2023	\$ 3.757	¥ 514.835	147	0	147	0,00
MYI	01.2023	¥ 970	\$ 7	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 15.484	¥ 2.123.289	620	0	620	0,00
RYL	01.2023	\$ 78	\$ 10.450	1	0	1	0,00
SCX	01.2023	\$ 10.616	\$ 1.466.355	505	0	505	0,00
				\$ 1.366	\$ (101)	\$ 1.265	0,00

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilklasse Institutional NOK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BRC	01.2023	\$ 62.168	NOK 618.606	\$ 645	\$ 0	\$ 645	0,00
CBK	01.2023	\$ 68.745	\$ 681.402	443	0	443	0,00
DUB	01.2023	\$ 1.462	\$ 14.410	2	0	2	0,00
MBC	01.2023	NOK 3.749	\$ 376	0	(5)	(5)	0,00
	01.2023	\$ 11.925	NOK 116.609	0	(84)	(84)	0,00
MYI	01.2023	NOK 13.779	\$ 1.379	0	(20)	(20)	0,00
	01.2023	\$ 2.955	NOK 29.687	59	0	59	0,00
RYL	01.2023	\$ 11	\$ 105	0	0	0	0,00
SCX	01.2023	\$ 71.231	\$ 706.325	518	(30)	488	0,00
				\$ 1.667	\$ (139)	\$ 1.528	0,00

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilklassen Investor RMB (Hedged) thesaurierend und E RMB (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BRC	01.2023	\$ 24.471	CNH 172.864	\$ 527	\$ 0	\$ 527	0,00
GLM	01.2023	\$ 2.147	\$ 15.171	47	0	47	0,00
MBC	01.2023	CNH 4.572	\$ 654	0	(7)	(7)	0,00
	01.2023	\$ 26.087	CNH 186.645	904	0	904	0,00
SOG	01.2023	\$ 110	\$ 766	1	0	1	0,00
UAG	01.2023	\$ 26.426	\$ 186.846	594	0	594	0,00
				\$ 2.073	\$ (7)	\$ 2.066	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Income Fund (Forts.)

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilklassen Institutional SGD (Hedged) thesaurierend, Institutional SGD (Hedged) ausschüttend, Investor SGD (Hedged) thesaurierend, Investor SGD (Hedged) ausschüttend, Administrative SGD (Hedged) ausschüttend und E SGD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens	
AZD	01.2023	SGD	\$ 23.369	\$ 17.204	\$ 0	\$ (224)	0,00	
BOA	01.2023	\$	876.684	SGD 1.202.963	20.386	0	20.386	0,04
BPS	01.2023		864.698	1.186.444	20.052	0	20.052	0,04
BRC	01.2023		10.490	14.291	167	0	167	0,00
GLM	01.2023		66.532	90.625	1.049	0	1.049	0,00
MBC	01.2023	SGD	17.225	\$ 12.847	2	0	2	0,00
	01.2023	\$	909.908	SGD 1.243.941	17.719	0	17.719	0,03
RBC	01.2023		3.397	4.585	23	0	23	0,00
RYL	01.2023		705	956	8	0	8	0,00
SCX	01.2023		76.914	104.416	951	0	951	0,00
UAG	01.2023	SGD	7.874	\$ 5.760	0	(112)	(112)	0,00
	01.2023	\$	30.079	SGD 40.774	327	0	327	0,00
					\$ 60.684	\$ (336)	\$ 60.348	0,11
Summe Freiverkehrsfinanzderivate							\$ 211.549	0,37

LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN			
Fannie Mae, TBA 3,500 % fällig am 01.02.2049 (k)	\$ 775.593	\$ (704.716)	(1,22)
Ginnie Mae, TBA 2,500 % fällig am 01.01.2053	31.500	(27.305)	(0,05)
2,500 % fällig am 01.02.2053	2.400	(2.082)	0,00
Summe Leerverkaufte Wertpapiere		\$ (734.103)	(1,27)
Summe Anlagen		\$ 73.528.748	126,82
Sonstige Aktiva und Passiva		\$ (15.548.421)	(26,82)
Nettovermögen		\$ 57.980.327	100,00

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

- * Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt
- µ Bei diesem Betrag handelt es sich ganz oder teilweise um ungedeckte Darlehenszusagen. Der Zinssatz für den ungedeckten Teil wird zum Zeitpunkt der Finanzierung festgelegt. Weitere Informationen zu ungedeckten Darlehenszusagen finden Sie in Erläuterung 4, „Wertpapiere und sonstige Anlagen“, in den Erläuterungen zum Abschluss.
- ^ Das Wertpapier ist in Verzug.
- (a) Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.
- (b) Reines Kapitalwertpapier.
- (c) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.
- (d) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.
- (e) Nullkuponwertpapier.
- (f) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.
- (g) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.
- (h) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.
- (i) Mit dem Fonds verbunden.
- (j) Bedingt wandelbares Wertpapier.
- (k) Zum 31. Dezember 2022 leerverkauftes Wertpapier ist durch Long-Portfolioanlagen in übertragbaren Wertpapieren und Geldmarktinstrumenten abgedeckt.
- (l) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2021: 0,91 %):

Emittentenbeschreibung	Kaufdatum	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
ADLER Group S.A. 12,500 % fällig am 31.07.2025	22.12.2022	\$ 1.001	\$ 1.001	0,00
Chester A PLC 0,000 % fällig am 17.03.2046	18.04.2019	12.756	13.718	0,02
Chester A PLC 4,225 % fällig am 17.03.2046	18.04.2019	78.855	72.528	0,13
Chester A PLC 4,675 % fällig am 17.03.2046	18.04.2019	19.159	17.546	0,03
Chester A PLC 5,175 % 17.03.2046	18.04.2019	17.790	16.074	0,03
Chester A PLC 5,675 % fällig am 17.03.2046	18.04.2019	10.947	9.769	0,02
Chester A PLC 6,425 % fällig am 17.03.2046	18.04.2019	5.473	4.773	0,01
Constellation Oil Services Holding S.A. – Exp. 10. Juni 2071	10.06.2022	0	0	0,00
Constellation Oil Services Holding S.A. 'B'	10.06.2022	353	353	0,00
Corestate Capital Holding S.A. 8,000 % fällig am 15.04.2023	06.12.2022	1.050	1.068	0,00
Deutsche Bank AG 3,035 % fällig am 28.05.2032	25.05.2021 - 29.09.2021	46.085	34.907	0,06

Emittentenbeschreibung	Kauf- datum	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
Intelsat Emergence S.A.	19.06.2017 - 23.02.2022	\$ 440.150	\$ 111.580	0,19
Morgan Stanley 0,000 % fällig am 02.04.2032	11.02.2020	59.641	39.123	0,07
Neiman Marcus Group Ltd. LLC	08.12.2014 - 19.12.2019	37.976	207.693	0,36
Oracle Corp. 3,950 % fällig am 25.03.2051	22.03.2021	18.508	13.289	0,02
Oracle Corp. 4,100 % fällig am 25.03.2061	22.03.2021 - 05.10.2021	28.212	18.726	0,03
Sierra Hamilton Holder LLC	31.07.2017	560	0	0,00
Westmoreland Mining Holdings LLC	08.12.2014 - 19.12.2019	1.691	622	0,00
		\$ 780.207	\$ 562.770	0,97

Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von 19.079 USD (31. Dezember 2021: 72.553 USD) wurden gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen zum 31. Dezember 2022 als Sicherheiten verpfändet.

Wertpapier mit einem Gesamtmarktwert von 1 USD (31. Dezember 2021: 0 USD) und Barmittel in Höhe von 273 USD (31. Dezember 2021: 1.875 USD) wurden gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen zum 31. Dezember 2022 als Sicherheiten erhalten.

Barmittel in Höhe von 1.599.431 USD (31. Dezember 2021: 1.730.912 USD) wurden zum 31. Dezember 2022 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von 0 USD (31. Dezember 2021: 56.679 USD) und Barmittel in Höhe von 188.008 USD (31. Dezember 2021: 29.880 USD) wurden gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. zum 31. Dezember 2022 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 330.063	\$ 65.894.167	\$ 1.022.241	\$ 67.246.471
Investmentfonds	1.793.842	287.586	0	2.081.428
Pensionsgeschäfte	0	3.421.698	0	3.421.698
Finanzderivate ⁽³⁾	35.705	1.477.546	3	1.513.254
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(734.103)	0	(734.103)
Summen	\$ 2.159.610	\$ 70.346.894	\$ 1.022.244	\$ 73.528.748

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

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 484.299	\$ 75.419.974	\$ 888.455	\$ 76.792.728
Investmentfonds	2.811.875	0	0	2.811.875
Pensionsgeschäfte	0	6.365.633	0	6.365.633
Finanzderivate ⁽³⁾	(11.742)	1.055.957	0	1.044.215
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(484.196)	0	(484.196)
Summen	\$ 3.284.432	\$ 82.357.368	\$ 888.455	\$ 86.530.255

⁽¹⁾ Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

⁽²⁾ Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

⁽³⁾ Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Income Fund (Forts.)

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions- geschäften	% des Nettovermögens
BRC	0,500 %	09.12.2022	TBD ⁽¹⁾	€ (2.590)	\$ (2.764)	(0,01)
	0,550	21.09.2022	TBD ⁽¹⁾	(2.240)	(2.391)	0,00
DBL	(0,500)	01.12.2022	TBD ⁽¹⁾	(10.039)	(10.712)	(0,02)
Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte					\$ (15.867)	(0,03)

⁽¹⁾ Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung des Marktwerts der außerbörslich gehandelten Finanzderivate und (erhaltenen)/verpfändeten Sicherheiten nach Kontrahenten zum 31. Dezember 2022 und 31. Dezember 2021:

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2022			Zum 31. Dez. 2021		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾
AZD	\$ 2.601	\$ (920)	\$ 1.681	k. A.	k. A.	k. A.
BOA	(36.145)	30.410	(5.735)	30.854	(28.170)	2.684
BOM	(1.847)	2.130	283	k. A.	k. A.	k. A.
BPS	37.581	(31.520)	6.061	86.895	(58.410)	28.485
BRC	(19.965)	16.765	(3.200)	28.570	(16.980)	11.590
BSH	(15)	0	(15)	k. A.	k. A.	k. A.
BYL	(1.443)	0	(1.443)	(2.174)	0	(2.174)
CBK	63.317	(64.234)	(917)	9.950	(10.843)	(893)
CLY	29	0	29	k. A.	k. A.	k. A.
DUB	(21.446)	18.530	(2.916)	21.385	(21.610)	(225)
FAR	(2.129)	2.290	161	k. A.	k. A.	k. A.
FBF	(4.557)	4.715	158	6.619	(6.000)	619
GLM	(618)	(8.230)	(8.848)	(23.168)	36.389	13.221
GSC	k. A.	k. A.	k. A.	(224)	280	56
GST	(18.731)	8.496	(10.235)	19.477	(18.860)	617
HUS	1.179	(520)	659	28.486	(17.264)	11.222
IND	k. A.	k. A.	k. A.	4.061	(3.840)	221
JPM	9.738	(8.970)	768	25.578	(24.590)	988
JPS	(1.195)	1.120	(75)	2.747	(2.440)	307
MBC	112.677	(90.850)	21.827	(10.168)	2.390	(7.778)
MEI	(363)	294	(69)	282	(290)	(8)
MYC	(9.537)	(29.220)	(38.757)	40.406	(52.747)	(12.341)
MYI	44.132	(35.730)	8.402	(38.319)	29.530	(8.789)
NAB	k. A.	k. A.	k. A.	(42)	0	(42)
RBC	(1.592)	2.500	908	502	70	572
RYL	(10.431)	8.200	(2.231)	1.034	(930)	104
SAL	(15.988)	16.088	100	15.526	(15.040)	486
SCX	122.133	(112.350)	9.783	12.571	(8.410)	4.161
SOG	10	0	10	k. A.	k. A.	k. A.
SSB	k. A.	k. A.	k. A.	(3.562)	3.777	215
TOR	1.135	(920)	215	33.048	(22.120)	10.928
UAG	(36.981)	30.720	(6.261)	(7.067)	14.123	7.056

⁽¹⁾ Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2022:

	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	68,71	55,79
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	45,07	44,39
Sonstige übertragbare Wertpapiere	2,21	4,19
Investmentfonds	3,59	3,82
Pensionsgeschäfte	5,90	8,65
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,15	(0,08)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	2,09	1,12
Freiverkehrsfinanzderivate	0,37	0,38
Leerverkaufte Wertpapiere	(1,27)	(0,66)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(0,03)	(0,10)

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2022 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
Kreditbeteiligungen und -abtretung	3,66	3,76
Unternehmensanleihen und Wechsel	22,63	31,27
Wandelanleihen & Wechsel	0,03	0,04
Kommunalanleihen und Wechsel	0,15	0,54
US-Regierungsbehörden	35,26	17,92
US-Schatzobligationen	17,94	13,22

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
Non-Agency-MBS	12,73	10,90
Forderungsbesicherte Wertpapiere	8,72	8,81
Staatsemissionen	5,29	6,91
Stammaktien	0,93	0,87
Bezugsrechte	0,01	k. A.
Optionsscheine	0,07	0,07
Vorzugswertpapiere	0,23	0,32
Real Estate Investment Trusts	0,34	0,26
Kurzfristige Instrumente	8,00	9,48
Investmentfonds	3,59	3,82
Pensionsgeschäfte	5,90	8,65
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,16	(0,08)
Verkaufsoptionen		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	(0,01)	k. A.
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf	0,00	0,02
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	0,00	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,41	0,06
Zinsswaps	1,68	1,04
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Zinsswapoptionen	0,21	0,04
Optionen auf Wertpapiere	k. A.	0,01
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes	0,00	0,00
Devisenoptionen	k. A.	0,00
Zinsswapoptionen	(0,17)	(0,05)
Zinsscaps	(0,10)	k. A.
Optionen auf Wertpapiere	(0,01)	(0,01)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzkauf	0,00	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf	(0,06)	0,01
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	(0,06)	0,11
Zinsswaps	k. A.	0,02
Total Return Swaps auf Indizes	0,00	0,00
Total Return Swaps auf Wertpapiere	k. A.	0,00
Devisenterminkontrakte	(0,26)	(0,03)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,82	0,28
Leerverkaufte Wertpapiere	(1,27)	(0,66)
Sonstige Aktiva und Passiva	(26,82)	(17,60)
Nettovermögen	100,00	100,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Income Fund II

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE				MGM China Holdings Ltd.				2,445 % fällig am 13.03.2045	€	500	0,83
KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG				4,750 % fällig am 01.02.2027	\$	200	0,31	GS Mortgage Securities Corp. Trust	\$	489	0,83
Air Canada				NCL Corp. Ltd.				6,318 % fällig am 15.11.2032	\$	468	0,83
8,130 % fällig am 11.08.2028	\$	199	0,35	5,875 % fällig am 15.02.2027		150	0,23	Harbour Energy PLC	£	2.000	4,00
CommScope, Inc.				Petroleos Mexicanos				5,044 % fällig am 28.01.2054			
7,634 % fällig am 06.04.2026		199	0,33	6,700 % fällig am 16.02.2032		179	0,25	Hospitality Mortgage Trust	\$	178	0,30
Intelsat Jackson Holdings S.A.				Prosus NV				6,318 % fällig am 15.11.2036			
7,445 % fällig am 01.02.2029		18	0,03	3,257 % fällig am 19.01.2027		200	0,32	JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust		457	0,81
Poseidon BidCo S.A.S.				Studio City Co. Ltd.				3,735 % fällig am 05.01.2031			
5,250 % - 7,452 % fällig am 14.07.2028	€	200	0,32	7,000 % fällig am 15.02.2027		200	0,33	Jupiter Mortgage PLC	£	900	1,81
U.S. Renal Care, Inc.				Venture Global Calcasieu Pass LLC				6,676 % fällig am 20.07.2060			
9,438 % fällig am 26.06.2026	\$	249	0,25	3,875 % fällig am 15.08.2029		200	0,31	Lehman XS Trust	\$	432	0,66
United Airlines, Inc.						2.693	4,76	Morgan Stanley Capital Trust		450	0,77
8,108 % fällig am 21.04.2028		246	0,43					5,518 % fällig am 15.07.2035		438	0,81
		971	1,71	VERSORGUNGSUNTERNEHMEN				Mortimer BTL PLC	£	200	0,42
				Gazprom PJSC Via Gaz Finance PLC	€	250	0,32	Newgate Funding PLC		391	0,78
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				1,500 % fällig am 17.02.2027				3,839 % fällig am 01.12.2050			
BANKEN UND FINANZEN				Pacific Gas & Electric Co.	\$	300	0,46	Residential Accredit Loans, Inc. Trust	\$	128	0,19
AGFC Capital Trust				3,000 % fällig am 15.06.2028		250	0,33	6,000 % fällig am 25.09.2035		129	0,20
5,829 % fällig am 15.01.2067		440	0,44	4,450 % fällig am 15.04.2042		200	0,29	6,000 % fällig am 25.09.2035			
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA				5,250 % fällig am 01.05.2052		300	0,52	Stratton Mortgage Funding PLC			
1,875 % fällig am 09.01.2026	€	200	0,33	5,900 % fällig am 15.06.2032		45	0,07	5,926 % fällig am 20.07.2060	£	440	0,91
Bank of Ireland Group PLC				Petrobras Global Finance BV				5,629 % fällig am 15.07.2059		500	1,02
6,000 % fällig am 01.09.2025 (c)(e)		200	0,35	7,250 % fällig am 17.03.2044		42	0,07	Trinity Square PLC			
BNP Paribas S.A.						1.165	2,06	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust	\$	541	0,88
7,750 % fällig am 16.08.2029 (c)(e)	\$	300	0,52	Summe Unternehmensanleihen und Wechsel		7.345	12,97	3,864 % fällig am 25.07.2037		9.867	17,43
Country Garden Holdings Co. Ltd.				US-REGIERUNGSBEHÖRDEN				ARGENTINISCHE WERTPAPIERE			
2,700 % fällig am 12.07.2026		200	0,20	Uniform Mortgage-Backed Security				Argent Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates			
Credit Suisse Group AG				3,000 % fällig am 01.08.2052	1.879	1.651	2,91	6,189 % fällig am 25.11.2034		400	0,66
5,250 % fällig am 11.02.2027 (c)(e)		250	0,29	3,500 % fällig am 01.05.2052	1.867	1.698	3,00	Countrywide Asset-Backed Certificates Trust		270	0,40
6,537 % fällig am 12.08.2033		250	0,39	4,000 % fällig am 01.09.2048 - 01.08.2049		34	0,06	4,609 % fällig am 25.08.2037		260	0,40
Deutsche Bank AG				Uniform Mortgage-Backed Security, TBA				4,609 % fällig am 25.06.2047	€	240	0,44
3,547 % fällig am 18.09.2031		200	0,28	2,500 % fällig am 01.02.2053	300	254	0,45	Dryden Euro CLO DAC			
3,742 % fällig am 07.01.2033		200	0,25	3,000 % fällig am 01.02.2053	900	791	1,40	2,188 % fällig am 15.01.2032		732	1,13
Ford Motor Credit Co. LLC				3,500 % fällig am 01.02.2053	3.200	2.910	5,14	First Franklin Mortgage Loan Trust	\$	732	1,13
2,386 % fällig am 17.02.2026	€	100	0,17	4,000 % fällig am 01.02.2053	3.100	2.909	5,14	4,129 % fällig am 25.03.2036			
Huarong Finance Co. Ltd.				4,500 % fällig am 01.01.2053	400	385	0,68	Home Equity Asset Trust		737	1,14
3,375 % fällig am 24.02.2030	\$	300	0,40	5,500 % fällig am 01.02.2053	500	501	0,88	5,049 % fällig am 25.04.2036			
Intesa Sanpaolo SpA				6,000 % fällig am 01.02.2053	100	101	0,18	Long Beach Mortgage Loan Trust		645	1,02
5,875 % fällig am 01.09.2031 (c)(e)	€	250	0,38			11.232	19,84	4,619 % fällig am 25.12.2036		645	1,02
Nationwide Building Society				US-SCHATZOBIGATIONEN				4,709 % fällig am 25.10.2036		776	1,24
5,750 % fällig am 20.06.2027 (c)(e)	£	200	0,38	U.S. Treasury Inflation Protected Securities (b)				4,989 % fällig am 25.02.2036		369	0,55
Navient Corp.				0,125 % fällig am 15.07.2024	376	364	0,64	Morgan Stanley Capital, Inc. Trust		900	1,19
5,000 % fällig am 15.03.2027	\$	250	0,39	0,125 % fällig am 15.10.2024	221	213	0,38	4,944 % fällig am 25.01.2036			
Swiss Insured Brazil Power Finance SARL				0,125 % fällig am 15.02.2052	642	417	0,74	New Century Home Equity Loan Trust		700	1,02
9,850 % fällig am 16.07.2032	BRL	1.055	0,31	0,250 % fällig am 15.07.2029	466	427	0,75	5,124 % fällig am 25.10.2035			
UBS Group AG				0,375 % fällig am 15.07.2023	538	531	0,94	Segovia European CLO DAC	€	200	0,36
4,375 % fällig am 10.02.2031 (c)(e)	\$	250	0,34	0,500 % fällig am 15.04.2024	555	540	0,95	2,336 % fällig am 20.07.2032			
4,875 % fällig am 12.02.2027 (c)(e)		200	0,30	0,625 % fällig am 15.01.2024	728	712	1,26	Structured Asset Investment Loan Trust	\$	711	1,06
UniCredit SpA				0,625 % fällig am 15.07.2032	718	649	1,15	5,364 % fällig am 25.05.2035			
5,459 % fällig am 30.06.2035		300	0,43	1,000 % fällig am 15.02.2049	118	99	0,17	Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust		665	1,13
		3.487	6,15	1,625 % fällig am 15.10.2027	302	302	0,53	4,679 % fällig am 25.07.2036		5.858	10,35
				U.S. Treasury Notes				STAATSEMISSIONEN			
INDUSTRIEWERTE				2,375 % fällig am 31.03.2029	500	455	0,80	Argentina Government International Bond		160	0,44
American Airlines Pass-Through Trust				2,750 % fällig am 15.05.2025	2.500	2.411	4,26	0,500 % fällig am 09.07.2030		179	0,46
3,375 % fällig am 01.11.2028		501	0,75	3,125 % fällig am 15.08.2025	7.500	7.283	12,87	1,500 % fällig am 09.07.2035		272	0,44
Atlantia SpA				3,875 % fällig am 30.09.2029	700	695	1,23	3,500 % fällig am 09.07.2041		63	0,20
1,875 % fällig am 12.02.2028	€	300	0,47	4,000 % fällig am 31.10.2029	1.700	1.701	3,00	3,875 % fällig am 09.01.2038			
Carvana Co.				4,125 % fällig am 15.11.2032	3.000	3.046	5,38	Bonos de la Tesoreria de la Republica en Pesos		50.000	56
10,250 % fällig am 01.05.2030	\$	100	0,08			19.845	35,05	4,500 % fällig am 01.03.2026	CLP	50.000	56
Charter Communications Operating LLC				NON-AGENCY-MBS				Mexico Government International Bond		10.000	1,76
3,500 % fällig am 01.06.2041		100	0,12	1211 Avenue of the Americas Trust				10,000 % fällig am 05.12.2024	MXN	10.000	1,76
Clear Channel Outdoor Holdings, Inc.				4,142 % fällig am 10.08.2035	400	337	0,59	Peru Government International Bond		500	0,81
7,750 % fällig am 15.04.2028		240	0,31	225 Liberty Street Trust				6,900 % fällig am 12.08.2037	PEN	500	0,81
CSC Holdings LLC				4,501 % fällig am 10.02.2036	500	441	0,78	Romania Government International Bond	€	220	0,31
4,500 % fällig am 15.11.2031		200	0,25	280 Park Avenue Mortgage Trust							
Directv Financing LLC				5,773 % fällig am 15.09.2034	100	92	0,16				
5,875 % fällig am 15.08.2027		350	0,55	Adjustable Rate Mortgage Trust							
DISH DBS Corp.				4,629 % fällig am 25.08.2036	688	260	0,46				
5,250 % fällig am 01.12.2026		130	0,19	Euroail PLC	€	573	5,86				
5,750 % fällig am 01.12.2028		130	0,18	2,286 % fällig am 15.12.2044							
Intelsat Jackson Holdings S.A.											
6,500 % fällig am 15.03.2030		70	0,11								

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
Russia Government International Bond				BEZUGSRECHTE			
4,875 % fällig am 16.09.2023 ^	\$ 200	\$ 165	0,29	Intelsat Jackson Holdings S.A. – Exp. 5. Dezember 2025	194	\$ 2	0,00
5,250 % fällig am 23.06.2047 ^	200	74	0,13				
South Africa Government International Bond				Summe Übertragbare Wertpapiere			
10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR 5.900	366	0,65			\$ 56.970	100,62
Turkey Government International Bond				INVESTMENTFONDS			
5,750 % fällig am 11.05.2047	\$ 250	171	0,30	ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN			
		1.828	3,23	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (d)			
AKTIEN					174.823	1.740	3,07
STAMMAKTIEN				Summe Investmentfonds			
FINANZWERTE						\$ 1.740	3,07
Intelsat Emergence S.A. (a)(f)	935	22	0,04				

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

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
3-Month SOFR December Futures	Short	03.2026	1	\$ 3	0,01
3-Month SOFR March Futures	Short	06.2026	1	2	0,00
Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 146,000 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond February 2023 Futures ⁽¹⁾	Short	01.2023	1	1	0,00
Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 138.500 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond February 2023 Futures ⁽¹⁾	Short	01.2023	1	(5)	(0,01)
U.S. Treasury 10-Year Note March Futures	Short	03.2023	5	3	0,01
				\$ 4	0,01

⁽¹⁾ Future-Style-Option.

VERKAUFSoPTIONEN

OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
Call – CME Kaufoptionen mit Ausübungskurs von USD 98,000 auf 3-Month SOFR December Futures	\$ 98,000	15.12.2023	1	\$ (1)	\$ 0	0,00
Put – CME Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von USD 96,500 auf 3-Month SOFR December Futures	96,500	15.12.2023	1	(1)	(3)	(0,01)
				\$ (2)	\$ (3)	(0,01)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate						\$ 1 0,00

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.EM-36 5-Year Index	1,000 %	20.12.2026	\$ 644	\$ 10	0,02
CDX.EM-38 5-Year Index	1,000	20.12.2027	1.500	12	0,02
CDX.HY-39 5-Year Index	5,000	20.12.2027	4.500	134	0,24
				\$ 156	0,28

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000 %	16.06.2028	¥ 130.000	\$ 31	0,06
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000	15.12.2028	530.000	32	0,06
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,200	15.12.2041	30.000	13	0,02
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,400	15.06.2032	40.000	12	0,02
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,250	15.06.2032	\$ 10	2	0,00
Erhalt ⁽³⁾	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,600	16.01.2026	700	17	0,03
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2029	300	15	0,03
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	21.12.2052	800	(29)	(0,05)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,000	21.12.2027	50	0	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,000	21.12.2029	360	0	0,00
Erhalt ⁽³⁾	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,300	17.01.2026	500	12	0,02

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Income Fund II (Forts.)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt ⁽³⁾	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,350 %	17.01.2025	\$ 900	\$ 13	0,02
Erhalt ⁽³⁾	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,450	20.12.2024	1,800	27	0,05
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,880	30.09.2027	300	(10)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,900	04.10.2027	300	(10)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,955	04.10.2027	100	(3)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,050	07.09.2027	100	(3)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,050	08.09.2029	100	(3)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,050	06.09.2032	100	(3)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,100	09.09.2029	100	(3)	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,610	12.12.2032	100	0	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,250	16.06.2051	450	126	0,21
Erhalt ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	1,500	15.03.2028	€ 400	19	0,04
Erhalt ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	1,750	15.03.2033	700	20	0,04
					\$ 275	0,48
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					\$ 431	0,76

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

⁽²⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert.

⁽³⁾ Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

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

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

VERKAUFSoPTIONEN

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
BOA	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,150 %	01.12.2023	100	\$ 0	\$ 0	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	01.12.2023	100	0	(1)	0,00
BPS	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,700	28.04.2023	100	0	0	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,250	28.04.2023	100	0	(2)	(0,01)
	Call – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,150	09.01.2023	100	0	0	0,00
	Put – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	09.01.2023	100	0	(1)	0,00
BRC	Call – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,200	12.01.2023	100	0	0	0,00
	Put – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,800	12.01.2023	100	0	0	0,00
CBK	Call – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,150	09.01.2023	100	0	0	0,00
	Put – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	09.01.2023	100	0	(1)	0,00
DUB	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,920	13.10.2023	100	(1)	0	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,920	13.10.2023	100	(1)	(1)	0,00
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,790	08.04.2024	100	(1)	0	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,790	08.04.2024	100	(1)	(1)	0,00
GLM	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,920	13.10.2023	100	(1)	0	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,920	13.10.2023	100	(1)	(1)	0,00
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,018	20.10.2023	100	(1)	0	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,018	20.10.2023	100	(1)	(1)	0,00
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,140	23.10.2023	100	(1)	0	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,140	23.10.2023	100	(1)	(1)	0,00
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,190	23.10.2023	100	(1)	0	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,190	23.10.2023	100	(1)	(1)	0,00
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,225	23.10.2023	100	(1)	0	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,225	23.10.2023	100	(1)	(1)	0,00
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,973	25.10.2023	100	(1)	0	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,973	25.10.2023	100	(1)	(1)	0,00
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,841	27.10.2023	100	(1)	0	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,841	27.10.2023	100	(1)	(2)	(0,01)
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,088	03.11.2023	100	(1)	0	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,088	03.11.2023	100	(1)	(1)	0,00
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,910	10.11.2023	100	(1)	0	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,910	10.11.2023	100	(1)	(1)	0,00
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,250	17.11.2023	100	0	0	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	17.11.2023	100	0	(1)	0,00
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,150	20.11.2023	100	0	0	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	20.11.2023	100	0	(1)	0,00
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,250	07.12.2023	100	0	0	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	07.12.2023	100	0	(1)	0,00
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,697	02.04.2024	100	(1)	0	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,697	02.04.2024	100	(1)	(1)	0,00
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,550	05.04.2023	100	0	0	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,100	05.04.2023	100	0	(2)	(0,01)
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,550	11.04.2023	200	0	0	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,100	11.04.2023	200	0	(3)	(0,01)

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,700 %	26.04.2023	100	\$ 0	\$ 0	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,250	26.04.2023	100	0	(2)	(0,01)
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,550	15.05.2023	100	0	0	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,100	15.05.2023	100	0	(2)	(0,01)
	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,547	07.03.2023	100	(2)	0	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,547	07.03.2023	100	(2)	(6)	(0,01)
	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,067	09.06.2023	200	(2)	(1)	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	3,140	09.06.2023	200	(3)	(7)	(0,01)
	Call – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,230	23.01.2023	100	0	0	0,00
	Put – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,730	23.01.2023	100	0	(1)	0,00
							\$ (33)	\$ (45)	(0,08)

OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.01.2053	\$ 101,891	05.01.2023	100	\$ 0	\$ 0	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.02.2053	100,000	06.02.2023	100	(1)	(1)	0,00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.02.2053	102,000	06.02.2023	100	(1)	0	0,00
					\$ (2)	\$ (1)	0,00

⁽¹⁾ Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag ⁽²⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
MYC	South Africa Government International Bond	1,000 %	20.12.2026	\$ 200	\$ (9)	\$ 1	\$ (8)	(0,01)

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

⁽²⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert.

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens	
BOA	02.2023	CAD	\$ 376	\$ 276	\$ 0	\$ (1)	0,00	
	02.2023	€	23	24	0	0	0,00	
	02.2023	£	4.398	5.189	0	(108)	(0,19)	
	02.2023	\$	96	€ 92	2	0	0,00	
	02.2023		877	¥ 120.600	43	0	43	0,08
BPS	03.2023	TWD	\$ 1.207	\$ 41	1	0	0,00	
	01.2023	\$	30	BRL 163	1	0	0,00	
	01.2023		530	KRW 692.166	21	0	21	0,04
	02.2023	€	2.822	\$ 2.926	0	(95)	(95)	(0,17)
	02.2023	\$	19	IDR 299.438	0	0	0	0,00
BRC	03.2023		116	CNY 800	1	0	0,00	
	01.2023	CNH	298	\$ 43	0	0	0,00	
	03.2023	\$	98	IDR 1.531.771	1	0	0,00	
CBK	01.2023	CLP	23.403	\$ 26	0	(1)	(1)	0,00
	01.2023	\$	565	BRL 2.966	0	(3)	(3)	(0,01)
	01.2023		25	CLP 23.395	3	0	3	0,01
	01.2023		122	PEN 490	6	0	6	0,01
	02.2023		182	AUD 270	1	0	1	0,00
	02.2023		26	CLP 23.532	1	0	1	0,00
	02.2023		268	NZD 415	0	(5)	(5)	(0,01)
	03.2023		948	MXN 19.043	18	0	18	0,03
	04.2023	PEN	1.276	\$ 320	0	(12)	(12)	(0,02)
	05.2023	MXN	18.199	900	0	(12)	(12)	(0,02)
GLM	01.2023	BRL	3.129	587	0	(5)	(5)	(0,01)
	01.2023	CNH	309	44	0	0	0	0,00
	01.2023	HKD	86	11	0	0	0	0,00
	03.2023	MXN	725	37	0	0	0	0,00
	03.2023	\$	3	MXN 61	0	0	0	0,00
	04.2023		577	BRL 3.129	6	0	6	0,01
	05.2023	PEN	137	\$ 34	0	(1)	(1)	0,00
MBC	05.2023	\$	46	PEN 186	2	0	2	0,00
	05.2023	ZAR	51	\$ 3	0	0	0	0,00
	01.2023	HKD	359	46	0	0	0	0,00
	02.2023	\$	283	CAD 375	0	(6)	(6)	(0,01)
	03.2023		59	IDR 929.106	1	0	1	0,00
	05.2023	CNH	191	\$ 28	1	0	1	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Income Fund II (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
MYI	01.2023	AUD 53	\$ 36	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	01.2023	HKD 703	90	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 42	KRW 52.421	0	0	0	0,00
	01.2023	ZAR 846	\$ 47	0	(2)	(2)	0,00
	02.2023	€ 12	13	0	0	0	0,00
	02.2023	TWD 2.267	74	0	0	0	0,00
	02.2023	\$ 883	AUD 1.300	0	0	0	0,00
	02.2023	ZAR 5.707	\$ 320	0	(15)	(15)	(0,02)
	03.2023	TWD 3.770	128	4	0	4	0,01
	03.2023	\$ 83	IDR 1.309.107	1	0	1	0,00
SCX	02.2023	55	€ 52	0	0	0	0,00
	02.2023	13	IDR 199.609	0	0	0	0,00
UAG	02.2023	54	858.208	1	0	1	0,00
				\$ 115	\$ (266)	\$ (151)	(0,27)

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilsklasse E AUD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	01.2023	\$ 512	AUD 759	\$ 3	\$ 0	\$ 3	0,01
BOA	01.2023	AUD 5	\$ 3	0	0	0	0,00
CBK	01.2023	8	5	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 274	AUD 402	0	(2)	(2)	0,00
MBC	01.2023	102	151	1	0	1	0,00
MYI	01.2023	272	405	3	0	3	0,00
UAG	01.2023	242	358	1	0	1	0,00
				\$ 8	\$ (2)	\$ 6	0,01

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilsklasse E EUR (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CBK	01.2023	€ 23	\$ 24	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	01.2023	\$ 1.132	€ 1.088	31	0	31	0,05
MBC	01.2023	€ 13	\$ 14	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 1.218	€ 1.161	22	0	22	0,04
SCX	01.2023	1.041	1.000	27	0	27	0,05
				\$ 80	\$ 0	\$ 80	0,14

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilsklasse E GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2023	\$ 1.091	£ 905	\$ 0	\$ (2)	\$ (2)	0,00
BRC	01.2023	£ 11	\$ 14	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 246	£ 200	0	(6)	(6)	(0,01)
MBC	01.2023	1.106	922	5	(2)	3	0,00
MYI	01.2023	48	39	0	(1)	(1)	0,00
UAG	01.2023	£ 6	\$ 7	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 905	£ 754	1	0	1	0,00
				\$ 6	\$ (11)	\$ (5)	(0,01)

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilsklasse E SGD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2023	\$ 73	SGD 101	\$ 2	\$ 0	\$ 2	0,01
BPS	01.2023	75	103	2	0	2	0,00
BRC	01.2023	SGD 24	\$ 18	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 2	SGD 2	0	0	0	0,00
GLM	01.2023	13	18	0	0	0	0,00
MBC	01.2023	SGD 308	\$ 228	0	(1)	(1)	0,00
	01.2023	\$ 79	SGD 108	1	0	1	0,00
				\$ 5	\$ (1)	\$ 4	0,01

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ (120) (0,21)

Summe Anlagen

\$ 59.022 104,24

Sonstige Aktiva und Passiva

\$ (2.399) (4,24)

Nettovermögen

\$ 56.623 100,00

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

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

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

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

(d) Mit dem Fonds verbunden.

(e) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(f) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2021: 0):

Emittentenbeschreibung	Kauf- datum	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
Intelsat Emergence S.A.	24.02.2021	\$ 77	\$ 22	0,04

Barmittel in Höhe von 961 USD (31. Dezember 2021: 155 USD) wurden zum 31. Dezember 2022 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von 0 USD (31. Dezember 2021: 1 USD) und Barmittel in Höhe von 61 USD (31. Dezember 2021: 0 USD) wurden gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. zum 31. Dezember 2022 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 56.688	\$ 282	\$ 56.970
Investmentfonds	1.740	0	0	1.740
Finanzderivate ⁽³⁾	(4)	316	0	312
Summen	\$ 1.736	\$ 57.004	\$ 282	\$ 59.022

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

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 26.438	\$ 76	\$ 26.514
Investmentfonds	2.701	0	0	2.701
Finanzderivate ⁽³⁾	0	51	0	51
Summen	\$ 2.701	\$ 26.489	\$ 76	\$ 29.266

⁽¹⁾ Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

⁽²⁾ Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

⁽³⁾ Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung des Marktwerts der außerbörslich gehandelten Finanzderivate und (erhaltenen)/verpfändeten Sicherheiten nach Kontrahenten zum 31. Dezember 2022 und 31. Dezember 2021:

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2022			Zum 31. Dez. 2021		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾
AZD	\$ 3	\$ 0	\$ 3	\$ k. A.	\$ k. A.	\$ k. A.
BOA	(65)	0	(65)	8	0	\$ 8
BPS	(73)	0	(73)	9	0	9
BRC	(5)	0	(5)	2	0	2
CBK	24	0	24	6	0	6
DUB	(2)	0	(2)	k. A.	k. A.	k. A.
GLM	(36)	30	(6)	(5)	1	(4)
HUS	k. A.	k. A.	k. A.	20	0	20
MBC	22	0	22	k. A.	k. A.	k. A.
MYC	(8)	31	23	k. A.	k. A.	k. A.
MYI	(10)	0	(10)	2	0	2
RYL	k. A.	k. A.	k. A.	1	0	1
SCX	27	0	27	5	0	5
SSB	k. A.	k. A.	k. A.	1	0	1
UAG	3	0	3	(11)	0	(11)

⁽¹⁾ Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2022:

	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	55,36	51,64
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	45,23	37,86
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,03	5,97
Investmentfonds	3,07	9,73
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,00	k. A.
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,76	0,05
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,21)	0,14

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2022 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
Kreditbeteiligungen und -abtretung	1,71	2,12
Unternehmensanleihen und Wechsel	12,97	29,17
US-Regierungsbehörden	19,84	12,14
US-Schatzobligationen	35,05	3,33
Non-Agency-MBS	17,43	16,66
Forderungsbesicherte Wertpapiere	10,35	9,34
Staatsemissionen	3,23	5,79
Stammaktien	0,04	k. A.
Bezugsrechte	0,00	k. A.
Kurzfristige Instrumente	k. A.	16,92
Investmentfonds	3,07	9,73
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,01	k. A.
Verkaufsoptionen		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	(0,01)	k. A.
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,28	k. A.
Zinsswaps	0,48	0,05
Freiverkehrsfinanzderivate		
Verkaufsoptionen		
Zinsswapoptionen	(0,08)	k. A.
Optionen auf Wertpapiere	0,00	k. A.
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf	(0,01)	k. A.
Devisenterminkontrakte	(0,27)	0,08
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,15	0,06
Sonstige Aktiva und Passiva	(4,24)	(5,39)
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE				BANKEN UND FINANZEN				BANKEN UND FINANZEN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				NON-AGENCY MORTGAGE-BACKED SECURITIES				SOVEREIGN ISSUES			
Bank of America Corp. 5,875 % fällig am 15.03.2028 (e) \$ 60 \$ 53 0,01				1211 Avenue of the Americas Trust 3,901 % fällig am 10.08.2035 1.900 1.767 0,44				Australia Government International Bond 0,250 % fällig am 21.11.2032 AUD 4.550 1.596 0,40			
Jyske Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.10.2050 DKK 6.622 700 0,17				6,000 % fällig am 25.06.2046 190 165 0,04				0,750 % fällig am 21.11.2027 1.092 460 0,11			
1,500 % fällig am 01.10.2053 5.017 541 0,13				Banc of America Alternative Loan Trust 3,775 % fällig am 20.01.2047 208 176 0,04				3,000 % fällig am 20.09.2025 1.547 838 0,21			
2,500 % fällig am 01.10.2047 1 0 0,00				Banc of America Funding Trust 6,000 % fällig am 25.03.2044 71 71 0,02				Canadian Government Real Return Bond 0,500 % fällig am 01.12.2050 (d) CAD 237 146 0,04			
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab 1,000 % fällig am 01.10.2050 0 0 0,00				Bear Stearns Mortgage Funding Trust 4,579 % fällig am 25.01.2037 2.900 2.468 0,61				1,250 % fällig am 01.12.2047 (d) 2.183 1.612 0,40			
1,000 % fällig am 01.10.2053 291 31 0,01				Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc. 5,500 % fällig am 25.08.2034 257 236 0,06				Denmark Government International Bond 0,100 % fällig am 15.11.2023 (d) DKK 3.547 511 0,13			
1,500 % fällig am 01.10.2053 13.435 1.421 0,35				CityLine Commercial Mortgage Trust 2,778 % fällig am 10.11.2031 2.475 2.384 0,59				France Government International Bond 0,100 % fällig am 01.03.2023 (d) € 905 967 0,24			
2,000 % fällig am 01.10.2053 200 23 0,01				Countrywide Alternative Loan Trust 5,253 % fällig am 20.06.2035 54 47 0,01				0,100 % fällig am 25.07.2031 (d) 1.955 1.998 0,50			
2,500 % fällig am 01.10.2047 0 0 0,00				HarborView Mortgage Loan Trust 2,861 % fällig am 25.06.2035 0 0 0,00				0,100 % fällig am 26.05.2025 (d) 960 919 0,23			
Nykredit Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.10.2050 23.735 2.511 0,62				JPMorgan Mortgage Trust 1,000 % fällig am 01.10.2053 2.332 242 0,06				0,700 % fällig am 25.07.2040 (d) 1.571 1.688 0,42			
1,000 % fällig am 01.10.2053 2.332 242 0,06				MRCD Mark Mortgage Trust 2,718 % fällig am 15.12.2036 2.598 2.391 0,59				1,800 % fällig am 15.09.2023 (d) 550 599 0,15			
1,500 % fällig am 01.10.2053 29.471 3.151 0,78				New Residential Mortgage Loan Trust 4,500 % fällig am 25.05.2058 156 147 0,04				Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,100 % fällig am 15.05.2023 (d) 59 63 0,02			
2,000 % fällig am 01.10.2053 497 57 0,01				One Market Plaza Trust 3,614 % fällig am 10.02.2032 2.000 1.925 0,48				0,400 % fällig am 15.05.2030 (d) 2.216 2.071 0,51			
2,500 % fällig am 01.10.2047 3 0 0,00				Polaris PLC 4,232 % fällig am 23.10.2059 £ 383 450 0,11				1,400 % fällig am 26.05.2025 (d) 6.914 7.285 1,81			
3,500 % fällig am 01.10.2053 3.684 486 0,12				Sequoia Mortgage Trust 4,753 % fällig am 20.07.2036 \$ 173 148 0,04				2,350 % fällig am 15.09.2024 (d) 1.156 1.272 0,32			
Realkredit Danmark A/S 1,000 % fällig am 01.10.2050 12.376 1.310 0,33				Towd Point Mortgage Trust 3,500 % fällig am 25.01.2058 2.230 2.031 0,51				2,600 % fällig am 15.09.2023 (d) 550 599 0,15			
1,000 % fällig am 01.10.2053 586 61 0,02				WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust 4,180 % fällig am 25.09.2033 1 1 0,00				Japan Government International Bond 0,005 % fällig am 10.03.2031 (d) ¥ 20.875 164 0,04			
1,500 % fällig am 01.10.2050 1.310 142 0,04				5,049 % fällig am 25.01.2045 191 173 0,04				0,100 % fällig am 10.03.2024 (d) 422.370 3.268 0,81			
1,500 % fällig am 01.10.2053 11.170 1.190 0,30				5,409 % fällig am 25.08.2045 1.808 1.700 0,42				0,100 % fällig am 10.03.2028 (d) 948.331 7.435 1,84			
2,500 % fällig am 01.04.2047 2 0 0,00								0,100 % fällig am 10.03.2029 (d) 641.105 12.911 3,20			
			11.919 2,96								
INDUSTRIEWERTE				ASSET-BACKED SECURITIES				AMERIQUE			
eBay, Inc. 2,750 % fällig am 30.01.2023 \$ 100 100 0,02				Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates 5,169 % fällig am 25.05.2034 71 71 0,02			Spain Government International Bond 0,650 % fällig am 30.11.2027 (d) € 10.689 11.276 2,80				
VERSORGUNGUNTERNEHMEN				Asset-Backed Funding Certificates Trust 4,989 % fällig am 25.10.2034 68 68 0,02			0,700 % fällig am 30.11.2033 (d) 1.657 1.653 0,41				
Petrobras Global Finance BV 7,250 % fällig am 17.03.2044 157 151 0,04				Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust 5,019 % fällig am 25.02.2036 123 123 0,03			1,450 % fällig am 31.10.2027 300 296 0,07				
Summe Unternehmensanleihen und Wechsel 12.170 3,02				CIT Mortgage Loan Trust 5,739 % fällig am 25.10.2037 32 32 0,01							
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN				Citigroup Mortgage Loan Trust 4,679 % fällig am 25.09.2036 108 103 0,03							
Freddie Mac 4,718 % fällig am 15.06.2047 707 680 0,17				Citigroup Mortgage Loan Trust Asset-Backed Pass-Through Certificates 5,334 % fällig am 25.10.2034 162 156 0,04							
Ginnie Mae 3,858 % fällig am 20.08.2068 98 95 0,02				Countrywide Asset-Backed Certificates Trust 4,569 % fällig am 25.06.2047 2.212 2.054 0,51							
4,626 % fällig am 20.08.2072 2.362 2.354 0,58				Encore Credit Receivables Trust 5,289 % fällig am 25.01.2036 900 859 0,21							
4,726 % fällig am 20.10.2072 4.712 4.639 1,15				First Franklin Mortgage Loan Trust 4,699 % fällig am 25.07.2036 158 148 0,04							
4,986 % fällig am 20.11.2072 1.900 1.922 0,48				5,169 % fällig am 25.09.2035 90 89 0,02							
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,000 % fällig am 01.02.2053 6.700 5.887 1,46				5,259 % fällig am 25.09.2035 207 203 0,05							
3,000 % fällig am 01.02.2053 14.900 13.976 3,47											
4,000 % fällig am 01.01.2053 7.200 6.931 1,72											
4,500 % fällig am 01.02.2053 5.800 5.715 1,42											
5,000 % fällig am 01.02.2053 5.800 5.715 1,42			42.199 10,47								
US-SCHATZOBBLIGATIONEN											
U.S. Treasury Inflation Protected Securities (d) 0,125 % fällig am 15.04.2025 2.076 1.979 0,49											
0,125 % fällig am 15.04.2026 2.727 2.564 0,64											
0,125 % fällig am 15.07.2026 186 176 0,04											
0,125 % fällig am 15.10.2026 13.413 12.576 3,12											
0,125 % fällig am 15.04.2027 844 787 0,19											
0,125 % fällig am 15.01.2030 116 104 0,03											
0,125 % fällig am 15.07.2030 465 417 0,10											
0,125 % fällig am 15.07.2031 12.340 10.913 2,71											
0,125 % fällig am 15.01.2032 9.352 8.198 2,03											
0,125 % fällig am 15.02.2051 1.030 664 0,16											
0,125 % fällig am 15.02.2052 642 417 0,10											
0,250 % fällig am 15.02.2050 116 78 0,02											
0,375 % fällig am 15.01.2027 1.715 1.618 0,40											
0,375 % fällig am 15.07.2027 10.695 10.084 2,50											
0,500 % fällig am 15.04.2024 1.300 1.264 0,31											
0,500 % fällig am 15.01.2028 2.899 2.728 0,68											
0,625 % fällig am 15.04.2023 480 475 0,12											
0,625 % fällig am 15.01.2024 86 85 0,02											
0,625 % fällig am 15.01.2026 125 120 0,03											
0,625 % fällig am 15.07.2032 35.382 32.436 8,05											
0,625 % fällig am 15.02.2043 13 11 0,00											

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Inflation Multi-Asset Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
United Kingdom Gilt				Apartment Income REIT Corp.	2.639	\$ 91	0,02	Dominion Resources, Inc.			
0,125 % fällig am 10.08.2028 (d)	£ 306	\$ 369	0,09	AvalonBay Communities, Inc.	1.535	248	0,06	4,700 % fällig am 01.02.2023	250	249	0,06
0,125 % fällig am 10.08.2031 (d)	1.818	2.202	0,55	Camden Property Trust	430	48	0,01	Duke Energy Corp.			
0,125 % fällig am 22.11.2036 (d)	164	191	0,05	Crown Castle, Inc.	423	57	0,01	4,620 % fällig am 11.01.2023	\$ 250	\$ 250	0,07
0,125 % fällig am 22.03.2039 (d)	360	412	0,10	CubeSmart	1.825	73	0,02	Electricite de France S.A.			
0,125 % fällig am 10.08.2041 (d)	1.614	1.830	0,45	Digital Realty Trust, Inc.	1.470	147	0,04	5,000 % fällig am 20.01.2023	250	249	0,06
0,125 % fällig am 22.03.2044 (d)	587	651	0,16	Equinix, Inc.	210	138	0,03	Enel Finance America LLC			
0,125 % fällig am 22.03.2046 (d)	1.824	1.994	0,49	Equity LifeStyle Properties, Inc.	3.818	247	0,06	6,000 % fällig am 12.01.2023	250	249	0,06
0,125 % fällig am 10.08.2048 (d)	1.749	1.890	0,47	Equity Residential	3.866	228	0,06	Energy Transfer Partners LP			
0,125 % fällig am 22.03.2051 (d)	460	494	0,12	Essex Property Trust, Inc.	530	112	0,03	5,080 % fällig am 05.01.2023	250	250	0,06
0,250 % fällig am 22.03.2052 (d)	1.323	1.483	0,37	Extra Space Storage, Inc.	429	63	0,02	Entergy Corp.			
0,500 % fällig am 22.03.2050 (d)	1.384	1.650	0,41	First Industrial Realty Trust, Inc.	3.127	151	0,04	4,700 % fällig am 12.01.2023	250	250	0,06
0,625 % fällig am 22.03.2040 (d)	247	306	0,08	Gaming and Leisure Properties, Inc.	2.793	145	0,04	Humana, Inc.			
0,625 % fällig am 22.11.2042 (d)	838	1.040	0,26	Healthpeak Properties, Inc.	5.384	135	0,03	4,850 % fällig am 10.01.2023	250	250	0,06
0,750 % fällig am 22.11.2047 (d)	2.141	2.693	0,67	Host Hotels & Resorts, Inc.	4.835	78	0,02	McCormick & Co., Inc.			
1,250 % fällig am 22.11.2027 (d)	1.944	2.476	0,61	Invitation Homes, Inc.	12.792	379	0,09	4,750 % fällig am 27.01.2023	250	249	0,06
1,250 % fällig am 22.11.2032 (d)	377	503	0,12	Kilroy Realty Corp.	1.217	47	0,01	Tampa Electric Co.			
4,125 % fällig am 22.07.2030	499	810	0,20	Life Storage, Inc.	718	71	0,02	4,800 % fällig am 12.01.2023	250	250	0,06
		80.647	20,01	Mid-America Apartment Communities, Inc.	563	88	0,02	4,770 % fällig am 25.01.2023	500	498	0,13
				National Storage Affiliates Trust	3.400	123	0,03	Vodafone Group PLC			
				Prologis, Inc.	6.603	744	0,19	4,600 % fällig am 05.01.2023	250	250	0,06
				Public Storage	1.461	409	0,10	VW Credit, Inc.			
				Realty Income Corp.	675	43	0,01	4,800 % fällig am 26.01.2023	250	249	0,06
				Regency Centers Corp.	508	32	0,01	Walgreens Boots Alliance, Inc.			
				Retail Opportunity Investments Corp.	2.171	33	0,01	4,900 % fällig am 11.01.2023	250	250	0,06
				Rexford Industrial Realty, Inc.	1.918	105	0,03	4,950 % fällig am 18.01.2023	250	249	0,06
				RLJ Lodging Trust	10.141	107	0,03			5.778	1,44
				Ryman Hospitality Properties, Inc.	1.000	82	0,02	KURZFRISTIGE SCHULDITITEL			
				Safehold, Inc.	509	15	0,00	Federal Home Loan Bank			
				SBA Communications Corp.	798	224	0,06	4,320 % fällig am 06.01.2023	8.700	8.700	2,16
				Simon Property Group, Inc.	2.893	340	0,08	4,320 % fällig am 10.01.2023	4.400	4.400	1,09
				SITE Centers Corp.	2.914	40	0,01	4,345 % fällig am 23.02.2023	4.200	4.200	1,04
				Sun Communities, Inc.	1.780	255	0,06			17.300	4,29
				Sunstone Hotel Investors, Inc.	5.417	52	0,01	U.S. TREASURY BILLS			
				UDR, Inc.	2.352	91	0,02	3,642 % fällig am 17.01.2023 (b)(c)	6.500	6.491	1,61
				Ventas, Inc.	4.504	226	0,06	Summe kurzfristige Instrumente		29.569	7,34
				VICI Properties, Inc.	21.246	688	0,17	Summe Übertragbare Wertpapiere		\$ 320.121	79,42
				WP Carey, Inc.	2.526	197	0,05				
					7.052	1,75		AKTIEN			
								INVESTMENTFONDS			
								ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN			
								PIMCO Select Funds plc - PIMCO			
								US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (f)	3.977.513	39.592	9,82
								BÖRSENGEHADELTE FONDS			
								Invesco Physical Gold ETC	108.899	19.147	4,75
								iShares Physical Gold ETC	288.780	10.236	2,54
										29.383	7,29
								Summe Investmentfonds		\$ 68.975	17,11

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft ⁽¹⁾	% des Netto-vermögens
GSC	4,330 %	30.12.2022	03.01.2023	\$ 37.700	Freddie Mac 4,000 % fällig am 01.09.2052	\$ (38.846)	\$ 37.700	\$ 37.718	9,34
SSB	1,900	30.12.2022	03.01.2023	3.020	U.S. Treasury Notes 1,875% fällig am 30.06.2026	(3.080)	3.020	3.020	0,76
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (41.926)	\$ 40.720	\$ 40.738	10,10

⁽¹⁾ Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Australia Government 3-Year Note March Futures	Short	03.2023	8	\$ 8	0,00
Australia Government 10-Year Bond March Futures	Short	03.2023	1	4	0,00
Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 146,000 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond February 2023 Futures	Short	01.2023	8	6	0,00
Euro-Bobl March Futures	Short	03.2023	38	148	0,04
Euro-BTP Italy Government Bond March Futures	Short	03.2023	18	68	0,02
Euro-Bund 10-Year Bond March Futures	Long	03.2023	11	(23)	(0,01)
Euro-Buxl 30-Year Bond March Futures	Short	03.2023	49	874	0,22
Euro-OAT France Government 10-Year Bond March Futures	Short	03.2023	7	66	0,02
Euro-Schatz March Futures	Short	03.2023	385	522	0,13
Japan Government 10-Year Bond March Futures	Short	03.2023	35	711	0,17
Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 138,500 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond February 2023 Futures	Short	01.2023	8	(41)	(0,01)
U.S. Treasury 2-Year Note March Futures	Long	03.2023	17	0	0,00
U.S. Treasury 5-Year Note March Futures	Long	03.2023	429	(586)	(0,15)
U.S. Treasury 10-Year Note March Futures	Short	03.2023	116	(37)	(0,01)
U.S. Treasury 30-Year Bond March Futures	Short	03.2023	76	80	0,02
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond March Futures	Short	03.2023	258	591	0,15
United Kingdom Long Gilt March Futures	Long	03.2023	101	(410)	(0,10)
				\$ 1.981	0,49
				\$ 1.981	0,49

Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Netto- vermögens
CDX.EM-31 5-Year Index	1,000 %	20.06.2024	\$ 430	\$ 0	0,00
CDX.EM-36 5-Year Index	1,000	20.12.2026	552	(1)	0,00
CDX.EM-38 5-Year Index	1,000	20.12.2027	100	2	0,00
				\$ 1	0,00

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt	variabler Zinssatz	Variablem Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS		0,500 %	16.03.2042	£ 2.200	\$ 27	0,01
Zahlung	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS		1,500	15.06.2052	12.100	(3.195)	(0,79)
Erhalt ⁽³⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS		2,000	15.03.2053	8.600	247	0,06
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS		0,000	16.06.2031	¥ 50.000	24	0,01
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS		0,450	20.03.2029	154.390	63	0,02
Zahlung	3-Month EUR-EURIBOR		0,526	21.11.2023	€ 1.500	(53)	(0,01)
Erhalt ⁽³⁾	3-Month USD-LIBOR		1,840	21.11.2028	\$ 3.100	255	0,06
Zahlung ⁽³⁾	3-Month USD-LIBOR		1,888	21.11.2053	600	(164)	(0,04)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR		0,000	04.11.2032	€ 1.200	(335)	(0,08)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR		0,000	08.11.2032	1.200	(324)	(0,08)
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR		0,190	04.11.2052	200	89	0,02
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR		0,195	04.11.2052	200	101	0,02
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR		0,197	08.11.2052	400	177	0,04
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR		0,650	12.04.2027	600	(62)	(0,02)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR		0,650	11.05.2027	300	(31)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR		0,700	11.04.2027	300	(30)	(0,01)
Erhalt ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR		0,830	09.12.2052	4.200	125	0,03
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR		1,000	13.05.2027	600	(53)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR		1,000	18.05.2027	200	(18)	0,00
Zahlung ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR		1,750	15.03.2033	17.300	(276)	(0,07)
Erhalt	CPTFEMU		2,359	15.08.2030	1.400	50	0,01
Erhalt	CPTFEMU		2,470	15.07.2032	1.100	42	0,01
Zahlung	CPTFEMU		2,590	15.12.2052	500	(6)	0,00
Erhalt	CPTFEMU		2,600	15.05.2032	2.400	87	0,02
Erhalt	CPTFEMU		2,720	15.06.2032	4.200	67	0,02
Erhalt	CPTFEMU		2,965	15.05.2027	10.700	384	0,09
Erhalt	CPTFEMU		2,980	15.06.2027	9.900	190	0,05
Erhalt	CPTFEMU		3,000	15.05.2027	1.900	64	0,02
Erhalt	CPTFEMU		3,130	15.05.2027	2.100	57	0,01
Zahlung	CPURNSA		1,280	19.05.2030	\$ 600	(37)	(0,01)
Erhalt	CPURNSA		1,794	24.08.2027	850	58	0,01
Erhalt	CPURNSA		1,798	25.08.2027	300	21	0,01

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Inflation Multi-Asset Fund (Forts.)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	CPURNSA	1,890 %	27.08.2027	\$ 500	\$ 35	0,01
Zahlung	CPURNSA	1,954	03.06.2029	750	(54)	(0,01)
Zahlung	CPURNSA	2,165	16.04.2029	500	(37)	(0,01)
Erhalt	CPURNSA	2,220	13.04.2023	1,380	106	0,03
Erhalt	CPURNSA	2,263	27.04.2023	80	6	0,00
Erhalt	CPURNSA	2,263	09.05.2023	300	23	0,01
Erhalt	CPURNSA	2,281	10.05.2023	460	35	0,01
Erhalt	CPURNSA	2,314	26.02.2026	400	29	0,01
Zahlung	CPURNSA	2,353	09.05.2028	300	(24)	(0,01)
Zahlung	CPURNSA	2,360	09.05.2028	450	(36)	(0,01)
Zahlung	CPURNSA	2,364	10.05.2028	460	(37)	(0,01)
Zahlung	CPURNSA	2,379	09.07.2028	300	(24)	(0,01)
Erhalt	CPURNSA	2,419	05.03.2026	700	51	0,01
Erhalt	CPURNSA	2,703	25.05.2026	300	22	0,01
Erhalt	CPURNSA	2,768	13.05.2026	500	37	0,01
Erhalt	CPURNSA	2,813	14.05.2026	300	22	0,01
Zahlung	FRCPTOXB	1,280	15.11.2034	€ 200	(45)	(0,01)
Zahlung	FRCPTOXB	1,590	15.02.2028	180	(32)	(0,01)
Zahlung	UKRPI	3,480	15.01.2030	£ 800	(162)	(0,04)
Zahlung	UKRPI	3,566	15.03.2036	500	(88)	(0,02)
Zahlung	UKRPI	3,850	15.09.2024	400	(86)	(0,02)
Erhalt	UKRPI	4,140	15.10.2031	1,900	143	0,03
Erhalt	UKRPI	4,143	15.10.2032	1,400	15	0,00
Erhalt	UKRPI	4,288	15.02.2032	3,200	221	0,05
Erhalt	UKRPI	4,300	15.01.2032	700	54	0,01
Erhalt	UKRPI	4,595	15.08.2032	5,000	(174)	(0,04)
Erhalt	UKRPI	4,615	15.02.2027	4,900	204	0,05
Erhalt	UKRPI	4,735	15.12.2026	400	42	0,01
Erhalt	UKRPI	5,200	15.06.2024	1,300	66	0,02
Erhalt	UKRPI	5,330	15.06.2024	4,000	190	0,05
Erhalt	UKRPI	6,600	15.05.2024	800	40	0,01
					\$ (1,914)	(0,47)
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					\$ (1,913)	(0,47)

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definieren.

(3) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

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

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

OPTIONSKAUF

ZINSSWAPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
BRC	Call – OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,410 %	02.02.2023	6.900	\$ 34	\$ 0	0,00
CBK	Call – OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,720	23.02.2023	4.800	26	0	0,00
DUB	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,237	17.11.2023	2.300	143	511	0,13
GLM	Call – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,200	26.04.2023	8.100	86	5	0,00
JPM	Call – OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,710	25.01.2023	5.000	31	0	0,00
MYC	Call – OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,428	31.01.2023	7.000	36	0	0,00
	Call – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,200	31.05.2023	23.000	276	28	0,01
							\$ 632	\$ 544	0,14

VERKAUFSOPTIONEN

CREDIT DEFAULT SWAPTIONS AUF KREDITINDIZES

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/ -verkauf	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
GST	Put – OTC iTraxx Europe 37 5-Year Index	Verkauf	3,000 %	15.03.2023	1.200	\$ (2)	\$ 0	0,00

INFLATION-CAPPED OPTIONS

Kontrahent	Beschreibung	Anfänglicher Index	Variabler Zinssatz	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
GLM	Cap – OTC CPALEMU	USD 100,151	Maximal [(Index Final/Index Initial - 1) - 3,000 %] oder 0	22.06.2035	300	\$ (14)	\$ (15)	(0,01)

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Netto- vermögens
BRC	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,558 %	02.02.2023	1.500	\$ (34)	\$ 0	0,00
CBK	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,736	23.02.2023	1.100	(27)	0	0,00
DUB	Put – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,340	17.11.2023	11.200	(141)	(726)	(0,18)
GLM	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,350	26.04.2023	4.500	(89)	(8)	0,00
	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,547	07.03.2023	1.600	(35)	(4)	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,547	07.03.2023	1.600	(35)	(101)	(0,02)
	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,067	09.06.2023	1.900	(22)	(5)	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	3,140	09.06.2023	1.900	(26)	(62)	(0,02)
JPM	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,785	25.01.2023	1.100	(31)	0	0,00
MYC	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,579	31.01.2023	1.500	(35)	0	0,00
	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,350	31.05.2023	12.700	(277)	(37)	(0,01)
							\$ (752)	\$ (943)	(0,23)

⁽¹⁾ Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Kontrahent	Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag ⁽²⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Netto- vermögens
GST	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500 %	17.11.2059	\$ 200	\$ (6)	\$ 6	\$ 0	0,00
MYC	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	800	(26)	24	(2)	0,00
SAL	CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17.08.2061	200	0	(2)	(2)	0,00
UAG	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	400	(12)	11	(1)	0,00
					\$ (44)	\$ 39	\$ (5)	0,00

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

⁽²⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definieren.

ZINSSWAPS

Kontrahent	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Netto- vermögens
MYC	Erhalt	CPURNSA	1,800 %	20.07.2026	\$ 600	\$ 0	\$ (86)	\$ (86)	(0,02)
	Erhalt	CPURNSA	1,805	20.09.2026	50	0	(7)	(7)	0,00
	Erhalt	CPURNSA	1,810	19.07.2026	500	0	(72)	(72)	(0,02)
						\$ 0	\$ (165)	\$ (165)	(0,04)

TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES

Kontrahent	Zahlung/Erhalt	Wertpapier	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Variabler Zinssatz	Nenn-betrag	Fälligkeits-datum	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Netto- vermögens
BPS	Erhalt	BCOMF1TC Index	30.040	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	\$ 3.267	15.02.2023	\$ 0	\$ (28)	\$ (28)	(0,01)
	Erhalt	BCOMTR Index	138.583	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	34.312	15.02.2023	0	(300)	(300)	(0,07)
	Erhalt	TRNGLU Index	1.133	1-Month USD-LIBOR abzgl. eines bestimmten Spreads	5.096	24.05.2023	0	(17)	(17)	0,00
	Erhalt	TRNGLU Index	2.052	1-Month USD-LIBOR abzgl. eines bestimmten Spreads	9.230	12.07.2023	0	(28)	(28)	(0,01)
BRC	Erhalt	Dow Jones U.S. Select REIT Total Return Index	486	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	5.357	21.06.2023	0	(21)	(21)	(0,01)
CBK	Erhalt	BCOMF1TC Index	21.724	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	2.699	15.02.2023	0	(23)	(23)	(0,01)
	Erhalt	BCOMTR Index	24.694	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	6.114	15.02.2023	0	(53)	(53)	(0,01)
GST	Erhalt	BCOMF1TC Index	7.093	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	2.858	15.02.2023	0	(25)	(25)	(0,01)
	Erhalt	BCOMTR Index	42.761	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	10.587	15.02.2023	0	(93)	(93)	(0,02)
JPM	Erhalt	BCOMF1TC Index	28.657	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	6.040	15.02.2023	0	(53)	(53)	(0,01)
	Erhalt	JMABDEWU Index	16.708	0,053 %	2.589	15.02.2023	0	34	34	0,01

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Inflation Multi-Asset Fund (Forts.)

Kontrahent	Zahlung/ Erhalt	Wertpapier	Anzahl der oder Einheiten	Variable Zinssatz	Nenn- betrag	Fälligkeits- datum	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Netto- vermögens
	Erhalt	Dow Jones U.S. Select REIT Total Return Index	447	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	\$ 4.927	13.09.2023	\$ 0	\$ (19)	\$ (19)	(0,01)
MAC	Erhalt	JMABNIUS Index	8.536	0,000	1.514	15.02.2024	0	55	55	0,01
MYI	Erhalt	PIMCO DBU Index	45.417	0,160	7.163	15.03.2023	0	192	192	0,05
	Erhalt	Dow Jones U.S. Select REIT Total Return Index	664	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	7.723	04.01.2023	0	(362)	(362)	(0,09)
SOG	Erhalt	BCOMTR Index	22.026	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	5.453	15.02.2023	0	(48)	(48)	(0,01)
								\$ 0	\$ (789)	(0,20)

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2023	AUD	\$	2.513	1.702	0	0,00
	01.2023	CZK		6.514	278	0	0,00
	01.2023	£		271	329	3	0,00
	01.2023	\$	HUF	1.786	808.299	361	0,09
	01.2023		RON	119	601	11	0,00
	01.2023		ZAR	175	3.108	8	0,00
	02.2023			367	6.582	18	0,00
BPS	01.2023		ILS	901	3.087	0	(0,01)
	01.2023		THB	7	236	0	0,00
	03.2023	TWD	\$	11.371	377	5	0,00
	03.2023	\$	CLP	580	560.527	70	0,02
	03.2023		COP	942	4.610.549	0	(0,00)
	03.2023		INR	5.088	422.091	0	(0,00)
	03.2023		MXN	2.734	54.988	50	0,01
BRC	01.2023	PLN	\$	1.060	211	0	(0,01)
	01.2023	\$	€	229	215	1	0,00
	01.2023		MYR	2.399	11.314	189	0,05
	01.2023		PHP	1.365	76.217	6	0,00
	01.2023		SEK	442	4.632	2	0,00
	01.2023		SGD	5.547	7.470	24	0,01
CBK	01.2023	CLP	\$	1.167.517	1.312	0	(0,01)
	01.2023	¥		106.400	772	0	(0,01)
	01.2023	KRW		739.855	587	0	0,00
	01.2023	PLN		1.838	404	0	(0,00)
	01.2023	\$	BRL	3.373	17.705	0	(0,01)
	01.2023		CHF	241	227	5	0,00
	01.2023		CLP	1.225	1.167.123	144	0,04
	01.2023		DKK	302	2.100	0	0,00
	01.2023		€	280	265	3	0,00
	02.2023		\$	1.398	259	0	(0,00)
	02.2023	PEN		783	196	0	(0,00)
	02.2023	\$	CLP	1.312	1.173.947	58	0,01
	03.2023		MXN	2.494	48.920	0	(0,01)
	03.2023		PEN	22	89	1	0,00
	05.2023		MXN	1	20	0	0,00
DUB	01.2023		TRY	1.158	23.693	98	0,02
	03.2023	MXN	\$	3.810	191	0	(0,00)
GLM	01.2023	BRL		16.168	3.034	0	(0,01)
	01.2023	\$	HKD	228	1.772	0	0,00
	01.2023		MYR	543	2.403	6	0,00
	01.2023		PLN	4.078	20.678	632	0,16
	01.2023		THB	3.101	108.068	24	0,01
	01.2023		ZAR	376	6.723	19	0,00
	03.2023	CLP	\$	841.670	924	0	(0,01)
	03.2023	COP		1.525.581	316	6	0,00
	03.2023	\$	COP	316	1.525.581	0	(0,00)
	03.2023		MXN	2.520	51.804	102	0,02
	04.2023		BRL	2.981	16.168	29	0,01
	05.2023		PEN	609	2.426	21	0,01
	05.2023		ZAR	55	917	0	(0,00)
JPM	01.2023	BRL	\$	1.537	285	0	(0,00)
	01.2023	\$	CNY	2.095	14.579	17	0,00
	02.2023		TWD	1.590	48.286	0	(0,00)
	03.2023	MXN	\$	3.810	191	0	(0,00)
	03.2023	\$	CNY	3.762	26.025	22	0,01
	03.2023		IDR	859	13.450.001	10	0,00
MBC	01.2023	AUD	\$	347	236	1	0,00
	01.2023	CAD		1.418	1.057	11	0,00
	01.2023	DKK		89.230	12.477	0	(0,08)
	01.2023	€		28.001	29.320	0	(0,14)
	01.2023	£		18.926	23.066	297	0,07
	01.2023	¥		2.736.000	20.193	0	(0,14)
	01.2023	TRY		9.734	500	0	(0,16)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	01.2023	\$ 945	HKD 7.354	\$ 0	\$ (2)	\$ (2)	0,00
	01.2023	486	¥ 63.900	0	(1)	(1)	0,00
	02.2023	MXN 19.605	\$ 956	0	(43)	(43)	(0,01)
	03.2023	COP 3.084.968	676	48	0	48	0,01
	03.2023	\$ 521	IDR 8.163.450	6	0	6	0,00
MYI	01.2023	PHP 13.723	\$ 246	0	(1)	(1)	0,00
	01.2023	\$ 1.530	€ 1.436	3	0	3	0,00
	01.2023	44	£ 36	0	0	0	0,00
	01.2023	301	MYR 1.427	25	0	25	0,01
	02.2023	2.928	TWD 89.271	0	(12)	(12)	0,00
	03.2023	733	IDR 11.502.163	10	0	10	0,00
RBC	01.2023	MYR 1.431	\$ 314	0	(14)	(14)	0,00
	03.2023	MXN 9.927	496	0	(7)	(7)	0,00
SCX	01.2023	\$ 6.423	KRW 8.486.953	323	0	323	0,08
	03.2023	INR 1.012	\$ 12	0	0	0	0,00
SOG	01.2023	\$ 1.199	RON 6.091	114	0	114	0,03
UAG	01.2023	£ 223	\$ 276	8	0	8	0,00
	01.2023	HUF 91.232	217	0	(25)	(25)	(0,01)
	01.2023	RON 1.099	234	0	(3)	(3)	0,00
	01.2023	\$ 2.715	CZK 69.037	334	0	334	0,08
	01.2023	1.856	TRY 37.988	158	0	158	0,04
	03.2023	223	ZAR 3.977	10	0	10	0,00
				\$ 3.293	\$ (1.950)	\$ 1.343	0,33

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilsklasse E AUD (Partially Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	01.2023	\$ 76	AUD 112	\$ 1	\$ 0	\$ 1	0,00
BOA	01.2023	78	116	0	0	0	0,00
CBK	01.2023	2	3	0	0	0	0,00
SCX	01.2023	KRW 163	\$ 0	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 16	AUD 24	0	0	0	0,00
				\$ 1	\$ 0	\$ 1	0,00

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Partially Hedged) thesaurierend, E EUR (Partially Hedged) thesaurierend und E EUR (Partially Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2023	€ 356	\$ 375	\$ 0	\$ (5)	\$ (5)	0,00
BPS	01.2023	394	421	0	0	0	0,00
CBK	01.2023	4.017	4.262	0	(28)	(28)	(0,01)
	01.2023	\$ 17.090	€ 16.457	481	0	481	0,12
MBC	01.2023	€ 3.206	\$ 3.407	0	(16)	(16)	0,00
	01.2023	\$ 81.631	€ 77.894	1.537	0	1.537	0,38
SCX	01.2023	73.026	70.160	1.884	0	1.884	0,47
				\$ 3.902	\$ (49)	\$ 3.853	0,96

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Partially Hedged) thesaurierend und E GBP (Partially Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2023	\$ 134	£ 110	\$ 0	\$ (2)	\$ (2)	0,00
BPS	01.2023	£ 1	\$ 2	0	0	0	0,00
BRC	01.2023	15	18	0	0	0	0,00
	01.2023	SGD 3	2	0	0	0	0,00
JPM	01.2023	\$ 1.311	£ 1.086	0	(5)	(5)	0,00
MBC	01.2023	547	452	1	(3)	(2)	0,00
MYI	01.2023	£ 51	\$ 62	2	0	2	0,00
	01.2023	\$ 49	£ 40	0	(1)	(1)	0,00
SCX	01.2023	KRW 3.096	\$ 2	0	0	0	0,00
TOR	01.2023	\$ 1.294	£ 1.076	1	0	1	0,00
UAG	01.2023	31	25	0	(1)	(1)	0,00
				\$ 4	\$ (12)	\$ (8)	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Inflation Multi-Asset Fund (Forts.)

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilsklassen Administrative SGD (Hedged) ausschüttend II und E SGD (Partially Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2023	\$ 2.490	SGD 3.419	\$ 60	\$ 0	\$ 60	0,01
BPS	01.2023	2.664	3.653	60	0	60	0,01
GLM	01.2023	SGD 11	\$ 8	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 15	SGD 21	0	0	0	0,00
MBC	01.2023	SGD 48	\$ 36	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 1.136	SGD 1.553	22	0	22	0,01
SCX	01.2023	SGD 17	\$ 13	0	0	0	0,00
UAG	01.2023	339	248	0	(5)	(5)	0,00
				\$ 142	\$ (5)	\$ 137	0,03
Summe Freiverkehrsfina n z d e r i v a t e						\$ 3.953	0,98
Summe Anlagen						\$ 433.837	107,63
Sonstige Aktiva und Passiva						\$ (30.759)	(7,63)
Nettovermögen						\$ 403.078	100,00

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

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

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

- (a) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.
- (b) Nullkuponwertpapier.
- (c) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.
- (d) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.
- (e) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.
- (f) Mit dem Fonds verbunden.

Barmittel in Höhe von 5.919 USD (31. Dezember 2021: 2.100 USD) wurden zum 31. Dezember 2022 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 2.260 USD (31. Dezember 2021: 260 USD) wurden gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. zum 31. Dezember 2022 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 8.543	\$ 311.578	\$ 0	\$ 320.121
Investmentfonds	68.975	0	0	68.975
Pensionsgeschäfte	0	40.720	0	40.720
Finanzderivate ⁽³⁾	1.933	2.088	0	4.021
Summen	\$ 79.451	\$ 354.386	\$ 0	\$ 433.837

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

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 20.179	\$ 122.440	\$ 0	\$ 142.619
Investmentfonds	12.603	7.844	0	20.447
Pensionsgeschäfte	0	500	0	500
Finanzderivate ⁽³⁾	519	(138)	0	381
Summen	\$ 33.301	\$ 130.646	\$ 0	\$ 163.947

⁽¹⁾ Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

⁽²⁾ Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

⁽³⁾ Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung des Marktwerts der außerbörslich gehandelten Finanzderivate und (erhaltenen)/verpfändeten Sicherheiten nach Kontrahenten zum 31. Dezember 2022 und 31. Dezember 2021:

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2022			Zum 31. Dez. 2021		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾
AZD	\$ 1	\$ 0	\$ 1	\$ k. A.	\$ k. A.	\$ k. A.
BOA	441	(240)	201	62	0	62
BPS	(230)	620	390	538	(280)	258
BRC	170	170	340	45	0	45
CBK	430	(240)	190	175	(260)	(85)
DUB	(119)	0	(119)	(2)	0	(2)
FAR	k. A.	k. A.	k. A.	(1)	0	(1)
FBF	k. A.	k. A.	k. A.	15	0	15
GLM	557	(550)	7	(10)	(280)	(290)
GST	(118)	260	142	90	0	90
HUS	k. A.	k. A.	k. A.	(59)	0	(59)
IND	k. A.	k. A.	k. A.	3	0	3
JPM	40	400	440	402	(330)	72
MAC	192	0	192	4	0	4
MBC	375	(200)	175	k. A.	k. A.	k. A.
MYC	(176)	260	84	(139)	0	(139)
MYI	(336)	550	214	193	(260)	(67)
RBC	(21)	0	(21)	9	0	9
RYL	k. A.	k. A.	k. A.	11	0	11
SAL	(2)	0	(2)	(6)	0	(6)
SCX	2.207	(260)	1.947	337	(280)	57
SOG	66	0	66	39	260	299
SSB	k. A.	k. A.	k. A.	76	0	76
TOR	1	0	1	89	0	89
UAG	475	(530)	(55)	32	(270)	(238)

⁽¹⁾ Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2022:

	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	53,86	80,61
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	24,35	5,58
Sonstige übertragbare Wertpapiere	1,21	0,60
Investmentfonds	17,11	12,44
Pensionsgeschäfte	10,10	0,30
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,49	0,23
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,47)	(1,16)
Freiverkehrsfinauzderivate	0,98	1,16

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2022 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
Unternehmensanleihen und Wechsel	3,02	9,40
US-Regierungsbehörden	10,47	2,73
US-Schatzobligationen	29,26	25,38
Non-Agency-MBS	4,06	1,28
Forderungsbesicherte Wertpapiere	3,00	1,81
Staatsemissionen	20,01	33,33
Stammaktien	0,37	6,22
Vorzugswertpapiere	0,14	0,58
Real Estate Investment Trusts	1,75	6,06
Kurzfristige Instrumente	7,34	k. A.
Investmentfonds	17,11	12,44
Pensionsgeschäfte	10,10	0,30
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,49	0,23
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,00	0,00
Zinsswaps	(0,47)	(1,16)
Freiverkehrsfinauzderivate		
Optionskauf		
Zinsswapoptionen	0,14	0,14
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes	0,00	0,00
Inflation-Capped Options	(0,01)	0,00
Zinsswapoptionen	(0,23)	(0,15)
Optionen auf Wertpapiere	k. A.	(0,01)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,00	0,01
Zinsswaps	(0,04)	(0,09)
Total Return Swaps auf Indizes	(0,20)	0,47
Total Return Swaps auf Wertpapiere	k. A.	0,09
Devisenterminkontrakte	0,33	0,22
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,99	0,48
Sonstige Aktiva und Passiva	(7,63)	0,24
Nettovermögen	100,00	100,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Low Average Duration Fund

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE											
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL											
BANKEN UND FINANZEN											
NatWest Group PLC 7,472 % fällig am 10.11.2026				\$ 1.300	\$ 1.354	0,13		Hyundai Capital America 1,000 % fällig am 17.09.2024	\$ 3.000	\$ 2.774	0,26
NatWest Markets PLC 3,479 % fällig am 22.03.2025				4.000	3.828	0,36		Illumina, Inc. 5,800 % fällig am 12.12.2025	1.500	1.512	0,14
NTT Finance Corp. 0,373 % fällig am 03.03.2023				3.000	2.983	0,28		Mercedes-Benz Finance North America LLC 5,500 % fällig am 27.11.2024	3.900	3.925	0,37
Pricoa Global Funding 4,200 % fällig am 28.08.2025				2.700	2.649	0,25		Nissan Motor Co. Ltd. 3,043 % fällig am 15.09.2023	3.600	3.528	0,33
Santander Holdings USA, Inc. 3,450 % fällig am 02.06.2025				2.700	2.575	0,24		NXP BV 4,875 % fällig am 01.03.2024	2.700	2.681	0,25
Santander UK Group Holdings PLC 6,833 % fällig am 21.11.2026				2.300	2.332	0,22		Penske Truck Leasing Co. LP 1,700 % fällig am 15.06.2026	3.300	2.891	0,27
SOCAR Turkey Enerji AS Via Steas Funding DAC 7,230 % fällig am 17.03.2026				4.000	3.910	0,36		Philip Morris International, Inc. 5,125 % fällig am 15.11.2024	3.900	3.908	0,36
Societe Generale S.A. 2,625 % fällig am 22.01.2025				2.500	2.352	0,22		Reliance Steel & Aluminum Co. 1,300 % fällig am 15.08.2025	3.900	3.528	0,33
Standard Chartered PLC 1,822 % fällig am 23.11.2025				2.600	2.377	0,22		Renesas Electronics Corp. 2,170 % fällig am 25.11.2026	2.800	2.403	0,22
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd. 0,800 % fällig am 12.09.2023				3.100	3.008	0,28		SK Hynix, Inc. 1,000 % fällig am 19.01.2024	2.900	2.756	0,26
Swedbank AB 3,356 % fällig am 04.04.2025				4.000	3.848	0,36		Southern Co. 3,250 % fällig am 01.07.2026	2.100	1.977	0,18
Toyota Motor Credit Corp. 5,050 % fällig am 11.12.2023				800	801	0,07		Sydney Airport Finance Co. Pty. Ltd. 3,900 % fällig am 22.03.2023	500	499	0,05
UBS Group AG 4,125 % fällig am 24.09.2025				800	779	0,07		TD SYNnex Corp. 1,250 % fällig am 09.08.2024	4.300	3.996	0,37
4,488 % fällig am 12.05.2026				4.000	3.913	0,36		VMware, Inc. 1,000 % fällig am 15.08.2024	2.700	2.514	0,23
4,703 % fällig am 05.08.2027				1.600	1.549	0,14		Volkswagen Group of America Finance LLC 3,125 % fällig am 12.05.2023	3.300	3.274	0,31
UniCredit SpA 7,830 % fällig am 04.12.2023				6.350	6.417	0,60		WRKCo, Inc. 3,750 % fällig am 15.03.2025	2.700	2.614	0,24
Volkswagen Financial Services NV 1,125 % fällig am 18.09.2023	£	600		704	0,07					95.471	8,90
Wells Fargo & Co. 2,125 % fällig am 20.12.2023				900	1.056	0,10					
3,908 % fällig am 25.04.2026				\$ 2.700	2.627	0,24					
4,808 % fällig am 25.07.2028				4.000	3.913	0,36					
					175.598	16,37					
INDUSTRIEWERTE								VERSORGUNGSUNTERNEHMEN			
7-Eleven, Inc. 0,625 % fällig am 10.02.2023				2.900	2.885	0,27		AES Corp. 1,375 % fällig am 15.01.2026	3.200	2.845	0,26
ASTM SpA 1,000 % fällig am 25.11.2026	€	2.500		2.289	0,21			Atmos Energy Corp. 5,103 % fällig am 09.03.2023	3.600	3.598	0,34
Boeing Co. 1,167 % fällig am 04.02.2023	\$	3.500		3.487	0,33			Constellation Energy Generation LLC 3,250 % fällig am 01.06.2025	2.600	2.490	0,23
1,950 % fällig am 01.02.2024		3.500		3.373	0,32			Enel Finance International NV 2,650 % fällig am 10.09.2024	4.000	3.830	0,36
CenterPoint Energy Resources Corp. 5,279 % fällig am 02.03.2023				1.725	1.724	0,16		6,800 % fällig am 14.10.2025	1.900	1.953	0,18
Chanel Ceres PLC 0,500 % fällig am 31.07.2026	€	2.800		2.693	0,25			Eversource Energy 0,800 % fällig am 15.08.2025	3.000	2.691	0,25
Comcast Corp. 5,250 % fällig am 07.11.2025	\$	1.100		1.116	0,10			Pacific Gas & Electric Co. 3,150 % fällig am 01.01.2026	3.300	3.070	0,29
CommonSpirit Health 1,547 % fällig am 01.10.2025				2.900	2.610	0,24		3,400 % fällig am 15.08.2024 ^	500	480	0,04
Continental Resources, Inc. 2,268 % fällig am 15.11.2026				2.900	2.517	0,24		3,850 % fällig am 15.11.2023 ^	1.000	986	0,09
CRH America, Inc. 3,875 % fällig am 18.05.2025				2.700	2.607	0,24		4,250 % fällig am 01.08.2023	3.100	3.085	0,29
Daimler Trucks Finance North America LLC 1,125 % fällig am 14.12.2023				3.000	2.883	0,27		4,950 % fällig am 08.06.2025	2.500	2.464	0,23
4,779 % fällig am 14.06.2023				3.300	3.296	0,31		SSE PLC 1,250 % fällig am 16.04.2025	€ 2.200	2.222	0,21
4,918 % fällig am 14.12.2023				3.000	2.982	0,28				29.714	2,77
5,062 % fällig am 13.12.2024				2.800	2.763	0,26				300.783	28,04
Danone S.A. 2,947 % fällig am 02.11.2026				2.400	2.234	0,21		Summe Unternehmensanleihen und Wechsel			
Dell International LLC 5,450 % fällig am 15.06.2023				240	240	0,02					
Elevance Health, Inc. 3,350 % fällig am 01.12.2024				1.000	970	0,09		US-REGIERUNGSBEHÖRDEN			
Expedia Group, Inc. 5,000 % fällig am 15.02.2026				3.393	3.352	0,31		Fannie Mae 0,000 % fällig am 25.04.2040			
Fidelity National Information Services, Inc. 0,375 % fällig am 01.03.2023				3.000	2.978	0,28		(a)(c)	\$ 138	106	0,01
Global Erhaltung, Inc. 4,950 % fällig am 15.08.2027				3.800	3.692	0,34		1,000 % fällig am 25.01.2043	57	48	0,01
								1,978 % fällig am 01.01.2035	16	16	0,00
								2,022 % fällig am 01.01.2035	3	3	0,00
								2,276 % fällig am 01.12.2034	14	14	0,00
								2,550 % fällig am 01.03.2035	1	1	0,00
								2,888 % fällig am 01.06.2043	21	20	0,00
								2,889 % fällig am 01.07.2042	19	18	0,00
								2,939 % fällig am 01.09.2041	48	46	0,01
								3,153 % fällig am 01.12.2034	3	3	0,00
								3,462 % fällig am 01.05.2038	608	617	0,06
								3,647 % fällig am 01.01.2035	5	5	0,00
								3,821 % fällig am 25.07.2037	17	17	0,00
								3,952 % fällig am 01.07.2035	2	2	0,00
								3,971 % fällig am 01.08.2035	100	102	0,01
								4,739 % fällig am 25.12.2036 - 25.03.2044	1.552	1.523	0,14

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Low Average Duration Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
ISRAEL TREASURY BILLS				INVESTMENTFONDS				BÖRSENGEHANDELTE FONDS			
0,020 % fällig am 04.01.2023 (c)(d)	ILS 9.000	2.550	0,24	ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN				PIMCO ETFs plc – PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (e)			
0,788 % fällig am 02.03.2023 (c)(d)	13.000	3.663	0,34	PIMCO Funds: Global Investors Series plc – US Short-Term Fund (e)	3.225.365	\$ 32.189	3,00	484.660	\$	48.013	4,47
0,886 % fällig am 03.05.2023 (c)(d)	15.500	4.341	0,40	PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (e)	545.394	5.429	0,51	Summe Investmentfonds			7,98
		10.554	0,98					\$	85.631		
Summe kurzfristige Instrumente		13.624	1,27								
Summe Übertragbare Wertpapiere		\$ 1.235.606	115,18			37.618	3,51				

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft ⁽¹⁾	% des Netto- vermögens
FICC	1,900 %	30.12.2022	03.01.2023	\$ 956	U.S. Treasury Notes 0,125 % fällig am 15.05.2023	\$ (975)	\$ 956	\$ 956	0,09
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (975)	\$ 956	\$ 956	0,09

⁽¹⁾ Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Euro-Bobl March Futures	Short	03.2023	265	\$ 959	0,09
Euro-Bund 10-Year Bond March Futures	Long	03.2023	33	(302)	(0,03)
Japan Government 10-Year Bond March Futures	Short	03.2023	42	847	0,08
U.S. Treasury 2-Year Note March Futures	Long	03.2023	1.530	189	0,02
U.S. Treasury 5-Year Note March Futures	Long	03.2023	355	(48)	0,00
U.S. Treasury 10-Year Note March Futures	Short	03.2023	373	113	0,01
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond March Futures	Short	03.2023	261	47	0,00
United Kingdom Long Gilt March Futures	Short	03.2023	58	456	0,04
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ 2.261	0,21

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag ⁽³⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000 %	20.12.2024	\$ 1.000	\$ 0	0,00

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF⁽²⁾

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag ⁽³⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.HY-38 5-Year Index	(5,000) %	20.06.2027	\$ 22.770	\$ (636)	(0,06)
CDX.IG-39 5-Year Index	(1,000)	20.12.2027	132.000	(154)	(0,01)
				\$ (790)	(0,07)

ZINSSWAPS

Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000%	17.03.2024	¥ 5.680.000	USD (141)	(0,01)
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,380	18.06.2028	90.000	(23)	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,000	21.12.2032	\$ 11.700	321	0,03
Erhalt ⁽⁴⁾	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,270	13.09.2024	5.000	7	0,00
Erhalt ⁽⁴⁾	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,350	14.09.2024	3.200	2	0,00

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fest- Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung ⁽¹⁾	3-Month NZD-BBR	4,000 %	14.06.2024	NZD 279.100	\$ (2.064)	(0,19)
Zahlung ⁽²⁾	3-Month NZD-BBR	4,500	13.09.2024	8.800	(51)	(0,01)
Zahlung ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	1,580	24.05.2024	€ 144.500	(3.167)	(0,30)
					\$ (5.116)	(0,48)
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					\$ (5.906)	(0,55)

- ⁽¹⁾ Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definieren, dann zahlt der Teilfonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückzahlungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.
- ⁽²⁾ Agiert der Teilfonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definieren, dann erhält der Teilfonds entweder (i) vom Sicherungsgeber einen Betrag in Höhe des Nennwerts des Swaps und liefert die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er erhält einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückzahlungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.
- ⁽³⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definieren.
- ⁽⁴⁾ Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

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

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

OPTIONSKAUF

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Kosten	Markt- wert	% des Netto- vermögens
BOA	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,750 %	12.09.2023	12.600	\$ 101	\$ 102	0,01
FAR	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,750	11.09.2023	11.800	89	96	0,01
MYC	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,750	11.09.2023	10.700	81	87	0,01
							\$ 271	\$ 285	0,03

VERKAUFSoPTIONEN

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Netto- vermögens
BOA	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,250 %	12.09.2023	12.600	\$ (63)	\$ (64)	(0,01)
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,750	12.09.2023	12.600	(38)	(36)	0,00
CBK	Call – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,150	09.01.2023	20.500	(72)	0	0,00
	Put – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	09.01.2023	20.500	(72)	(124)	(0,01)
FAR	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,233	11.09.2023	11.800	(56)	(61)	(0,01)
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,715	11.09.2023	11.800	(33)	(35)	0,00
GLM	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,088	03.11.2023	26.600	(193)	(41)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,088	03.11.2023	26.600	(193)	(317)	(0,03)
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,250	17.11.2023	40.700	(148)	(28)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	17.11.2023	40.700	(148)	(291)	(0,03)
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,250	07.12.2023	14.800	(46)	(12)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	07.12.2023	14.800	(46)	(102)	(0,01)
MYC	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,233	11.09.2023	10.700	(51)	(55)	(0,01)
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,715	11.09.2023	10.700	(30)	(32)	0,00
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,993	11.10.2023	53.500	(361)	(71)	(0,01)
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,993	11.10.2023	53.500	(361)	(725)	(0,07)
							\$ (1.911)	\$ (1.994)	(0,19)

OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
BOA	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.02.2053	\$ 99,813	06.02.2023	1.200	\$ (8)	\$ (7)	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.02.2053	101,813	06.02.2023	1.200	(7)	(3)	0,00
SAL	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.01.2053	101,859	05.01.2023	1.500	(5)	0	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.01.2053	102,250	05.01.2023	1.100	(3)	0	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.02.2053	100,000	06.02.2023	500	(4)	(3)	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.02.2053	102,000	06.02.2023	500	(3)	(1)	0,00
					\$ (30)	\$ (14)	0,00

⁽¹⁾ Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Low Average Duration Fund (Forts.)

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽²⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	South Africa Government International Bond	1,000 %	20.12.2026	\$ 2.000	\$ (94)	\$ 17	\$ (77)	(0,01)
CBK	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2026	5.600	(270)	53	(217)	(0,02)
MYC	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2027	1.900	(108)	(5)	(113)	(0,01)
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2027	2.300	(205)	38	(167)	(0,02)
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2026	4.200	(195)	32	(163)	(0,01)
					\$ (872)	\$ 135	\$ (737)	(0,07)

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

⁽²⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definieren.

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2023	HUF 39.173	\$ 100	\$ 0	\$ (4)	\$ (4)	0,00
	01.2023	\$ 1.429	AUD 2.110	2	0	2	0,00
	01.2023	178	ZAR 3.161	8	0	8	0,00
	02.2023	€ 1.698	\$ 1.799	0	(18)	(18)	0,00
	02.2023	£ 36.469	43.033	0	(885)	(885)	(0,08)
	02.2023	¥ 63.500	462	0	(22)	(22)	0,00
	03.2023	ZAR 128.091	7.254	0	(230)	(230)	(0,02)
BPS	01.2023	HUF 285.055	749	0	(11)	(11)	0,00
	02.2023	€ 82.883	85.945	0	(2.767)	(2.767)	(0,26)
	03.2023	MXN 1.089	54	0	(1)	(1)	0,00
BRC	02.2023	\$ 655	€ 632	22	0	22	0,00
	02.2023	1.016	£ 832	0	(14)	(14)	0,00
CBK	01.2023	ILS 8.998	\$ 2.848	298	0	298	0,03
	01.2023	\$ 5.504	BRL 28.885	0	(33)	(33)	0,00
	01.2023	412	ZAR 7.219	11	0	11	0,00
	02.2023	BRL 3.245	\$ 601	0	(10)	(10)	0,00
	02.2023	€ 98	105	0	0	0	0,00
	02.2023	NZD 3.083	1.870	0	(81)	(81)	(0,01)
	02.2023	PEN 22.466	5.586	0	(277)	(277)	(0,03)
	02.2023	\$ 2.738	PEN 10.990	134	0	134	0,01
	03.2023	ILS 12.934	\$ 3.921	244	0	244	0,02
	03.2023	\$ 100	PEN 393	2	0	2	0,00
	04.2023	757	3.030	30	0	30	0,00
	05.2023	ILS 15.370	\$ 4.658	270	0	270	0,02
CLY	01.2023	HUF 182.434	464	0	(22)	(22)	0,00
GLM	01.2023	BRL 28.885	5.420	0	(51)	(51)	0,00
	01.2023	CNH 169	24	0	0	0	0,00
	01.2023	HUF 110.387	283	0	(12)	(12)	0,00
	04.2023	\$ 5.325	BRL 28.885	52	0	52	0,00
JPM	01.2023	HUF 7.829	\$ 20	0	(1)	(1)	0,00
	01.2023	\$ 793	CNY 5.516	6	0	6	0,00
	03.2023	1.423	9.848	8	0	8	0,00
MBC	01.2023	AUD 486	\$ 326	0	(4)	(4)	0,00
	02.2023	£ 46	55	0	0	0	0,00
	02.2023	\$ 2.513	€ 2.385	40	0	40	0,00
	03.2023	6.863	ZAR 128.091	622	0	622	0,06
	05.2023	CNH 23.846	\$ 3.553	73	0	73	0,01
MYI	01.2023	AUD 15.399	10.341	0	(104)	(104)	(0,01)
	01.2023	€ 24	26	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 13	£ 11	0	0	0	0,00
RBC	01.2023	AUD 177	\$ 119	0	(1)	(1)	0,00
SCX	01.2023	1.033	696	0	(5)	(5)	0,00
	01.2023	\$ 1.725	PEN 6.926	88	0	88	0,01
	02.2023	NZD 798	\$ 485	0	(20)	(20)	0,00
	04.2023	ZAR 107.762	5.858	0	(423)	(423)	(0,04)
UAG	01.2023	HUF 531.467	1.386	0	(31)	(31)	0,00
	02.2023	\$ 2.183	ZAR 40.667	199	0	199	0,02
	03.2023	226	4.045	10	0	10	0,00
	05.2023	3.395	CNH 23.527	38	0	38	0,00
				\$ 2.157	\$ (5.027)	\$ (2.870)	(0,27)

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend und E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Netto- vermögens
BOA	01.2023	\$ 11	€ 10	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
BPS	01.2023	€ 238	\$ 254	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 379	€ 355	0	0	0	0,00
CBK	01.2023	€ 48	\$ 51	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 22.385	€ 21.579	656	0	656	0,06
JPM	01.2023	4.291	4.127	115	0	115	0,01
MBC	01.2023	€ 1.071	\$ 1.133	0	(11)	(11)	0,00
	01.2023	\$ 24.359	€ 23.236	451	0	451	0,05
SCX	01.2023	24.703	23.733	637	0	637	0,06
				\$ 1.859	\$ (11)	\$ 1.848	0,18

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend und Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Netto- vermögens
BOA	01.2023	£ 38	\$ 46	\$ 1	\$ 0	\$ 1	0,00
	01.2023	\$ 37	£ 31	0	0	0	0,00
BRC	01.2023	£ 11	\$ 13	0	0	0	0,00
JPM	01.2023	\$ 8.130	£ 6.733	0	(31)	(31)	0,00
MBC	01.2023	8.167	6.816	35	(2)	33	0,00
MYI	01.2023	£ 37	\$ 46	1	0	1	0,00
TOR	01.2023	\$ 8.105	£ 6.741	5	0	5	0,00
UAG	01.2023	33	26	0	(1)	(1)	0,00
				\$ 42	\$ (34)	\$ 8	0,00
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						\$ (3.474)	(0,32)

LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖGENS
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN			
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA			
3,000 % fällig am 01.02.2053	\$ 55.500	\$ (48.764)	(4,54)
3,500 % fällig am 01.02.2053	31.000	(28.185)	(2,63)
Summe Leerverkaufte Wertpapiere		\$ (76.949)	(7,17)
Summe Anlagen		\$ 1.238.125	115,42
Sonstige Aktiva und Passiva		\$ (165.367)	(15,42)
Nettovermögen		\$ 1.072.758	100,00

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

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

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

- (a) Reines Kapitalwertpapier.
 (b) Wertpapier per Emissionstermin.
 (c) Nullkuponwertpapier.
 (d) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.
 (e) Mit dem Fonds verbunden.
 (f) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2021: 0,12 %):

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeits- datum	Kauf- datum	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
Citigroup, Inc.	4,615 %	25.01.2026	18.01.2022	\$ 2.900	\$ 2.836	0,26

(g) Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von 143.852 USD (31. Dezember 2021: 0 USD) wurden gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen zum 31. Dezember 2022 als Sicherheiten verpfändet.

(h) Wertpapier mit einem Gesamtmarktwert von 4.050 USD (31. Dezember 2021: 0 USD) wurde gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte zum 31. Dezember 2022 als Sicherheit für verzögert gelieferte Wertpapiere oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte verpfändet oder geliefert.

Barmittel in Höhe von 16.925 USD (31. Dezember 2021: 8.162 USD) wurden zum 31. Dezember 2022 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von 0 USD (31. Dezember 2021: 1.227 USD) und Barmittel in Höhe von 5.301 USD (31. Dezember 2021: 20 USD) wurden gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. zum 31. Dezember 2022 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Low Average Duration Fund (Forts.)

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 1.234.805	\$ 801	\$ 1.235.606
Investmentfonds	37.618	48.013	0	85.631
Pensionsgeschäfte	0	956	0	956
Finanzderivate ⁽³⁾	1.960	(9.079)	0	(7.119)
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(76.949)	0	(76.949)
Summen	\$ 39.578	\$ 1.197.746	\$ 801	\$ 1.238.125

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

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 1.057.626	\$ 0	\$ 1.057.626
Investmentfonds	113.421	0	0	113.421
Pensionsgeschäfte	0	24.177	0	24.177
Finanzderivate ⁽³⁾	444	(3.896)	0	(3.452)
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(38.058)	0	(38.058)
Summen	\$ 113.865	\$ 1.039.849	\$ 0	\$ 1.153.714

⁽¹⁾ Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

⁽²⁾ Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

⁽³⁾ Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions- geschäften		% des Nettovermögens
BOS	4,340 %	08.12.2022	05.01.2023	\$ (37.873)	\$ (37.983)	(3,54)	
	4,430	12.12.2022	05.01.2023	(2.211)	(2.216)	(0,20)	
	4,430	27.12.2022	03.01.2023	(88.641)	(88.696)	(8,27)	
GRE	4,350	07.12.2022	05.01.2023	(13.703)	(13.745)	(1,28)	
	4,430	12.12.2022	05.01.2023	(1.250)	(1.253)	(0,12)	
	4,450	15.12.2022	12.01.2023	(963)	(964)	(0,09)	
Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte					\$ (144.857)	(13,50)	

Ausstehende Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zum 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Zahlbar für Rückkauf- Finanzierungs- geschäfte ⁽¹⁾		% des Nettovermögens
CSN	4,420 %	27.12.2022	03.01.2023	\$(4.074)	\$ (4.077)	(0,38)	
Summe Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte					\$ (4.077)	(0,38)	

⁽¹⁾ In dem für Rückkaufgeschäfte zahlbaren Betrag sind 1 USD für einen aufgeschobenen Kursrückgang enthalten.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung des Marktwerts der außerbörslich gehandelten Finanzderivate und (erhaltenen)/verpfändeten Sicherheiten nach Kontrahenten zum 31. Dezember 2022 und 31. Dezember 2021:

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2022			Zum 31. Dez. 2021		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾
BOA	\$ (1.233)	\$ 1.360	\$ 127	\$ (84)	\$ 0	\$ (84)
BPS	(2.779)	2.650	(129)	(38)	20	(18)
BRC	8	0	8	k. A.	k. A.	k. A.
CBK	903	(890)	13	(834)	836	2
CLY	(22)	0	(22)	k. A.	k. A.	k. A.
GLM	(802)	751	(51)	(510)	391	(119)
HUS	k. A.	k. A.	k. A.	271	(630)	(359)
JPM	97	(190)	(93)	(137)	0	(137)
MBC	1.204	(980)	224	k. A.	k. A.	k. A.
MYC	(1.239)	510	(729)	k. A.	k. A.	k. A.
MYI	(103)	30	(73)	0	(170)	(170)
RBC	(1)	0	(1)	197	0	197
SAL	(4)	0	(4)	k. A.	k. A.	k. A.

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2022			Zum 31. Dez. 2021		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾
SCX	\$ 277	\$ (230)	\$ 47	\$ 407	\$ (330)	\$ 77
TOR	5	(10)	(5)	171	0	171
UAG	215	0	215	(454)	0	(454)

⁽¹⁾ Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2022:

	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	70,91	44,41
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	43,49	45,03
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,78	0,25
Investmentfonds	7,98	9,62
Pensionsgeschäfte	0,09	2,05
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,21	(0,08)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,55)	(0,12)
Freiverkehrsfinaanzderivate	(0,32)	(0,09)
Leerverkaufte Wertpapiere	(7,17)	(3,23)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(13,50)	k. A.
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	(0,38)	k. A.

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2022 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
Unternehmensanleihen und Wechsel	28,04	32,21
US-Regierungsbehörden	22,99	11,35
US-Schatzobligationen	47,28	4,05
Non-Agency-MBS	6,37	6,41
Forderungsbesicherte Wertpapiere	9,23	5,91
Staatsemissionen	k. A.	0,41
Kurzfristige Instrumente	1,27	29,35
Investmentfonds	7,98	9,62
Pensionsgeschäfte	0,09	2,05
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,21	(0,08)
Verkaufsoptionen		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	k. A.	0,00
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf	0,00	k. A.
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	(0,07)	k. A.
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	k. A.	0,00
Zinsswaps	(0,48)	(0,12)
Freiverkehrsfinaanzderivate		
Optionskauf		
Zinsswapoptionen	0,03	k. A.
Verkaufsoptionen		
Zinsswapoptionen	(0,19)	(0,03)
Optionen auf Wertpapiere	0,00	k. A.
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf	(0,07)	k. A.
Devisenterminkontrakte	(0,27)	(0,15)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,18	0,09
Leerverkaufte Wertpapiere	(7,17)	(3,23)
Sonstige Aktiva und Passiva	(15,42)	2,16
Nettovermögen	100,00	100,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen Low Duration Global Investment Grade Credit Fund

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS		
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE								ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE					
KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNGEN								KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNGEN					
Carnival Corp.	\$	691	0,10	BNP Paribas S.A.	\$	700	0,10	General Motors Financial Co., Inc.	\$	2.900	2,893	0,44	
7,384 % fällig am 30.06.2025				2.219 % fällig am 09.06.2026	1.500	1.379	0,21	5,360 % fällig am 17.11.2023					
Delos Finance SARL	\$	420	0,07	3,800 % fällig am 10.01.2024	500	491	0,08	Goldman Sachs Group, Inc.	\$	1.600	1,577	0,24	
6,480 % fällig am 06.10.2023				BPCE S.A.	300	267	0,04	4,598 % fällig am 24.01.2025					
FinCo LLC		148	0,02	1,652 % fällig am 06.10.2026	700	698	0,11	Groupe Bruxelles Lambert NV	€	1.700	1,749	0,27	
6,884 % fällig am 27.06.2025				Canadian Imperial Bank of Commerce	600	557	0,09	1,875 % fällig am 19.06.2025					
RegionalCare Hospital Partners Holdings, Inc.	\$	2.500	0,36	4,706 % fällig am 14.12.2023	1.500	1.495	0,23	Growthpoint Properties International Pty. Ltd.	\$	300	299	0,05	
8,165 % fällig am 16.11.2025				Cantor Fitzgerald LP	600	570	0,09	5,872 % fällig am 02.05.2023					
		3.595	0,55	4,500 % fällig am 14.04.2027	600	570	0,09	Hamburg Commercial Bank AG	€	2.000	2,164	0,33	
				Charles Schwab Corp.	600	570	0,09	6,250 % fällig am 18.11.2024					
				0,750 % fällig am 18.03.2024	1.500	1.495	0,23	HSBC Holdings PLC		1.000	1,018	0,16	
				4,824 % fällig am 18.03.2024				3,019 % fällig am 15.06.2027					
				China Construction Bank Europe S.A.	€	2.800	2,833	0,43	3,950 % fällig am 18.05.2024	\$	3.000	2,977	0,46
				0,000 % fällig am 28.06.2024 (c)				Huarong Finance Co. Ltd.		1.100	1,059	0,16	
				Citigroup, Inc.	\$	2.000	1,855	0,28	2,125 % fällig am 30.09.2023				
				2,014 % fällig am 25.01.2026 (h)	3.200	3.044	0,47	Hudson Pacific Properties LP		500	468	0,07	
				3,290 % fällig am 17.03.2026 (h)	700	672	0,10	5,950 % fällig am 15.02.2028					
				Cooperatieve Rabobank UA	€	700	700	0,10	ING Groep NV	€	2.000	2,105	0,32
				4,625 % fällig am 22.07.2024				1,000 % fällig am 20.09.2023					
				Corebridge Financial, Inc.	€	1.800	1,681	0,26	Intesa Sanpaolo SpA	\$	3.100	3,098	0,47
				3,650 % fällig am 05.04.2027				3,375 % fällig am 12.01.2023					
				CPI Property Group S.A.	€	700	588	0,09	5,017 % fällig am 26.06.2024				
				2,750 % fällig am 12.05.2026				7,000 % fällig am 21.11.2025					
				Credit Agricole S.A.	\$	2.300	2,357	0,36	Itau Unibanco Holding S.A.		250	250	0,04
				0,500 % fällig am 24.06.2024				2,900 % fällig am 24.01.2023					
				5,803 % fällig am 22.03.2024	\$	2.600	2,607	0,40	Jackson National Life Global Funding		1.000	929	0,14
				Credit Suisse AG	€	1.400	1,359	0,21	1,750 % fällig am 12.01.2025				
				6,500 % fällig am 08.08.2023 (f)				John Deere Capital Corp.		1.000	991	0,15	
				Credit Suisse Group AG	€	400	390	0,06	3,871 % fällig am 11.10.2024				
				3,800 % fällig am 09.06.2023	3.000	2.819	0,43	JPMorgan Chase & Co.		1.600	1,568	0,24	
				6,373 % fällig am 15.07.2026	2.235	2.039	0,31	4,884 % fällig am 10.12.2025					
				6,442 % fällig am 11.08.2028				Kilroy Realty LP		800	766	0,12	
				Cromwell Ereit Lux Finco SARL	€	1.600	1,381	0,21	3,450 % fällig am 15.12.2024				
				2,125 % fällig am 19.11.2025				LeasePlan Corp. NV	€	3.600	3,749	0,57	
				CTP NV	€	100	90	0,01	0,125 % fällig am 13.09.2023				
				0,500 % fällig am 21.06.2025	2.100	1.827	0,28	2,875 % fällig am 24.10.2024	\$	1.500	1,408	0,22	
				0,875 % fällig am 20.01.2026				Lincoln Financing SARL	€	200	211	0,03	
				DAE Sukuk Dific Ltd.	\$	700	666	0,10	3,625 % fällig am 01.04.2024				
				3,750 % fällig am 15.02.2026				Lloyds Banking Group PLC	\$	2.000	1,987	0,30	
				Danske Bank A/S	€	2.100	2,100	0,32	4,050 % fällig am 16.08.2023				
				5,795 % fällig am 12.09.2023				4,716 % fällig am 11.08.2026					
				Deutsche Bank AG	€	1.600	1,487	0,23	Logicor Financing SARL	€	1.200	1,177	0,18
				1,447 % fällig am 01.04.2025 (h)	500	442	0,07	0,750 % fällig am 15.07.2024					
				2,129 % fällig am 24.11.2026 (h)	2.700	2.582	0,39	1,625 % fällig am 15.07.2027					
				3,961 % fällig am 26.11.2025				Lseg Netherlands BV		1.000	990	0,15	
				EPR Properties	€	400	351	0,05	0,000 % fällig am 06.04.2025 (c)				
				4,500 % fällig am 01.06.2027				LSEGA Financing PLC	\$	1.600	1,404	0,21	
				Equitable Financial Life Global Funding	€	3.200	3,196	0,49	1,375 % fällig am 06.04.2026				
				5,500 % fällig am 02.12.2025				MassMutual Global Funding		1.900	1,845	0,28	
				F&G Global Funding	€	1.000	881	0,13	0,480 % fällig am 28.08.2023				
				2,300 % fällig am 11.04.2027				Metropolitan Life Global Funding	€	2.100	2,159	0,33	
				First Abu Dhabi Bank PJSC	£	1.000	1,196	0,18	0,375 % fällig am 09.04.2024				
				1,375 % fällig am 19.02.2023				0,450 % fällig am 01.09.2023	\$	300	291	0,04	
				First American Financial Corp.	\$	1.000	999	0,15	0,900 % fällig am 08.06.2023				
				4,300 % fällig am 01.02.2023				Mitsubishi HC Capital, Inc.		200	198	0,03	
				Ford Motor Credit Co. LLC	€	500	531	0,08	3,960 % fällig am 19.09.2023				
				1,514 % fällig am 17.02.2023	100	102	0,02	5,080 % fällig am 15.09.2027					
				1,744 % fällig am 19.07.2024	300	293	0,05	Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.	€	2.300	2,418	0,37	
				2,386 % fällig am 17.02.2026	100	105	0,02	3,273 % fällig am 19.09.2025					
				2,492 % fällig am 15.11.2023	1.100	1.135	0,17	5,187 % fällig am 26.07.2023	\$	3.000	3,005	0,46	
				2,684 % fällig am 01.12.2024	1.900	1.992	0,30	Mizuho Financial Group, Inc.	€	400	420	0,06	
				3,021 % fällig am 06.03.2024	200	203	0,03	1,020 % fällig am 11.10.2023					
				3,250 % fällig am 15.09.2025	€	600	688	0,11	5,387 % fällig am 25.05.2024	\$	1.900	1,890	0,29
				4,535 % fällig am 06.03.2025	\$	500	467	0,07	Morgan Stanley		2.700	2,662	0,41
				4,950 % fällig am 28.05.2027				0,731 % fällig am 05.04.2024					
				5,841 % fällig am 15.02.2023				MPT Operating Partnership LP	€	700	671	0,10	
				Fortress Transportation & Infrastructure Investors LLC				2,500 % fällig am 24.03.2026					
				6,500 % fällig am 01.10.2025				MUFG Bank Ltd.	\$	1.450	1,446	0,22	
				Freedom Mortgage Corp.	€	400	369	0,06	3,200 % fällig am 26.02.2023				
				8,125 % fällig am 15.11.2024				National Bank of Canada		1.500	1,483	0,23	
				FS KKR Capital Corp.	€	800	723	0,11	4,580 % fällig am 06.08.2024				
				1,650 % fällig am 12.10.2024				Nationale-Nederlanden Bank NV	€	400	423	0,06	
				2,625 % fällig am 15.01.2027				0,375 % fällig am 31.05.2023					
				GA Global Funding Trust				Nationwide Building Society					
				1,000 % fällig am 08.04.2024	1.400	1.312	0,20	3,766 % fällig am 08.03.2024	\$	800	796	0,12	

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
NatWest Group PLC				Svenska Handelsbanken AB				Bayer U.S. Finance LLC			
2,359 % fällig am 22.05.2024	\$	3.000	0,45	0,625 % fällig am 30.06.2023	\$	1.500	0,22	5,779 % fällig am 15.12.2023	\$	1.737	0,26
7,472 % fällig am 10.11.2026		1.200	0,19	1,418 % fällig am 11.06.2027		300	0,04	Berry Global, Inc.			
NatWest Markets PLC				Synchrony Bank				0,950 % fällig am 15.02.2024		3.170	0,46
1,000 % fällig am 28.05.2024	€	1.300	0,20	5,400 % fällig am 22.08.2025		1.400	0,21	BlueScope Finance Americas LLC			
Nissan Motor Acceptance Co. LLC				Synchrony Financial				4,625 % fällig am 25.05.2023		2.500	0,38
1,125 % fällig am 16.09.2024	\$	1.400	0,20	4,375 % fällig am 19.03.2024		600	0,09	BMW U.S. Capital LLC			
3,875 % fällig am 21.09.2023		1.000	0,15	Toronto-Dominion Bank				1,250 % fällig am 12.08.2026		500	0,07
Nomura Holdings, Inc.				4,448 % fällig am 27.01.2023		800	0,12	Booking Holdings, Inc.			
1,851 % fällig am 16.07.2025		200	0,03	4,634 % fällig am 10.09.2024		410	0,06	0,100 % fällig am 08.03.2025	€	300	0,05
2,648 % fällig am 16.01.2025		2.800	0,40	TP ICAP Finance PLC				4,000 % fällig am 15.11.2026		800	0,13
5,386 % fällig am 06.07.2027		2.800	0,42	2,625 % fällig am 18.11.2028	£	600	0,08	Bureau Veritas S.A.			
NongHyup Bank				5,250 % fällig am 26.01.2024		895	0,16	1,250 % fällig am 07.09.2023		700	0,11
0,875 % fällig am 28.07.2024		2.500	0,36	UBS AG				CDW LLC			
Nordea Bank Abp				0,375 % fällig am 01.06.2023	\$	1.000	0,15	2,670 % fällig am 01.12.2026	\$	1.800	0,24
1,125 % fällig am 16.02.2027	€	900	0,13	5,125 % fällig am 15.05.2024 (f)		300	0,05	4,125 % fällig am 01.05.2025		1.149	0,17
Nova Kreditna Banka Maribor d.d.				UBS Group AG				Central Japan Railway Co.			
1,875 % fällig am 27.01.2025		600	0,09	1,494 % fällig am 10.08.2027		2.300	0,30	2,200 % fällig am 02.10.2024		3.300	0,48
NTT Finance Corp.				4,488 % fällig am 12.05.2026		3.500	0,52	3,400 % fällig am 06.09.2023		300	0,05
0,583 % fällig am 01.03.2024	\$	1.200	0,17	UniCredit SpA				CGI, Inc.			
4,142 % fällig am 26.07.2024		1.800	0,27	5,850 % fällig am 15.11.2027	€	2.000	0,33	1,450 % fällig am 14.09.2026		2.700	0,36
4,239 % fällig am 25.07.2025		2.100	0,32	7,830 % fällig am 04.12.2023	\$	2.800	0,43	Chanel Ceres PLC			
4,372 % fällig am 27.07.2027		300	0,05	VICI Properties LP				0,500 % fällig am 31.07.2026	€	1.900	0,28
Nykredit Realkredit A/S				4,250 % fällig am 01.12.2026		800	0,11	Charter Communications Operating LLC			
1,375 % fällig am 12.07.2027	€	3.000	0,44	4,500 % fällig am 01.09.2026		400	0,06	6,090 % fällig am 01.02.2024	\$	250	0,04
Pacific Life Global Funding				5,625 % fällig am 01.05.2024		700	0,11	China Modern Dairy Holdings Ltd.			
1,375 % fällig am 14.04.2026	\$	1.700	0,23	Virgin Money UK PLC				2,125 % fällig am 14.07.2026		1.400	0,18
Principal Life Global Funding				0,375 % fällig am 27.05.2024	€	2.500	0,40	CommonSpirit Health			
4,580 % fällig am 23.08.2024		500	0,08	Volkswagen Bank GmbH				2,760 % fällig am 01.10.2024		100	0,01
Protective Life Global Funding				1,250 % fällig am 10.06.2024		600	0,09	ConocoPhillips Co.			
1,170 % fällig am 15.07.2025		1.000	0,14	1,875 % fällig am 31.01.2024		200	0,03	2,400 % fällig am 07.03.2025		100	0,01
1,646 % fällig am 13.01.2025		1.000	0,14	Volkswagen Financial Services AG				Continental Resources, Inc.			
4,714 % fällig am 06.07.2027		3.300	0,49	0,000 % fällig am 12.02.2025 (c)		2.700	0,40	2,268 % fällig am 15.11.2026		500	0,07
QNB Finance Ltd.				Volkswagen Financial Services NV				CSL Finance PLC			
1,375 % fällig am 26.01.2026		300	0,04	1,125 % fällig am 18.09.2023	£	2.700	0,48	3,850 % fällig am 27.04.2027		800	0,12
3,500 % fällig am 28.03.2024		1.078	0,17	5,500 % fällig am 07.12.2026		3.000	0,54	DAE Funding LLC			
Reliance Standard Life Global Funding				Volkswagen Leasing GmbH				1,550 % fällig am 01.08.2024		900	0,13
2,150 % fällig am 21.01.2023		500	0,08	0,000 % fällig am 19.07.2024	€	1.000	0,15	1,625 % fällig am 15.02.2024		2.500	0,36
Royal Bank of Canada				(c)		900	0,15	2,625 % fällig am 20.03.2025		300	0,04
4,408 % fällig am 05.10.2023		600	0,09	1,000 % fällig am 16.02.2023				Delta Air Lines, Inc.			
Sagax AB				Vonovia SE				2,900 % fällig am 28.10.2024		2.100	0,30
2,250 % fällig am 13.03.2025	€	2.200	0,33	1,375 % fällig am 28.01.2026		1.300	0,19	3,800 % fällig am 19.04.2023		66	0,01
Sagax Euro MTN NL BV				Wells Fargo & Co.				Devon Energy Corp.			
1,625 % fällig am 24.02.2026		1.500	0,22	4,540 % fällig am 15.08.2026	\$	1.600	0,24	5,250 % fällig am 15.10.2027		600	0,09
Santander UK Group Holdings PLC				INDUSTRIEWERTE				eBay, Inc.			
1,532 % fällig am 21.08.2026	\$	1.200	0,16	ABB Finance BV				5,900 % fällig am 22.11.2025		4.000	0,62
3,373 % fällig am 05.01.2024		2.600	0,40	0,625 % fällig am 31.03.2024	€	2.100	0,33	Enbridge, Inc.			
6,833 % fällig am 21.11.2026		2.400	0,37	Aeroporti di Roma SpA				4,560 % fällig am 17.02.2023		400	0,06
SBA Tower Trust				5,441 % fällig am 20.02.2023	£	400	0,07	Energy Transfer LP			
1,631 % fällig am 15.05.2051		1.900	0,25	Air Canada Pass-Through Trust				5,550 % fällig am 15.02.2028		4.000	0,61
Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.				3,750 % fällig am 15.06.2029	\$	687	0,09	Entergy Louisiana LLC			
5,125 % fällig am 29.10.2022 ^		1.400	0,03	American Airlines, Inc.				0,620 % fällig am 17.11.2023		1.632	0,24
5,250 % fällig am 23.05.2023		500	0,07	5,500 % fällig am 20.04.2026		2.600	0,38	0,950 % fällig am 01.10.2024		1.400	0,20
(f)				American Medical Systems Europe BV				EQM Midstream Partners LP			
Scentre Group Trust				0,750 % fällig am 08.03.2025	€	3.000	0,46	4,000 % fällig am 01.08.2024		75	0,01
1,375 % fällig am 22.03.2023	€	200	0,03	ArcelorMittal S.A.				Expedia Group, Inc.			
Shinhan Bank Co. Ltd.				6,550 % fällig am 29.11.2027	\$	2.000	0,31	6,250 % fällig am 01.05.2025		2.015	0,31
0,250 % fällig am 16.10.2024		1.100	0,17	Asahi Group Holdings Ltd.				Flex Ltd.			
1,183 % fällig am 29.09.2025	AUD	800	0,07	0,010 % fällig am 19.04.2024	€	1.200	0,19	6,000 % fällig am 15.01.2028		1.700	0,26
Sirius Real Estate Ltd.				0,155 % fällig am 23.10.2024		500	0,08	Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide			
1,125 % fällig am 22.06.2026	€	1.200	0,15	Ashtead Capital, Inc.				1,625 % fällig am 09.07.2024	€	2.600	0,41
SLM Corp.				1,500 % fällig am 12.08.2026	\$	400	0,05	GE HealthCare Technologies, Inc.			
3,125 % fällig am 02.11.2026	\$	600	0,08	Atlantia SpA				5,550 % fällig am 15.11.2024	\$	2.400	0,37
SMBC Aviation Capital Finance DAC				1,625 % fällig am 03.02.2025	€	1.300	0,20	Geely Automobile Holdings Ltd.			
3,550 % fällig am 15.04.2024		3.330	0,49	Bacardi Ltd.				3,625 % fällig am 25.01.2023		1.100	0,17
4,125 % fällig am 15.07.2023		800	0,12	2,750 % fällig am 03.07.2023		300	0,05	Georgia-Pacific LLC			
Societe Generale S.A.				BAE Systems Holdings, Inc.				0,625 % fällig am 15.05.2024		2.700	0,39
1,488 % fällig am 14.12.2026		2.400	0,32	3,850 % fällig am 15.12.2025	\$	1.100	0,16	Global Erhalthments, Inc.			
4,677 % fällig am 15.06.2027		3.500	0,52	BAT Capital Corp.				4,950 % fällig am 15.08.2027		2.000	0,30
Standard Chartered PLC				1,125 % fällig am 16.11.2023	€	300	0,05	GN Store Nord A/S			
0,991 % fällig am 12.01.2025		1.000	0,14	3,222 % fällig am 15.08.2024	\$	900	0,13	0,875 % fällig am 25.11.2024	€	1.500	0,22
1,214 % fällig am 23.03.2025		500	0,07	Baxter International, Inc.				1,250 % fällig am 29.03.2026		3.700	0,56
7,767 % fällig am 16.11.2028		1.700	0,28	4,654 % fällig am 29.11.2024		2.389	0,36	GSK Consumer Healthcare Capital U.S. LLC			
Sumitomo Mitsui Banking Corp.				Bayer AG				3,375 % fällig am 24.03.2027	\$	750	0,11
0,010 % fällig am 10.09.2025	€	5.000	0,74	0,050 % fällig am 12.01.2025	€	500	0,08				
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.											
0,800 % fällig am 12.09.2023	\$	700	0,10								

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	
BESCHREIBUNG								STAMMAKTIE				
3,500 % fällig am 15.06.2025 ^A	\$ 1.700	\$ 1.606	0,25	Uniform Mortgage-Backed Security, TBA				FINANZWERT				
3,750 % fällig am 15.02.2024 ^A	200	196	0,03	3,500 % fällig am 01.02.2053	\$ 17.440	\$ 15.856	2,42	Stearns Holdings LLC 'B' (b)	43.861	\$ 0	0,00	
3,850 % fällig am 15.11.2023 ^A	200	197	0,03	4,000 % fällig am 01.01.2053	24.800	23.267	3,55					
4,250 % fällig am 01.08.2023	2.400	2.388	0,37			41.466	6,33					
4,950 % fällig am 08.06.2025	2.000	1.971	0,30					OPTIONSSCHEINE				
Pennsylvania Electric Co.				US-SCHATZ Obligationen				Guaranteed Rate, Inc. – Exp.				
4,150 % fällig am 15.04.2025	1.950	1.875	0,29	U.S. Treasury Notes				31. Dezember 2060	211	0	0,00	
Potomac Electric Power Co.				1,500 % fällig am 30.11.2024	800	757	0,12					
3,600 % fällig am 15.03.2024	1.262	1.241	0,19	2,250 % fällig am 31.03.2024 (i)	12.100	11.742	1,79					
PPL Electric Utilities Corp.				3,500 % fällig am 15.09.2025	6.700	6.567	1,00					
4,653 % fällig am 24.06.2024	148	146	0,02	4,000 % fällig am 15.12.2025	6.100	6.062	0,93					
San Diego Gas & Electric Co.				4,250 % fällig am 15.10.2025	20.900	20.887	3,19					
2,500 % fällig am 15.05.2026	226	210	0,03	4,375 % fällig am 31.10.2024 (i)(j)	23.100	23.036	3,52					
Sempra Energy						69.051	10,55					
3,300 % fällig am 01.04.2025	3.100	2.975	0,45	NON-AGENCY-MBS				KURZFRISTIGE INSTRUMENTE				
Southern California Edison Co.				GSR Mortgage Loan Trust				COMMERCIAL PAPER				
0,975 % fällig am 01.08.2024	800	749	0,11	3,767 % fällig am 25.09.2035	2	2	0,00	Consolidated Edison Co. of New York, Inc.				
4,200 % fällig am 01.06.2025	3.200	3.144	0,48	Morgan Stanley Mortgage Loan Trust				4,800 % fällig am 19.01.2023	\$ 4.800	4.788	0,73	
5,153 % fällig am 01.04.2024	557	553	0,08	4,023 % fällig am 25.11.2034	4	4	0,00	Duke Energy Corp.				
5,850 % fällig am 01.11.2027	100	103	0,02	6,297 % fällig am 25.09.2034	293	291	0,05	4,620 % fällig am 17.01.2023	800	798	0,12	
Southern Power Co.				WalMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust				Fiserv, Inc.				
0,900 % fällig am 15.01.2026	3.000	2.644	0,40	3,298 % fällig am 25.01.2047	169	151	0,02	4,730 % fällig am 17.01.2023	700	698	0,11	
Sprint LLC				4,343 % fällig am 25.01.2033	4	4	0,00					
7,125 % fällig am 15.06.2024	125	128	0,02			452	0,07					
7,875 % fällig am 15.09.2023	1.100	1.118	0,17	FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				KURZFRISTIGE SCHULDITITEL				
State Grid Overseas Investment BVI Ltd.				IXIS Real Estate Capital Trust				HF Sinclair Corp.				
0,797 % fällig am 05.08.2026	€ 500	467	0,07	5,019 % fällig am 25.02.2036	41	43	0,01	2,625 % fällig am 01.10.2023	1.300	1.273	0,19	
Systems Energy Resources, Inc.				Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust				Yango Justice International Ltd.				
2,140 % fällig am 09.12.2025	\$ 1.150	1.053	0,16	5,009 % fällig am 25.12.2035	345	334	0,05	5,300 % fällig am				
Tampa Electric Co.				OCP Euro CLO DAC				11.01.2022 ^A	200	9	0,00	
3,875 % fällig am 12.07.2024	800	785	0,12	0,000 % fällig am 20.01.2033	€ 1.000	1.062	0,16					
Trans-Allegheny Interstate Line Co.				(a)		1.439	0,22					
3,850 % fällig am 01.06.2025	1.305	1.261	0,19	STAATSEMISSIONEN				Summe kurzfristige Instrumente		7.566	1,15	
Verizon Communications, Inc.				Canada Government International Bond				Summe Übertragbare Wertpapiere	\$ 691.422	105,60		
5,113 % fällig am 20.03.2026	800	780	0,12	1,500 % fällig am 01.09.2024	CAD 2.800	1.982	0,30					
Vistra Operations Co. LLC				France Government International Bond				INVESTMENTFONDS				
3,550 % fällig am 15.07.2024	3.325	3.191	0,49	0,000 % fällig am 25.03.2025	€ 9.000	9.024	1,38	ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN				
		67.362	10,29	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro				PIMCO Select Funds plc -				
Summe Unternehmensanleihen und Wechsel		544.492	83,16	0,000 % fällig am 01.04.2026	(c)	2.700	2,560	0,39	PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (e)	57.648	574	0,09
				South Africa Government International Bond				PIMCO Specialty Funds				
KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL				10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR 139.500	8.668	1,33	Ireland p.l.c. - PIMCO				
State Board of Administration Finance Corp., Florida Revenue Notes, Series 2020				Ukraine Government International Bond				China Bond Fund (e)	5.163	69	0,01	
1,258 % fällig am 01.07.2025	1.200	1.102	0,17	7,750 % fällig am 01.09.2024	\$ 100	25	0,00					
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN				^A		22.259	3,40	Summe Investmentfonds	\$ 643	0,10		
Ginnie Mae, TBA												
2,500 % fällig am 01.02.2053	2.700	2.343	0,36									

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kapital- betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions- geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions- geschäft ⁽¹⁾	% des Netto- vermögens
FICC	1,900 %	30.12.2022	03.01.2023	\$ 1.604	U.S. Treasury Notes 0,125 % fällig am 15.05.2023	\$ (1.636)	\$ 1.604	\$ 1.604	0,24
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (1.636)	\$ 1.604	\$ 1.604	0,24

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Low Duration Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)

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

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Netto- vermögens
3-Month SOFR December Futures	Short	03.2024	222	\$ 828	0,13
3-Month SOFR March Futures	Long	06.2023	50	(1)	0,00
Euro-Bobl March Futures	Long	03.2023	135	(614)	(0,10)
U.S. Treasury 5-Year Note March Futures	Long	03.2023	11	(16)	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond March Futures	Short	03.2023	66	160	0,02
				\$ 357	0,05
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate					
				\$ 357	0,05

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZKAUF⁽¹⁾

Referenzeinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽³⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Netto- vermögens
Newell Brands, Inc.	(1,000) %	20.06.2023	\$ 1.000	\$ 6	0,00

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽²⁾

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽³⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AT&T, Inc.	1,000 %	20.06.2023	\$ 1.500	\$ 1	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.12.2024	1.300	(17)	(0,01)
AT&T, Inc.	1,000	20.12.2025	200	(3)	0,00
Barclays Bank PLC	1,000	20.12.2023	€ 500	1	0,00
Boeing Co.	1,000	20.06.2023	\$ 100	0	0,00
Boeing Co.	1,000	20.12.2023	800	6	0,00
Boeing Co.	1,000	20.12.2024	1.500	35	0,01
Boeing Co.	1,000	20.12.2026	1.300	(12)	0,00
Boeing Co.	1,000	20.06.2027	1.200	50	0,01
General Electric Co.	1,000	20.06.2026	3.700	(28)	(0,01)
General Electric Co.	1,000	20.12.2026	400	(3)	0,00
General Motors Co.	5,000	20.12.2026	200	(16)	0,00
International Lease Finance Corp.	5,000	20.12.2023	900	(40)	(0,01)
NextEra Energy Capital Holdings, Inc.	1,000	20.06.2026	300	(4)	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20.12.2024	€ 2.200	(35)	(0,01)
Rolls-Royce PLC	1,000	20.12.2025	500	(16)	0,00
Ryder System, Inc.	1,000	20.12.2023	\$ 1.100	(7)	0,00
Stellantis NV	5,000	20.06.2026	€ 1.100	(81)	(0,01)
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.06.2027	\$ 1.000	4	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.12.2027	1.500	9	0,00
Vodafone Group PLC	1,000	20.06.2024	€ 1.200	(11)	0,00
				\$ (167)	(0,03)

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF⁽²⁾

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽³⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
iTraxx Crossover 38 5-Year Index	5,000 %	20.12.2027	€ 500	\$ 24	0,01
iTraxx Europe Main 37 5-Year Index	1,000	20.06.2027	6.000	24	0,00
				\$ 48	0,01

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variablem Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung ⁽⁴⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	2,250 %	15.03.2028	£ 4.900	\$ (173)	(0,03)
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,399	18.06.2028	¥ 77.700	21	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2027	\$ 9.400	(453)	(0,07)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,665	04.01.2027	BRL 26.100	(129)	(0,02)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,980	04.01.2027	31.000	64	0,01
Zahlung	1-Year BRL-CDI	13,026	02.01.2025	113.600	117	0,02
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	2,000	14.11.2023	CAD 14.700	(283)	(0,04)
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	2,050	16.11.2023	7.800	(150)	(0,02)
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	2,070	22.11.2023	11.900	(228)	(0,04)
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	2,250	15.06.2024	24.700	(258)	(0,04)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,270	04.11.2023	\$ 108.700	\$ (3.407)	(0,52)
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	7,300	28.04.2027	ZAR 68.300	111	0,02
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,550	10.08.2024	€ 1.700	(73)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,650	11.05.2027	4.400	(449)	(0,07)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,000	13.05.2027	3.200	(283)	(0,04)
Zahlung ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	1,500	15.03.2028	16.000	(551)	(0,08)
Zahlung	6-Month HUF-BBR	1,250	19.09.2023	HUF 1.604.100	(246)	(0,04)
Zahlung	28-Day MXN-TIE	6,015	03.06.2026	MXN 100.900	(181)	(0,03)
					\$ (6.551)	(1,00)
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					\$ (6.664)	(1,02)

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

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

⁽³⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definieren.

⁽⁴⁾ Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

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

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

VERKAUFSOPTIONEN

CREDIT DEFAULT SWAPPTIONS AUF KREDITINDIZES

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/ -verkauf	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
GST	Put - OTC iTraxx Europe 37 5-Year Index	Verkauf	3,000 %	15.03.2023	1.000	\$ (2)	\$ 0	0,00

⁽¹⁾ Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Kontrahent	Referenzinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽²⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Netto- vermögens
BOA	Brazil Government International Bond	1,000 %	20.06.2026	\$ 100	\$ (4)	\$ 1	\$ (3)	0,00
JPM	Hochtief AG	5,000	20.12.2025	€ 600	139	(78)	61	0,01
	Petrobras Global Finance BV	1,000	20.06.2023	\$ 100	(10)	10	0	0,00
					\$ 125	\$ (67)	\$ 58	0,01

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

⁽²⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definieren.

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2023	HUF 137.470	\$ 304	\$ 0	\$ (62)	\$ (62)	(0,01)
	02.2023	\$ 825	CHF 781	23	0	23	0,00
	02.2023	682	NOK 6.773	6	0	6	0,00
BPS	01.2023	€ 264	\$ 282	0	0	0	0,00
	02.2023	\$ 43	IDR 683.475	1	0	1	0,00
	02.2023	ZAR 72.651	\$ 4.047	0	(208)	(208)	(0,03)
	03.2023	\$ 708	COP 3.503.969	5	0	5	0,00
BRC	04.2023	3	CLP 2.942	0	0	0	0,00
	01.2023	2.709	€ 2.589	56	0	56	0,01
	02.2023	428	CHF 402	8	0	8	0,00
CBK	01.2023	€ 223	\$ 236	0	(2)	(2)	0,00
	01.2023	\$ 592	BRL 3.108	0	(4)	(4)	0,00
	01.2023	4.554	€ 4.293	30	0	30	0,00
	02.2023	NOK 1.735	\$ 177	1	0	1	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Low Duration Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens			
GLM	01.2023	BRL	3.108	583	\$ 0	\$ (5)	\$ (5)	0,00		
	03.2023	MXN	6.440	313	0	(13)	(13)	0,00		
	03.2023	\$	0	MXN	6	0	0	0,00		
	04.2023		573	BRL	3.108	6	6	0,00		
JPM	01.2023	£	12.261	\$	14.806	54	54	0,01		
	02.2023	\$	75	IDR	1.180.530	1	1	0,00		
	03.2023		81		1.270.146	1	1	0,00		
	03.2023		108	MXN	2.145	1	1	0,00		
MBC	01.2023	CAD	2.993	\$	2.231	22	22	0,00		
	01.2023	€	152.181		159.508	0	(2.975)	(2.975)	(0,45)	
	01.2023	£	2.959		3.622	61	61	0,01		
	02.2023	\$	115	IDR	1.821.534	2	2	0,00		
MYI	03.2023		49		770.927	1	1	0,00		
	01.2023	AUD	534	\$	359	0	(4)	(4)	0,00	
	01.2023	€	31		34	0	0	0,00		
	01.2023	£	5		6	0	0	0,00		
RBC	01.2023	\$	151	€	142	1	1	0,00		
	01.2023		20	£	17	0	0	0,00		
	03.2023		69	IDR	1.086.205	1	1	0,00		
	02.2023		1.035	NOK	10.327	15	15	0,00		
SCX	03.2023	MXN	3.228	\$	161	0	(2)	(2)	0,00	
	02.2023	\$	79	IDR	1.242.170	1	1	0,00		
UAG	03.2023		1.149	CLP	1.025.394	44	44	0,01		
	01.2023		463	ZAR	8.053	10	10	0,00		
	01.2023	ZAR	72.801	\$	4.064	0	(209)	(209)	(0,03)	
				\$	351	\$	(3.484)	\$	(3.133)	(0,48)

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend und E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens			
BOA	01.2023	\$	100	€	95	\$ 1	\$ 0	\$ 1	0,00	
BPS	01.2023		75		71	0	0	0	0,00	
CBK	01.2023	€	5.285	\$	5.619	0	(24)	(24)	0,00	
	01.2023	\$	152.937	€	147.368	4.410	0	4.410	0,67	
MBC	01.2023	€	612	\$	650	0	(3)	(3)	0,00	
	01.2023	\$	162.783	€	155.276	3.006	0	3.006	0,46	
SCX	01.2023		153.202		147.189	3.954	0	3.954	0,60	
					\$	11.371	\$	(27)	\$	11.344

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend und Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens			
BOA	01.2023	£	51	\$	62	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00	
BRC	01.2023		17		20	0	0	0	0,00	
	01.2023	\$	6	£	5	0	0	0	0,00	
JPM	01.2023		8.958		7.418	0	(34)	(34)	(0,01)	
MBC	01.2023	£	6	\$	8	0	0	0	0,00	
	01.2023	\$	9.038	£	7.538	37	(6)	31	0,01	
MYI	01.2023	£	14	\$	17	1	0	1	0,00	
	01.2023	\$	4	£	3	0	0	0	0,00	
TOR	01.2023		8.931		7.428	6	0	6	0,00	
UAG	01.2023	£	4	\$	5	0	0	0	0,00	
					\$	44	\$	(40)	\$	4

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilsklasse Institutional NOK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnung s- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens			
BRC	01.2023	\$	7.939	NOK	78.997	\$ 82	\$ 82	\$ 82	0,02	
CBK	01.2023		8.792		87.148	57	0	57	0,01	
	01.2023	NOK	41.771	\$	4.267	25	0	25	0,01	
MYI	01.2023		53.174		5.327	0	(73)	(73)	(0,01)	
	01.2023	\$	90	NOK	887	0	0	0	0,00	
RYL	01.2023		2		23	0	0	0	0,00	
SCX	01.2023		8.792		87.243	66	0	66	0,01	
					\$	230	\$	(73)	\$	157

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ 8.430 1,30

LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖGENS
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN			
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA			
2,000 % fällig am 01.01.2053	\$ 9.100	\$ (7.407)	(1,13)
2,500 % fällig am 01.01.2053	6.600	(5.590)	(0,85)
4,000 % fällig am 01.12.2053 (g)	1.100	(1.032)	(0,16)
Summe Leerverkaufte Wertpapiere		\$ (14.029)	(2,14)
Summe Anlagen		\$ 681.763	104,13
Sonstige Aktiva und Passiva		\$ (27.014)	(4,13)
Nettovermögen		\$ 654.749	100,00

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

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

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

- (a) Wertpapier per Emissionstermin.
- (b) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.
- (c) Nullkuponwertpapier.
- (d) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.
- (e) Mit dem Fonds verbunden.
- (f) Bedingt wandelbares Wertpapier.
- (g) Zum 31. Dezember 2022 leerverkaufte Wertpapiere sind durch langfristige Portfolioanlagen in übertragbaren Wertpapieren und Geldmarktinstrumenten abgedeckt.
- (h) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2021: 0,69%):

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeits- datum	Kauf- datum	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
Citigroup, Inc.	2,014 %	25.01.2026	18.01.2022	\$ 2.000	\$ 1.855	0,28
Citigroup, Inc.	3,290	17.03.2026	10.03.2022	3.200	3.044	0,47
Deutsche Bank AG	1,447	01.04.2025	30.03.2021	1.600	1.487	0,23
Deutsche Bank AG	2,129	24.11.2026	17.11.2020	500	442	0,07
Oracle Corp.	1,650	25.03.2026	22.03.2021	1.899	1.703	0,26
				\$ 9.199	\$ 8.531	1,31

(i) Wertpapiere mit einem Gesamtwert von 12.682 USD (31. Dezember 2021: 0 USD) wurden gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen zum 31. Dezember 2022 als Sicherheiten verpfändet.

(j) Wertpapiere mit einem Gesamtwert von 1.396 USD (31. Dezember 2021: 2.682 USD) wurden gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte zum 31. Dezember 2022 als Sicherheiten für verzögert gelieferte Wertpapiere oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte verpfändet oder geliefert.

Barmittel in Höhe von 9.433 USD (31. Dezember 2021: 9.961 USD) wurden zum 31. Dezember 2022 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 426 USD (31. Dezember 2021: 535 USD) wurden gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. zum 31. Dezember 2022 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 691.422	\$ 0	\$ 691.422
Investmentfonds	643	0	0	643
Pensionsgeschäfte	0	1.604	0	1.604
Finanzderivate ⁽³⁾	(614)	2.737	0	2.123
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(14.029)	0	(14.029)
Summen	\$ 29	\$ 681.734	\$ 0	\$ 681.763

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

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 734.712	\$ 30	\$ 734.742
Investmentfonds	78.479	0	0	78.479
Pensionsgeschäfte	0	892	0	892
Finanzderivate ⁽³⁾	(188)	3.284	0	3.096
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(15.770)	0	(15.770)
Summen	\$ 78.291	\$ 723.118	\$ 30	\$ 801.439

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Low Duration Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)

- (1) Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.
 (2) Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.
 (3) Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions- geschäften		% des Nettovermögens
					\$	(%)	
BOS	4,430 %	27.12.2022	03.01.2023	\$ (1.709)	\$ (1.710)	(0,26)	
BRC	4,480	28.12.2022	04.01.2023	(704)	(705)	(0,11)	
GRC	1,750	28.09.2022	TBD ⁽¹⁾	(606)	(607)	(0,09)	
GRE	4,350	07.12.2022	05.01.2023	(9.725)	(9.754)	(1,49)	
Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte					\$ (12.776)	(1,95)	

(1) Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

Ausstehende Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zum 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Zahlbar für Rückkauf- Finanzierungs- geschäfte ⁽¹⁾		% des Nettovermögens
					\$	(%)	
BPG	4,500 %	29.12.2022	05.01.2023	\$ (1.408)	\$ (1.409)	(0,22)	
Summe Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte					\$ (1.409)	(0,22)	

(1) In dem für Rückkaufgeschäfte zahlbaren Betrag sind USD 1 für einen aufgeschobenen Kursrückgang enthalten.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung des Marktwerts der außerbörslich gehandelten Finanzderivate und (erhaltenen)/verpfändeten Sicherheiten nach Kontrahenten zum 31. Dezember 2022 und 31. Dezember 2021:

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2022			Zum 31. Dez. 2021		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Nettoengagement ⁽¹⁾
BOA	\$ (35)	\$ 0	\$ (35)	\$ (92)	\$ 143	\$ 51
BPS	(202)	140	(62)	181	0	181
BRC	146	(120)	26	400	(360)	40
CBK	4.468	(4.360)	108	13	0	13
DUB	k. A.	k. A.	k. A.	10	0	10
FBF	k. A.	k. A.	k. A.	5	0	5
GLM	(12)	16	4	(499)	392	(107)
HUS	k. A.	k. A.	k. A.	(189)	0	(189)
JPM	84	0	84	123	(280)	(157)
MBC	170	(290)	(120)	k. A.	k. A.	k. A.
MYC	k. A.	k. A.	k. A.	(40)	(110)	(150)
MYI	(74)	0	(74)	474	(320)	154
RBC	13	0	13	1.627	(1.060)	567
SCX	4.065	(3.850)	215	1.238	(1.160)	78
TOR	6	(20)	(14)	1.806	(1.150)	656
UAG	(199)	270	71	262	0	262

(1) Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2022:

	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	73,17	59,93
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	32,43	31,03
Sonstige übertragbare Wertpapiere	k. A.	0,10
Investmentfonds	0,10	9,73
Pensionsgeschäfte	0,24	0,11
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,05	(0,03)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(1,02)	(0,25)
Freiverkehrsfinaanzderivate	1,30	0,66
Leerverkaufte Wertpapiere	(2,14)	(1,95)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(1,95)	k. A.
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	(0,22)	(0,33)

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2022 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
Kreditbeteiligungen und -abtretungen	0,55	0,57
Unternehmensanleihen und Wechsel	83,16	68,84
Kommunalanleihen und Wechsel	0,17	0,15
US-Regierungsbehörden	6,33	2,61
US-Schatzobligationen	10,55	6,35
Non-Agency-MBS	0,07	0,09
Förderungsbesicherte Wertpapiere	0,22	0,09
Staatsemissionen	3,40	2,11
Stammaktien	0,00	0,00
Optionsscheine	0,00	0,00
Kurzfristige Instrumente	1,15	10,25
Investmentfonds	0,10	9,73
Pensionsgeschäfte	0,24	0,11
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,05	(0,03)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzkauf	0,00	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf	(0,03)	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,01	0,00
Zinsswaps	(1,00)	(0,25)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes	0,00	(0,01)
Zinsswapoptionen	k. A.	(0,05)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf	0,01	0,01
Devisenterminkontrakte	(0,48)	(0,24)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	1,77	0,95
Leerverkaufte Wertpapiere	(2,14)	(1,95)
Sonstige Aktiva und Passiva	(4,13)	0,67
Nettovermögen	100,00	100,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen Low Duration Income Fund

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE								INDUSTRIEWERTE			
KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNGEN											
American Airlines, Inc. 8,993 % fällig am 20.04.2028	\$ 900	\$ 898	0,08	Barclays PLC 6,125 % fällig am 15.12.2025 (g)(i)	\$ 1.080	\$ 987	0,09	Alaska Airlines Pass-Through Trust 4,800 % fällig am 15.02.2029	\$ 2.192	\$ 2.091	0,19
Caesars Resort Collection LLC 7,134 % fällig am 23.12.2024	5.408	5.403	0,50	7,250 % fällig am 15.03.2023 (g)(i)	£ 1.800	2.146	0,20	Altice France S.A. 8,125 % fällig am 01.02.2027	3.400	3.104	0,29
7,884 % fällig am 21.07.2025	861	859	0,08	Bevco Lux SARL 1,000 % fällig am 16.01.2030	€ 4.400	3.539	0,33	American Airlines Pass-Through Trust 3,375 % fällig am 01.11.2028	63	52	0,01
Carnival Corp. 5,648 % fällig am 30.06.2025	€ 3.404	3.502	0,32	BGC Partners, Inc. 4,375 % fällig am 15.12.2025	\$ 1.200	1.126	0,10	American Airlines, Inc. 5,500 % fällig am 20.04.2026	6.948	6.694	0,62
Clear Channel Outdoor Holdings, Inc. 7,915 % fällig am 21.08.2026	\$ 676	617	0,06	Corsair International Ltd. 5,473 % fällig am 28.01.2027	€ 1.000	1.059	0,10	Bombardier, Inc. 7,500 % fällig am 15.03.2025	3.108	3.084	0,28
Emerald TopCo, Inc. 7,884 % fällig am 24.07.2026	73	67	0,01	Credit Suisse Group AG 4,194 % fällig am 01.04.2031	\$ 5.000	3.891	0,36	British Airways Pass-Through Trust 4,250 % fällig am 15.05.2034	483	434	0,04
Envision Healthcare Corp. TBD % fällig am 29.04.2027	123	120	0,01	6,373 % fällig am 15.07.2026	2.400	2.255	0,21	Broadcom, Inc. 3,469 % fällig am 15.04.2034	4.217	3.377	0,31
TBD % fällig am 29.04.2027	677	663	0,06	6,442 % fällig am 11.08.2028	3.150	2.873	0,26	Carvana Co. 5,500 % fällig am 15.04.2027	120	48	0,00
15,744 % fällig am 28.04.2028	1.592	1.303	0,12	7,500 % fällig am 11.12.2023 (g)(i)	1.100	963	0,09	10,250 % fällig am 01.05.2030	3.700	1.746	0,16
iHeartCommunications, Inc. 7,384 % fällig am 01.05.2026	6.300	5.794	0,54	Cromwell Ereit Lux Finco SARL 2,125 % fällig am 19.11.2025	€ 167	144	0,01	CDW LLC 2,670 % fällig am 01.12.2026	6.460	5.747	0,53
7,634 % fällig am 01.05.2026	1.711	1.581	0,15	Deutsche Bank AG 3,547 % fällig am 18.09.2031	\$ 800	643	0,06	Community Health Systems, Inc. 5,625 % fällig am 15.03.2027	4.154	3.570	0,33
INEOS Finance PLC 3,898 % fällig am 01.04.2024	€ 7.059	7.521	0,69	Doric Nimrod Air Alpha Pass-Through Trust 5,250 % fällig am 30.05.2025	32	32	0,00	8,000 % fällig am 15.03.2026	742	677	0,06
Intelsat Jackson Holdings S.A. 7,445 % fällig am 01.02.2029	\$ 858	830	0,08	EPR Properties 4,750 % fällig am 15.12.2026	8	7	0,00	CoStar Group, Inc. 2,800 % fällig am 15.07.2030	1.300	1.065	0,10
Lealand Finance Co. BV 7,384 % fällig am 28.06.2024	8	5	0,00	4,950 % fällig am 15.04.2028	34	29	0,00	DISH DBS Corp. 5,250 % fällig am 01.12.2026	2.550	2.153	0,20
Lealand Finance Co. BV (3,000 % bar oder 5,384 % PIK) 8,384 % fällig am 30.06.2025 (b)	24	13	0,00	Erste Group Bank AG 6,500 % fällig am 15.04.2024 (g)(i)	€ 200	209	0,02	5,750 % fällig am 01.12.2028	2.520	2.016	0,19
Petco Health & Wellness Co., Inc. 7,976 % fällig am 03.03.2028	3.767	3.662	0,34	Ford Motor Credit Co. LLC 2,700 % fällig am 10.08.2026	\$ 2.600	2.261	0,21	Dufry One BV 3,625 % fällig am 15.04.2026	CHF 7.394	7.036	0,65
PetSmart, Inc. 8,130 % fällig am 11.02.2028	2.147	2.107	0,19	4,535 % fällig am 06.03.2025	£ 1.801	2.064	0,19	Expedia Group, Inc. 6,250 % fällig am 01.05.2025	\$ 1.095	1.105	0,10
Poseidon BidCo S.A.S 5,250 % - 7,452 % fällig am 14.07.2028	€ 4.000	3.678	0,34	GLP Capital LP 4,000 % fällig am 15.01.2030	\$ 100	88	0,01	Intelsat Jackson Holdings S.A. 6,500 % fällig am 15.03.2030	3.297	2.956	0,27
PUG LLC 7,884 % fällig am 12.02.2027	\$ 29	24	0,00	5,300 % fällig am 15.01.2029	3.888	3.686	0,34	JetBlue Pass-Through Trust 4,000 % fällig am 15.05.2034	2.868	2.558	0,24
SkyMiles IP Ltd. 7,993 % fällig am 20.10.2027	3.307	3.377	0,31	5,750 % fällig am 01.06.2028	500	493	0,05	Market Bidco Finco PLC 4,750 % fällig am 04.11.2027	€ 2.100	1.808	0,17
Sunshine Luxembourg SARL 8,480 % fällig am 01.10.2026	1.720	1.651	0,15	HSBC Holdings PLC 2,848 % fällig am 04.06.2031	5.900	4.721	0,44	Marriott International, Inc. 4,625 % fällig am 15.06.2030	\$ 530	496	0,05
Syniverse Holdings, Inc. 11,580 % fällig am 13.05.2027	58	51	0,01	4,950 % fällig am 31.03.2030	1.320	1.262	0,12	Melco Resorts Finance Ltd. 5,625 % fällig am 17.07.2027	900	773	0,07
TransDigm, Inc. 6,980 % fällig am 30.05.2025	5.419	5.370	0,50	Huarong Finance Co. Ltd. 2,500 % fällig am 24.02.2023	1.600	1.588	0,15	Mitchells & Butlers Finance PLC 6,013 % fällig am 15.12.2030	£ 37	42	0,00
6,980 % fällig am 09.12.2025	8.668	8.579	0,79	3,875 % fällig am 13.11.2029	1.340	1.060	0,10	Motorola Solutions, Inc. 2,300 % fällig am 15.11.2030	\$ 4.383	3.437	0,32
Uber Technologies, Inc. 8,235 % fällig am 04.04.2025	8.431	8.436	0,78	Intesa Sanpaolo SpA 7,750 % fällig am 11.01.2027 (g)(i)	€ 1.200	1.239	0,11	Netflix, Inc. 3,625 % fällig am 15.06.2030	€ 100	99	0,01
United Airlines, Inc. 8,108 % fällig am 21.04.2028	1.142	1.131	0,10	Lloyds Banking Group PLC 4,947 % fällig am 27.06.2025 (g)(i)	200	205	0,02	Nissan Motor Co. Ltd. 4,345 % fällig am 17.09.2027	\$ 2.800	2.543	0,24
Westmoreland Coal Co. (15,000 % PIK) 15,000 % fällig am 15.03.2029 (b)	14	11	0,00	MPT Operating Partnership LP 3,692 % fällig am 05.06.2028	£ 100	88	0,01	4,810 % fällig am 17.09.2030	300	255	0,02
Windstream Services LLC 10,673 % fällig am 21.09.2027	3	3	0,00	Nationwide Building Society 4,302 % fällig am 08.03.2029	\$ 2.100	1.898	0,18	NMG Holding Co., Inc. 7,125 % fällig am 01.04.2026	400	376	0,04
Wm Morrison Supermarkets PLC 6,552 % fällig am 04.11.2027	€ 1.536	1.447	0,13	Navigent Corp. 5,500 % fällig am 25.01.2023	2.900	2.900	0,27	Noble Finance Co. (11,000 % bar oder 15,000 % PIK) 11,000 % fällig am 15.02.2028 (b)	67	74	0,01
6,552 % fällig am 31.07.2028	838	789	0,07	Omega Healthcare Investors, Inc. 3,625 % fällig am 01.10.2029	62	51	0,00	NPC Ukrenargo 6,875 % fällig am 09.11.2028 ^	200	36	0,00
		69.492	6,41	OneMain Finance Corp. 5,625 % fällig am 15.03.2023	2.794	2.788	0,26	Petroleos de Venezuela S.A. 6,000 % fällig am 16.05.2024 ^	220	11	0,00
				Park Aerospace Holdings Ltd. 4,500 % fällig am 15.03.2023	587	586	0,05	Petroleos Mexicanos 5,950 % fällig am 28.01.2031	4.300	3.264	0,30
				Santander UK Group Holdings PLC 6,750 % fällig am 24.06.2024 (g)(i)	£ 4.169	4.832	0,45	6,700 % fällig am 16.02.2032	1.831	1.441	0,13
				SLM Student Loan Trust 2,596 % fällig am 15.12.2033	€ 3.416	3.480	0,32	Prime Healthcare Services, Inc. 7,250 % fällig am 01.11.2025	6.355	5.380	0,50
				UBS AG 5,125 % fällig am 15.05.2024 (i)	\$ 5.770	5.707	0,53	RegionalCare Hospital Partners Holdings, Inc. 9,750 % fällig am 01.12.2026	4.100	3.308	0,31
				UniCredit SpA 7,830 % fällig am 04.12.2023	12.260	12.390	1,14	Rolls-Royce PLC 4,625 % fällig am 16.02.2026	€ 2.900	3.010	0,28
				Unique Pub Finance Co. PLC 7,395 % fällig am 28.03.2024	£ 37	44	0,00	5,750 % fällig am 15.10.2027	£ 1.700	1.882	0,17
				Uniti Group LP 6,500 % fällig am 15.02.2029	\$ 1.875	1.246	0,11	Royal Caribbean Cruises Ltd. 11,500 % fällig am 01.06.2025	\$ 1.219	1.310	0,12
				7,875 % fällig am 15.02.2025	7.504	7.280	0,67	Sands China Ltd. 2,800 % fällig am 08.03.2027	1.700	1.458	0,13
				VICI Properties LP 4,500 % fällig am 01.09.2026	2.000	1.885	0,17	3,350 % fällig am 08.03.2029	400	327	0,03
				4,500 % fällig am 15.01.2028	4.325	3.993	0,37	4,300 % fällig am 08.01.2026	2.100	1.941	0,18
				4,625 % fällig am 01.12.2029	4.900	4.467	0,41				
						109.532	10,10				

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Low Duration Income Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
TBW Mortgage-Backed Trust 5,965 % fällig am 25.07.2037	\$ 115	\$ 37	0,00	6,500 % fällig am 25.06.2046	\$ 52	\$ 42	0,00	7,150 % fällig am 12.11.2025	RUB 19.414	\$ 82	0,01
Temple Quay PLC 0,000 % fällig am 24.07.2085	£ 17.600	20.826	1,91	6,689 % fällig am 25.12.2037	1.344	1.320	0,12	7,950 % fällig am 07.10.2026	13.158	\$ 56	0,01
Tharaldson Hotel Portfolio Trust 5,268 % fällig am 11.11.2034	\$ 227	221	0,02	Long Beach Mortgage Loan Trust 4,669 % fällig am 25.06.2036	505	473	0,04	South Africa Government International Bond 10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR 204.800	12.725	1,17
Thornburg Mortgage Securities Trust 3,535 % fällig am 25.12.2042	83	78	0,01	4,989 % fällig am 25.01.2036	3.176	2.881	0,27	Turkey Government International Bond 4,250 % fällig am 13.03.2025	\$ 1.200	1.125	0,10
Towd Point Mortgage Funding PLC 3,826 % fällig am 20.07.2045	£ 1.343	1.599	0,15	Man GLG Euro CLO DAC 2,118 % fällig am 15.10.2030	€ 2.912	3.034	0,28	5,250 % fällig am 13.03.2030	1.000	807	0,07
4,071 % fällig am 20.10.2051	3.293	3.938	0,36	Merrill Lynch Mortgage Investors Trust 4,539 % fällig am 25.08.2037	\$ 326	304	0,03	5,750 % fällig am 11.05.2047	741	508	0,05
4,190 % fällig am 20.02.2045	1.781	2.114	0,19	4,669 % fällig am 25.05.2037	4.574	2.554	0,24	Venezuela Government International Bond 8,250 % fällig am 13.10.2024 ^	2.000	175	0,02
4,471 % fällig am 20.02.2054	4.658	5.581	0,51	Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust 3,549 % fällig am 25.01.2035	1.330	1.112	0,10	9,000 % fällig am 07.05.2023 ^	1.600	140	0,01
Trinidad Mortgage Securities PLC 3,900 % fällig am 24.01.2059	10	12	0,00	4,589 % fällig am 25.05.2037	1.008	538	0,05				
Trinity Square PLC 5,629 % fällig am 15.07.2059	1.000	1.152	0,11	4,689 % fällig am 25.06.2036	1.899	1.654	0,15				
Twin Bridges PLC 4,386 % fällig am 12.09.2050	1.507	1.809	0,17	5,304 % fällig am 25.03.2035	251	246	0,02				
Verus Securitization Trust 1,977 % fällig am 25.03.2060	\$ 131	126	0,01	Oak Hill European Credit Partners DAC 2,186 % fällig am 20.01.2032	€ 2.754	2.869	0,26				
3,035 % fällig am 25.03.2060	100	92	0,01	Option One Mortgage Loan Trust 4,639 % fällig am 25.03.2037	\$ 5.076	2.501	0,23				
3,889 % fällig am 25.03.2060	200	182	0,02	5,814 % fällig am 25.11.2034	881	852	0,08				
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust 3,093 % fällig am 25.02.2037 ^	744	664	0,06	Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates 5,964 % fällig am 25.02.2035	9.677	9.278	0,86				
5,149 % fällig am 25.01.2045	85	82	0,01	Pretium Mortgage Credit Partners LLC 2,487 % fällig am 25.07.2051	2.526	2.345	0,22				
		211.261	19,47	Residential Asset Mortgage Products Trust 5,469 % fällig am 25.03.2035	2.000	1.891	0,17				
				SoFi Professional Loan Program LLC 2,630 % fällig am 25.07.2040	370	363	0,03				
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				Starwood Commercial Mortgage Trust 5,520 % fällig am 15.07.2038	6.585	6.454	0,60				
ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust 4,829 % fällig am 25.05.2037	8.392	1.449	0,13	Structured Asset Investment Loan Trust 5,109 % fällig am 25.01.2036	521	497	0,05				
Aegis Asset-Backed Securities Trust Mortgage Pass-Through Certificates 6,339 % fällig am 25.06.2034	1.784	1.683	0,16	5,389 % fällig am 25.09.2034	1.298	1.249	0,12				
Amortizing Residential Collateral Trust 5,089 % fällig am 25.10.2031	193	185	0,02	Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust 4,619 % fällig am 25.05.2047	206	198	0,02				
Argent Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates 5,154 % fällig am 25.10.2035	100	89	0,01	5,364 % fällig am 25.05.2035	2.900	2.815	0,26				
Asset-Backed Securities Corp. Home Equity Loan Trust 2,801 % fällig am 25.07.2036	4.140	3.888	0,36	Terwin Mortgage Trust 5,769 % fällig am 25.03.2035	406	380	0,03				
3,479 % fällig am 25.05.2036	6.449	5.836	0,54	Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust 6,114 % fällig am 25.11.2035	2.250	2.204	0,20				
Auto Abs Spanish Loans 4,410 % fällig am 28.02.2032	€ 3.300	3.383	0,31			96.807	8,93				
Bayview Financial Asset Trust 5,889 % fällig am 25.03.2037	\$ 460	457	0,04								
Carrington Mortgage Loan Trust 5,379 % fällig am 25.06.2035	3.829	3.692	0,34	STAATSEMISSIONEN							
College Avenue Student Loans LLC 4,130 % fällig am 26.12.2047	22	21	0,00	Argentina Government International Bond 0,500 % fällig am 09.07.2030	2.796	708	0,06				
5,589 % fällig am 26.12.2047	22	22	0,00	1,000 % fällig am 09.07.2029	120	32	0,00				
Countrywide Asset-Backed Certificates 5,589 % fällig am 25.10.2035	1.089	1.065	0,10	1,500 % fällig am 09.07.2035	1.732	415	0,04				
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust 4,529 % fällig am 25.06.2047	1.963	1.799	0,17	3,500 % fällig am 09.07.2041	3.129	897	0,08				
4,599 % fällig am 25.05.2047 ^	6.541	5.789	0,53	15,500 % fällig am 17.10.2026	ARS 1.188	1	0,00				
Denali Capital CLO Ltd. 5,129 % fällig am 15.04.2031	1.798	1.766	0,16	Argentina Treasury Bond BONCER 1,400 % fällig am 25.03.2023	241.160	732	0,07				
Fremont Home Loan Trust 4,539 % fällig am 25.10.2036	1.287	544	0,05	Australia Government International Bond 1,750 % fällig am 21.06.2051	AUD 2.500	982	0,09				
GSA Home Equity Trust 4,769 % fällig am 25.03.2036	2.414	894	0,08	Autonomous City of Buenos Aires 72,479 % fällig am 29.03.2024 (a)	ARS 610	2	0,00				
Harvest SBA Loan Trust 6,266 % fällig am 25.08.2044	201	201	0,02	Japan Government International Bond 0,100 % fällig am 01.03.2023	¥ 511.000	3.874	0,36				
Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust 4,549 % fällig am 25.07.2037	384	208	0,02	Peru Government International Bond 5,350 % fällig am 12.08.2040	PEN 1.041	205	0,02				
4,589 % fällig am 25.07.2037	5.145	2.787	0,26	5,400 % fällig am 12.08.2034	1	0	0,00				
HSI Asset Securitization Corp. Trust 4,529 % fällig am 25.12.2036	9.085	7.640	0,70	5,940 % fällig am 12.02.2029	4.493	1.082	0,10				
4,579 % fällig am 25.01.2037	2.965	2.128	0,20	6,150 % fällig am 12.08.2032	88	20	0,00				
IXIS Real Estate Capital Trust 4,849 % fällig am 25.01.2037	3.445	1.363	0,13	6,350 % fällig am 12.08.2028	1.097	274	0,03				
JPMorgan Mortgage Acquisition Trust 4,649 % fällig am 25.06.2037	581	577	0,05	6,950 % fällig am 12.08.2031	59	15	0,00				
Lehman XS Trust 4,909 % fällig am 25.05.2046 ^	1.473	1.287	0,12	8,200 % fällig am 12.08.2026	2.424	666	0,06				

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	% DES		BESCHREIBUNG	AKTIEN	% DES	
		MARKT- WERT (000S)	NETTO- VERMÖ- -GENS			MARKT- WERT (000S)	NETTO- VERMÖ- -GENS
(0,170) % fällig am 06.01.2023 (d)(e)	¥ 190.000	\$ 1.440	0,13				
(0,170) % fällig am 16.01.2023 (d)(e)	330.000	2.501	0,23				
(0,169) % fällig am 11.01.2023 (d)(e)	270.000	2.046	0,19				
(0,166) % fällig am 13.03.2023 (d)(e)	581.000	4.405	0,41				
(0,138) % fällig am 06.03.2023 (d)(e)	1.863.000	14.124	1,30				
(0,130) % fällig am 20.02.2023 (d)(e)	2.220.000	16.829	1,55				
		50.177	4,63				
Summe kurzfristige Instrumente		56.477	5,21				
				Summe Investmentfonds	10.663.073	\$ 106.140	9,79
						\$ 106.140	9,79
Summe Übertragbare Wertpapiere	\$ 1.213.608		111,91				

PENSIONS-GESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kapital- betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions- geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions- geschäft ⁽¹⁾		% des Netto- vermögens
								\$	\$	
FICC	1,900 %	30.12.2022	03.01.2023	\$ 5.431	U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 08.06.2023	\$ (5.540)	\$ 5.431	\$ 5.432	0,50	
MBC	4,320	30.12.2022	03.01.2023	93.400	U.S. Treasury Notes 2,000 % fällig am 30.04.2024	(96.407)	93.400	93.445	8,61	
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (101.947)	\$ 98.831	\$ 98.877	9,11	

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
3-Month SOFR December Futures	Short	03.2024	42	\$ 194	0,02
3-Month SOFR December Futures	Short	03.2025	22	60	0,01
3-Month SOFR December Futures	Short	03.2026	23	59	0,01
3-Month SOFR June Futures	Short	09.2024	29	99	0,01
3-Month SOFR June Futures	Short	09.2025	22	57	0,01
3-Month SOFR March Futures	Short	06.2024	35	140	0,01
3-Month SOFR March Futures	Short	06.2025	20	53	0,00
3-Month SOFR March Futures	Short	06.2026	21	53	0,00
3-Month SOFR September Futures	Short	12.2024	26	77	0,01
3-Month SOFR September Futures	Short	12.2025	17	44	0,00
Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 146,000 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond February 2023 Futures ⁽¹⁾	Short	01.2023	27	22	0,00
Euro-Bund 10-Year Bond March Futures	Short	03.2023	76	695	0,06
Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 138,500 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond February 2023 Futures ⁽¹⁾	Short	01.2023	27	(138)	(0,01)
U.S. Treasury 5-Year Note March Futures	Short	03.2023	81	4	0,00
U.S. Treasury 10-Year Note March Futures	Short	03.2023	1.287	776	0,07
U.S. Treasury 30-Year Bond March Futures	Short	03.2023	26	(2)	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond March Futures	Long	03.2023	23	(4)	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond March Futures	Short	03.2023	82	(25)	0,00
				\$ 2.164	0,20

(1) Future-Style-Option.

VERKAUFSOPTIONEN

OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
Call – CME Kaufoptionen mit Ausübungskurs von USD 98,000 auf 3-Month SOFR December Futures	\$ 98,000	15.12.2023	50	\$ (40)	\$ (4)	0,00
Put – CME Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von USD 96,500 auf 3-Month SOFR December Futures	96,500	15.12.2023	50	(47)	(152)	(0,01)
				\$ (87)	\$ (156)	(0,01)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate					\$ 2.008	0,19

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Low Duration Income Fund (Forts.)

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Airbus Finance BV	1,000 %	20.12.2025	€ 7.600	\$ 135	0,01
Airbus Finance BV	1,000	20.06.2026	3.100	(70)	(0,01)
Airbus Finance BV	1,000	20.06.2028	200	(6)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2023	\$ 400	0	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2025	700	19	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.12.2025	2.500	(30)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2026	4.700	(69)	(0,01)
Boeing Co.	1,000	20.06.2023	2.900	(4)	0,00
Boeing Co.	1,000	20.12.2023	1.000	8	0,00
Boeing Co.	1,000	20.12.2026	2.500	(9)	0,00
Bombardier, Inc.	5,000	20.06.2024	200	15	0,00
Bombardier, Inc.	5,000	20.06.2025	100	12	0,00
Devon Energy Corp.	1,000	20.12.2026	1.500	8	0,00
Ford Motor Co.	5,000	20.12.2024	2.600	(126)	(0,01)
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20.06.2025	100	1	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20.06.2026	100	2	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20.06.2027	200	3	0,00
General Electric Co.	1,000	20.12.2023	400	31	0,01
General Electric Co.	1,000	20.06.2026	6.500	(11)	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20.12.2025	€ 2.600	157	0,02
Rolls-Royce PLC	1,000	20.12.2026	800	(28)	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20.06.2027	1.300	(8)	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.06.2026	\$ 3.000	(65)	(0,01)
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.12.2026	400	(10)	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.06.2027	2.400	(6)	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.12.2027	2.100	14	0,00
				\$ (37)	0,00

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.EM-31 5-Year Index	1,000 %	20.06.2024	\$ 688	\$ 23	0,00
CDX.EM-32 5-Year Index	1,000	20.12.2024	510	19	0,00
CDX.EM-34 5-Year Index	1,000	20.12.2025	1.196	(11)	0,00
CDX.EM-36 5-Year Index	1,000	20.12.2026	13.708	58	0,01
CDX.EM-38 5-Year Index	1,000	20.12.2027	3.500	90	0,01
CDX.HY-36 5-Year Index	5,000	20.06.2026	5.841	(347)	(0,04)
CDX.HY-37 5-Year Index	5,000	20.12.2026	2.277	(55)	(0,01)
CDX.HY-39 5-Year Index	5,000	20.12.2027	900	45	0,00
CDX.IG-39 5-Year Index	1,000	20.12.2027	2.500	21	0,00
iTraxx Asia Ex-Japan 38 5-Year Index	1,000	20.12.2027	3.300	55	0,01
iTraxx Crossover 38 5-Year Index	5,000	20.12.2027	€ 500	24	0,00
iTraxx Europe Main 37 5-Year Index	1,000	20.06.2027	18.000	69	0,01
iTraxx Europe Main 38 5-Year Index	1,000	20.12.2027	3.800	59	0,01
				\$ 50	0,00

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fest- Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Netto- vermögens
Zahlung	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	1,060 %	21.02.2052	£ 300	\$ (154)	(0,01)
Zahlung	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	1,096	14.02.2052	600	(302)	(0,03)
Zahlung	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	1,101	21.02.2052	300	(151)	(0,01)
Zahlung	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	1,175	28.02.2052	600	(291)	(0,03)
Erhalt ⁽³⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	2,000	15.03.2053	2.300	20	0,00
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000	15.03.2029	¥ 8.473.000	2.242	0,21
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,176	27.04.2027	550.000	(58)	(0,01)
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,400	15.06.2032	2.140.000	665	0,06
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,500	15.03.2042	1.140.000	725	0,07
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,711	27.04.2042	140.000	93	0,01
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,000	15.06.2027	\$ 3.600	302	0,03
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,000	15.06.2029	4.070	419	0,04
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,250	15.06.2032	22.690	(2.569)	(0,24)
Erhalt ⁽³⁾	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,600	16.01.2026	17.200	410	0,04
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,650	08.02.2032	1.700	(247)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,730	24.02.2032	1.600	(224)	(0,02)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2025	38.000	1.363	0,13
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2029	3.538	184	0,02
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2032	1.608	84	0,01
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2052	28.100	4.274	0,39
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,765	16.03.2032	600	(83)	(0,01)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fest- Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Netto- vermögens
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,783 %	22.04.2027	\$ 2.100	\$ (169)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,788	03.05.2027	2.300	(187)	(0,02)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,000	21.12.2027	2.100	15	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,000	21.12.2029	11.170	(5)	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,000	21.12.2032	10.680	106	0,01
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,250	17.06.2027	5.600	(348)	(0,03)
Erhalt ⁽³⁾	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,300	17.01.2026	12.300	291	0,03
Erhalt ⁽³⁾	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,350	17.01.2025	21.900	322	0,03
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,385	08.06.2032	1.400	119	0,01
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,436	08.06.2032	6.800	554	0,05
Erhalt ⁽³⁾	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,450	20.12.2024	43.700	654	0,06
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,450	04.10.2027	5.430	326	0,03
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,451	08.06.2032	8.700	699	0,07
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,605	28.06.2027	3.900	(177)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,900	04.10.2027	15.500	(500)	(0,05)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,050	07.09.2027	1.400	(38)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,050	08.09.2029	1.400	(42)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,050	06.09.2032	2.000	(69)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,100	09.09.2029	1.400	(37)	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,350	14.12.2032	500	11	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,610	12.12.2032	1.100	1	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	5,830	02.01.2023	BRL 5.100	(17)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	5,836	02.01.2023	4.600	(15)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	5,855	02.01.2023	1.500	(5)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,140	02.01.2025	100	(1)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,160	02.01.2025	100	(1)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,220	04.01.2027	200	(1)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,245	04.01.2027	100	(1)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,260	04.01.2027	100	(1)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,350	02.01.2025	100	(1)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,715	04.01.2027	200	(1)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,870	04.01.2027	500	(2)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,000	02.01.2025	300	(1)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,015	04.01.2027	57.400	(174)	(0,02)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,080	02.01.2025	500	(1)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,140	02.01.2025	300	(1)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,145	02.01.2025	300	(1)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,160	02.01.2025	500	(1)	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	12,670	02.01.2023	400	0	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	12,690	02.01.2023	300	0	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	12,740	02.01.2023	700	0	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	12,750	02.01.2023	300	0	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	12,760	02.01.2023	800	0	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	12,900	02.01.2023	1.500	0	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	12,930	02.01.2023	200	0	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	12,939	02.01.2023	800	0	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	12,946	02.01.2023	2.000	0	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	12,960	02.01.2023	1.500	0	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	12,970	02.01.2023	2.600	1	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,500	16.06.2026	\$ 88.900	8.743	0,81
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,500	16.06.2028	10.869	(1.315)	(0,12)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,750	16.06.2031	76.933	(10.170)	(0,94)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,928	06.05.2026	2.200	241	0,02
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,940	08.06.2026	2.900	310	0,03
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,000	16.12.2030	20.713	4.651	0,43
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,030	17.06.2026	3.600	373	0,04
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,235	12.05.2028	1.100	153	0,01
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,250	17.06.2030	4.400	533	0,05
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,250	16.12.2050	12.600	3.991	0,37
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,250	16.06.2051	8.700	2.196	0,20
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,270	04.11.2023	283.500	(8.903)	(0,82)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,317	16.12.2050	400	(152)	(0,01)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,360	15.02.2027	6.700	701	0,07
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,360	20.07.2031	1.400	260	0,02
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,370	19.07.2031	900	167	0,02
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,380	04.01.2027	3.600	(364)	(0,03)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,418	20.01.2027	1.300	(131)	(0,01)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,425	18.01.2027	2.500	(249)	(0,02)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,438	22.01.2051	9.000	(3.300)	(0,30)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,450	17.02.2027	6.300	636	0,06
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,450	16.07.2031	2.000	361	0,03
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,500	15.12.2028	7.919	(1.211)	(0,11)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,500	18.12.2029	1.200	140	0,01
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,500	05.10.2031	1.500	(266)	(0,02)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,500	17.06.2050	7.700	3.910	0,36
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,518	20.01.2029	800	(103)	(0,01)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,535	15.10.2031	1.500	(263)	(0,02)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,535	22.10.2031	1.000	(175)	(0,02)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,545	26.10.2031	1.000	(174)	(0,02)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,570	12.01.2027	1.400	(131)	(0,01)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,580	16.02.2027	2.800	(260)	(0,02)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,580	13.01.2051	9.300	(3.227)	(0,30)

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Low Duration Income Fund (Forts.)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fest- Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Netto- vermögens
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,600 %	15.02.2027	\$ 26.800	\$ (2.449)	(0,23)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,625	06.01.2030	300	47	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,630	26.01.2029	1.300	(159)	(0,01)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,655	24.01.2032	1.300	(215)	(0,02)
Zahlung ⁽³⁾	3-Month USD-LIBOR	1,700	06.03.2024	6.400	(204)	(0,02)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,700	17.02.2027	25.000	(2.171)	(0,20)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,735	12.01.2032	1.100	(174)	(0,02)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,750	15.01.2030	4.600	662	0,06
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,768	02.02.2032	1.000	(155)	(0,01)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,785	12.08.2051	1.100	362	0,03
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,815	24.01.2052	300	(91)	(0,01)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,867	26.01.2052	300	(88)	(0,01)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,910	17.10.2049	400	126	0,01
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,988	09.02.2032	1.100	148	0,01
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,000	10.12.2029	21.000	2.700	0,25
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,000	12.02.2030	2.500	334	0,03
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,000	10.03.2030	1.200	139	0,01
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,008	09.02.2032	1.900	257	0,02
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,250	12.03.2050	15.700	3.596	0,34
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,543	05.02.2024	1.000	24	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,550	05.02.2024	1.000	24	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,559	05.02.2024	1.000	23	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,571	05.02.2024	500	12	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,580	05.02.2024	1.500	35	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,605	05.02.2024	1.500	34	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,607	05.02.2024	500	11	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,750	19.12.2023	19.100	258	0,02
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	3,000	19.06.2024	24.000	1.436	0,13
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	3,000	19.06.2026	12.700	983	0,09
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	4,848	11.01.2026	ZAR 16.900	(81)	(0,01)
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	7,710	23.11.2025	6.600	1	0,00
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	3,000	21.03.2027	AUD 12.400	(651)	(0,06)
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,250	18.03.2050	€ 2.500	1.057	0,10
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,294	30.06.2026	100	13	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,329	30.12.2025	200	22	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,363	30.06.2025	300	29	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,395	30.12.2024	200	16	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,425	28.06.2024	300	18	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,453	29.12.2023	400	16	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,500	17.06.2050	600	274	0,03
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,550	10.08.2024	2.400	(103)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,650	11.05.2027	14.200	(1.449)	(0,13)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,700	11.04.2027	4.800	(482)	(0,04)
Erhalt ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	0,830	09.12.2052	16.100	475	0,04
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,000	13.05.2027	9.800	(867)	(0,08)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,000	18.05.2027	4.700	(415)	(0,04)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,750	21.09.2027	3.500	(232)	(0,02)
Erhalt ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	1,750	15.03.2033	12.100	276	0,03
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,000	21.09.2032	8.900	(1.058)	(0,10)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	4,470	27.02.2023	MXN 46.600	(35)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	4,500	03.03.2023	297.900	(221)	(0,02)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	4,520	27.02.2023	93.200	(69)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	4,550	27.02.2023	394.100	(299)	(0,03)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	4,560	27.02.2023	45.700	(34)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	4,565	27.02.2023	46.600	(34)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,320	30.03.2023	924.260	361	0,03
Zahlung	UKRPI	4,000	15.09.2031	£ 900	(129)	(0,01)
Zahlung	UKRPI	4,020	15.10.2031	1.200	(163)	(0,01)
Zahlung	UKRPI	4,055	15.09.2031	800	(113)	(0,01)
Zahlung	UKRPI	4,066	15.09.2031	1.700	(209)	(0,02)
Zahlung	UKRPI	4,140	15.10.2031	2.300	(278)	(0,03)
					\$ 6.117	0,57
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					\$ 6.130	0,57

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definieren.

(3) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

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

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

OPTIONSKAUF

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Kosten	Markt-wert	% des Netto-vermögens
GLM	Call – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,110 %	26.07.2032	1.100	\$ 178	\$ 142	0,01
	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,110	26.07.2032	1.600	259	330	0,03
MYC	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,053	20.07.2023	15.900	96	6	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,053	20.07.2023	15.900	96	235	0,02
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,620	22.07.2024	15.900	119	56	0,01
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,620	22.07.2024	15.900	119	178	0,02
	Call – OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,590	19.07.2024	11.300	156	83	0,01
	Put – OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,590	19.07.2024	11.300	155	232	0,02
	Call – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,400	20.07.2027	1.200	158	116	0,01
	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,400	20.07.2027	1.400	185	256	0,02
	Call – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,170	19.07.2032	1.200	190	158	0,01
	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,170	19.07.2032	1.400	222	280	0,03
							\$ 1.933	\$ 2.072	0,19

VERKAUFSOPTIONEN

CREDIT DEFAULT SWAPPTIONS AUF KREDITINDIZES

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/-verkauf	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Netto-vermögens
GST	Put – OTC iTraxx Europe 37 5-Year Index	Verkauf	3,000 %	15.03.2023	2.800	\$ (5)	\$ (1)	0,00

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Netto-vermögens
BOA	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,150 %	01.12.2023	6.000	\$ (19)	\$ (4)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	01.12.2023	6.000	(19)	(45)	(0,01)
	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,000	19.01.2023	1.900	(8)	(1)	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,500	19.01.2023	1.900	(8)	(23)	0,00
BPS	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,550	11.04.2023	1.800	(2)	0	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,100	11.04.2023	1.800	(6)	(28)	0,00
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,700	28.04.2023	9.600	(17)	0	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,250	28.04.2023	9.600	(17)	(136)	(0,01)
	Call – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,150	09.01.2023	4.200	(15)	0	0,00
	Put – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	09.01.2023	4.200	(15)	(25)	0,00
	Call – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,270	23.01.2023	1.900	(5)	(1)	0,00
	Put – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,770	23.01.2023	1.900	(5)	(10)	0,00
BRC	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,000	19.01.2023	1.900	(8)	(1)	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,500	19.01.2023	1.900	(8)	(23)	0,00
	Call – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,200	12.01.2023	6.000	(18)	(1)	0,00
	Put – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,800	12.01.2023	6.000	(18)	(20)	0,00
CBK	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,690	02.04.2024	2.100	(16)	(6)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,690	02.04.2024	2.100	(16)	(26)	0,00
	Call – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,150	09.01.2023	3.900	(14)	0	0,00
	Put – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	09.01.2023	3.900	(14)	(23)	0,00
DUB	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,920	13.10.2023	4.800	(29)	(5)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,920	13.10.2023	4.800	(29)	(66)	(0,01)
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,790	08.04.2024	3.300	(25)	(11)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,790	08.04.2024	3.300	(25)	(39)	0,00
GLM	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,765	25.07.2023	6.900	(43)	(3)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,765	25.07.2023	6.900	(43)	(121)	(0,01)
	Call – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,468	25.07.2023	1.500	(36)	(6)	0,00
	Put – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,468	25.07.2023	1.500	(36)	(79)	(0,01)
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,920	13.10.2023	4.800	(30)	(5)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,920	13.10.2023	4.800	(30)	(66)	(0,01)
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,018	20.10.2023	3.900	(25)	(5)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,018	20.10.2023	3.900	(25)	(50)	(0,01)
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,140	23.10.2023	3.900	(27)	(6)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,140	23.10.2023	3.900	(27)	(46)	(0,01)
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,190	23.10.2023	3.900	(27)	(6)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,190	23.10.2023	3.900	(27)	(44)	0,00
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,225	23.10.2023	3.900	(27)	(6)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,225	23.10.2023	3.900	(27)	(43)	0,00
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,973	25.10.2023	3.900	(27)	(5)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,973	25.10.2023	3.900	(27)	(51)	(0,01)
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,841	27.10.2023	3.800	(26)	(4)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,841	27.10.2023	3.800	(26)	(53)	(0,01)
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,088	03.11.2023	3.800	(28)	(6)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,088	03.11.2023	3.800	(28)	(45)	0,00
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,910	10.11.2023	3.700	(25)	(5)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,910	10.11.2023	3.700	(25)	(49)	(0,01)
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,250	17.11.2023	7.200	(26)	(5)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	17.11.2023	7.200	(26)	(51)	(0,01)
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,150	20.11.2023	7.200	(25)	(4)	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Low Duration Income Fund (Forts.)

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Netto- vermögens
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,650 %	20.11.2023	7.200	\$ (25)	\$ (56)	(0,01)
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,250	07.12.2023	6.100	(19)	(5)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,750	07.12.2023	6.100	(19)	(42)	0,00
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,697	02.04.2024	12.300	(96)	(37)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,697	02.04.2024	12.300	(96)	(154)	(0,01)
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,721	08.04.2024	4.100	(31)	(13)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,721	08.04.2024	4.100	(31)	(50)	(0,01)
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,550	05.04.2023	9.900	(18)	0	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,100	05.04.2023	9.900	(18)	(153)	(0,01)
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,550	11.04.2023	13.200	(25)	0	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,100	11.04.2023	13.200	(25)	(205)	(0,02)
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,700	24.04.2023	9.900	(11)	0	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,250	24.04.2023	9.900	(28)	(140)	(0,01)
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,700	26.04.2023	9.200	(16)	0	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,250	26.04.2023	9.200	(16)	(130)	(0,01)
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,550	15.05.2023	8.600	(15)	0	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,100	15.05.2023	8.600	(15)	(137)	(0,01)
	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,547	07.03.2023	4.900	(108)	(11)	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,547	07.03.2023	4.900	(108)	(309)	(0,03)
	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,067	09.06.2023	4.400	(55)	(11)	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	3,140	09.06.2023	4.400	(60)	(144)	(0,01)
	Call – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,230	23.01.2023	5.500	(14)	(3)	0,00
	Put – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,730	23.01.2023	5.500	(14)	(33)	0,00
MYC	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,050	19.07.2023	6.900	(41)	(4)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,050	19.07.2023	6.900	(41)	(104)	(0,01)
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,052	20.07.2023	6.900	(42)	(4)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,052	20.07.2023	6.900	(42)	(103)	(0,01)
	Call – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,700	19.07.2023	1.500	(35)	(9)	0,00
	Put – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,700	19.07.2023	1.500	(35)	(66)	(0,01)
	Call – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,675	20.07.2023	1.500	(35)	(8)	0,00
	Put – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,675	20.07.2023	1.500	(35)	(67)	(0,01)
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,993	11.10.2023	4.400	(30)	(6)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,993	11.10.2023	4.400	(30)	(60)	(0,01)
	Call – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,550	19.07.2023	400	(29)	(9)	0,00
	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,550	19.07.2023	400	(29)	(53)	(0,01)
	Call – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,537	20.07.2023	400	(29)	(9)	0,00
	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,537	20.07.2023	400	(29)	(54)	(0,01)
							\$ (2.420)	\$ (3.447)	(0,32)

⁽¹⁾ Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

ZINSCAPS

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽²⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Netto- vermögens
MYC	Call – OTC 1-Year Interest Rate Floor ⁽¹⁾	1-Year USD-LIBOR	0,030 %	24.07.2024	15.900	\$ (119)	\$ (248)	(0,02)
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Floor ⁽¹⁾	1-Year USD-LIBOR	0,030	24.07.2024	15.900	(119)	(22)	0,00
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Floor ⁽¹⁾	1-Year USD-LIBOR	0,026	23.07.2025	15.900	(139)	(197)	(0,02)
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Floor ⁽¹⁾	1-Year USD-LIBOR	0,026	23.07.2025	15.900	(139)	(76)	(0,01)
	Call – OTC 2-Year Interest Rate Floor ⁽¹⁾	2-Year USD-LIBOR	0,026	23.07.2026	11.300	(200)	(279)	(0,02)
	Put – OTC 2-Year Interest Rate Floor ⁽¹⁾	2-Year USD-LIBOR	0,026	23.07.2026	11.300	(200)	(128)	(0,01)
						\$ (916)	\$ (950)	(0,08)

⁽¹⁾ Das zugrunde liegende Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

⁽²⁾ Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Netto- vermögens
BOA	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.02.2053	\$ 99,813	06.02.2023	500	\$ (3)	\$ (3)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.02.2053	100,000	06.02.2023	400	(3)	(3)	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.02.2053	101,813	06.02.2023	500	(3)	(1)	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.02.2053	102,000	06.02.2023	400	(2)	(1)	0,00
SAL	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fällig am 01.03.2053	97,578	06.03.2023	600	(5)	(5)	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fällig am 01.03.2053	99,578	06.03.2023	600	(4)	(4)	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.01.2053	101,859	05.01.2023	3.300	(10)	0	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.01.2053	102,250	05.01.2023	2.200	(6)	0	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.02.2053	99,750	06.02.2023	3.600	(26)	(22)	(0,01)
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.02.2053	100,000	06.02.2023	1.100	(8)	(8)	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.02.2053	101,750	06.02.2023	3.600	(21)	(8)	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.02.2053	102,000	06.02.2023	1.100	(7)	(2)	0,00
					\$ (98)	\$ (57)	(0,01)

⁽¹⁾ Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Kontrahent	Referenzinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽²⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	Brazil Government International Bond	1,000 %	20.06.2023	\$ 100	\$ (6)	\$ 6	\$ 0	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.12.2024	100	(12)	6	(6)	0,00
BPS	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2027	500	(45)	9	(36)	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2024	100	(2)	3	1	0,00
BRC	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2026	900	(41)	(1)	(42)	(0,01)
	Turkey Government International Bond	1,000	20.12.2023	200	(13)	8	(5)	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.12.2024	640	(82)	45	(37)	0,00
CBK	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2027	400	(14)	(10)	(24)	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2024	100	(2)	3	1	0,00
DUB	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2026	100	(4)	0	(4)	0,00
GST	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2027	500	(18)	(12)	(30)	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2027	300	(27)	5	(22)	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2025	200	(11)	7	(4)	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.12.2024	700	(79)	37	(42)	(0,01)
HUS	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2023	300	(10)	11	1	0,00
	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2024	600	(18)	18	0	0,00
MYC	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2027	700	(27)	(15)	(42)	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2027	800	(71)	13	(58)	(0,01)
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2024	300	(2)	3	1	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2025	200	(3)	4	1	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2026	1.400	(62)	8	(54)	(0,01)
	Turkey Government International Bond	1,000	20.06.2024	100	(16)	12	(4)	0,00
					\$ (565)	\$ 160	\$ (405)	(0,04)

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Kontrahent	Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽²⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
GST	CMBX.NA.AAA.13 Index	0,500 %	16.12.2072	\$ 62.300	\$ 92	\$ (876)	\$ (784)	(0,07)
MEI	CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17.08.2061	15.300	(74)	(48)	(122)	(0,01)
MYC	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	25.375	(78)	21	(57)	(0,01)
	CMBX.NA.AAA.11 Index	0,500	18.11.2054	25.375	(193)	73	(120)	(0,01)
	CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17.08.2061	300	(2)	0	(2)	0,00
	CMBX.NA.AAA.13 Index	0,500	16.12.2072	25.500	86	(407)	(321)	(0,03)
					\$ (169)	\$ (1.237)	\$ (1.406)	(0,13)

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

⁽²⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definieren.

TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES

Kontrahent	Zahlung/Erhalt	Wertpapier	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Variabler Zinssatz	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
GST	Erhalt	iBoxx USD Liquid High Yield Index	k. A.	1,058 %	\$ 100	20.06.2023	\$ (1)	\$ (1)	\$ (2)	0,00

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	01.2023	¥ 120.000	\$ 877	\$ 0	\$ (35)	\$ (35)	0,00
BOA	01.2023	15.000	109	0	(4)	(4)	0,00
	01.2023	\$ 177	KRW 231.056	7	0	7	0,00
	01.2023	ZAR 4.838	\$ 273	0	(12)	(12)	0,00
	02.2023	CHF 4.534	4.787	0	(136)	(136)	(0,01)
	02.2023	€ 2.330	2.461	0	(33)	(33)	0,00
	02.2023	£ 62.535	73.790	0	(1.517)	(1.517)	(0,14)
	02.2023	¥ 2.220.000	15.851	0	(1.080)	(1.080)	(0,10)
	02.2023	\$ 1.260	AUD 1.831	0	(16)	(16)	0,00
	02.2023	1.303	€ 1.219	2	0	2	0,00
	02.2023	1.112	¥ 145.500	0	(3)	(3)	0,00
	02.2023	1.011	NOK 10.030	9	0	9	0,00
	02.2023	ZAR 9.436	\$ 526	0	(26)	(26)	0,00
	03.2023	TWD 26.087	886	31	0	31	0,00
	03.2023	\$ 2.448	IDR 38.188.800	21	0	21	0,00
	03.2023	ZAR 14.262	\$ 808	0	(26)	(26)	0,00
BPS	01.2023	BRL 763	145	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 5.188	KRW 6.764.253	189	0	189	0,02
	02.2023	€ 64.628	\$ 67.015	0	(2.158)	(2.158)	(0,20)
	02.2023	\$ 269	IDR 4.234.173	5	0	5	0,00
	03.2023	TWD 1.278	\$ 42	1	0	1	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Low Duration Income Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	03.2023	\$ 31	CLP 27.019	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	03.2023	9.009	MXN 181.576	180	0	180	0,02
BRC	01.2023	CNH 590	\$ 85	0	(1)	(1)	0,00
	01.2023	SGD 37	27	0	0	0	0,00
	02.2023	CHF 2.330	2.484	0	(46)	(46)	0,00
	03.2023	¥ 691.000	5.145	0	(145)	(145)	(0,01)
	03.2023	\$ 878	IDR 13.729.598	10	0	10	0,00
CBK	01.2023	CLP 1.383.618	\$ 1.555	0	(67)	(67)	(0,01)
	01.2023	PEN 64	17	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 8.895	BRL 46.687	0	(53)	(53)	(0,01)
	01.2023	1.452	CLP 1.383.152	171	0	171	0,02
	01.2023	498	PEN 1.999	25	0	25	0,00
	02.2023	CAD 5.781	\$ 4.232	0	(36)	(36)	0,00
	02.2023	\$ 1.435	AUD 2.143	21	0	21	0,00
	02.2023	1.555	CLP 1.391.239	69	0	69	0,01
	02.2023	637	€ 597	2	0	2	0,00
	02.2023	2.202	NZD 3.441	0	(25)	(25)	0,00
	03.2023	177	CLP 153.388	1	0	1	0,00
	03.2023	89	PEN 357	4	0	4	0,00
	04.2023	PEN 9	\$ 2	0	0	0	0,00
	04.2023	\$ 1.039	PEN 4.154	42	0	42	0,00
DUB	01.2023	¥ 960.000	\$ 6.818	0	(464)	(464)	(0,04)
	02.2023	ZAR 5.036	302	7	0	7	0,00
GLM	01.2023	BRL 45.924	8.617	0	(81)	(81)	(0,01)
	01.2023	CNH 612	88	0	(1)	(1)	0,00
	01.2023	\$ 278	ZAR 4.838	6	0	6	0,00
	01.2023	ZAR 9.640	\$ 539	0	(27)	(27)	0,00
	03.2023	MXN 66.851	3.252	0	(131)	(131)	(0,01)
	04.2023	\$ 8.466	BRL 45.924	83	0	83	0,01
	05.2023	PEN 7.303	\$ 1.835	0	(59)	(59)	(0,01)
	05.2023	\$ 194	PEN 785	10	0	10	0,00
	05.2023	ZAR 8.851	\$ 530	15	0	15	0,00
MBC	01.2023	SGD 148	109	0	(1)	(1)	0,00
	02.2023	\$ 4.361	CAD 5.779	0	(94)	(94)	(0,01)
	03.2023	¥ 511.256	\$ 3.746	0	(157)	(157)	(0,02)
	03.2023	TWD 18.539	630	22	0	22	0,00
	03.2023	\$ 532	IDR 8.327.824	6	0	6	0,00
	05.2023	CNH 377	\$ 56	1	0	1	0,00
MYI	01.2023	€ 944	1.006	0	(1)	(1)	0,00
	01.2023	SGD 551	409	0	(2)	(2)	0,00
	01.2023	\$ 247	£ 205	0	(1)	(1)	0,00
	01.2023	22	SGD 30	0	0	0	0,00
	01.2023	315	ZAR 5.488	7	0	7	0,00
	01.2023	ZAR 40.782	\$ 2.274	0	(120)	(120)	(0,01)
	02.2023	€ 1.501	1.575	0	(32)	(32)	0,00
	02.2023	TWD 110.326	3.619	15	0	15	0,00
	02.2023	\$ 6.816	AUD 10.051	12	0	12	0,00
	02.2023	ZAR 40.859	\$ 2.274	0	(119)	(119)	(0,01)
	03.2023	TWD 16.904	574	20	0	20	0,00
	03.2023	\$ 748	IDR 11.733.754	10	0	10	0,00
	02.2023	1.849	£ 1.491	0	(53)	(53)	(0,01)
RBC	02.2023	1.533	NOK 15.294	22	0	22	0,00
	03.2023	1	MXN 22	0	0	0	0,00
	04.2023	MXN 5.206	\$ 251	0	(11)	(11)	0,00
SCX	01.2023	\$ 243	PEN 935	2	0	2	0,00
	02.2023	£ 16.792	\$ 20.097	0	(125)	(125)	(0,01)
	02.2023	\$ 179	IDR 2.822.556	3	0	3	0,00
	02.2023	10.336	¥ 1.436.139	609	0	609	0,06
	03.2023	90	PEN 348	0	0	0	0,00
	04.2023	ZAR 11.298	\$ 614	0	(44)	(44)	0,00
SSB	03.2023	\$ 884	CLP 774.030	16	0	16	0,00
UAG	01.2023	372	ZAR 6.477	8	0	8	0,00
	02.2023	629	€ 589	1	0	1	0,00
	02.2023	765	IDR 12.135.693	20	0	20	0,00
	03.2023	¥ 2.613.000	\$ 19.240	0	(729)	(729)	(0,07)
	03.2023	ZAR 6.192	346	0	(15)	(15)	0,00
	09.2023	15.714	896	0	(9)	(9)	0,00
				\$ 1.685	\$ (7.695)	\$ (6.010)	(0,55)

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional CHF (Hedged) ausschüttend, E CHF (Hedged) thesaurierend und E CHF (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2023	\$ 207	CHF 196	\$ 5	\$ 0	\$ 5	0,00
CBK	01.2023	355	335	8	0	8	0,00
MBC	01.2023	CHF 213	\$ 230	0	(1)	(1)	0,00
MYI	01.2023	322	345	0	(3)	(3)	0,00
RBC	01.2023	\$ 4	CHF 4	0	0	0	0,00
				\$ 13	\$ (4)	\$ 9	0,00

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, E EUR (Hedged) thesaurierend, E EUR (Hedged) ausschüttend und Z EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2023	\$ 338	€ 321	\$ 4	\$ 0	\$ 4	0,00
BPS	01.2023	1.139	1.067	1	0	1	0,00
CBK	01.2023	€ 119	\$ 127	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 222.202	€ 214.305	6.612	0	6.612	0,61
MBC	01.2023	€315	\$ 335	0	(1)	(1)	0,00
	01.2023	\$ 238.618	€ 227.653	4.448	0	4.448	0,41
SCX	01.2023	229.355	220.354	5.918	0	5.918	0,55
				\$ 16.983	\$ (1)	\$ 16.982	1,57

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend und Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2023	£ 2.264	\$ 2.759	\$ 36	\$ 0	\$ 36	0,00
	01.2023	\$ 22.171	£ 18.421	0	(9)	(9)	0,00
BRC	01.2023	£ 205	\$ 247	0	0	0	0,00
MBC	01.2023	\$ 22.724	£ 18.962	97	(8)	89	0,01
MYI	01.2023	447	364	0	(9)	(9)	0,00
UAG	01.2023	21.640	18.012	31	0	31	0,00
				\$ 164	\$ (26)	\$ 138	0,01

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilsklasse Institutional SGD (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	01.2023	\$ 9	SGD 13	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
BPS	01.2023	2.823	3.873	65	0	65	0,01
BRC	01.2023	586	792	4	0	4	0,00
GLM	01.2023	SGD 38	\$ 28	0	(1)	(1)	0,00
	01.2023	\$ 1.192	SGD 1.617	14	0	14	0,00
MBC	01.2023	SGD 104	\$ 76	0	(1)	(1)	0,00
	01.2023	\$ 3.241	SGD 4.426	60	0	60	0,01
MEI	01.2023	SGD 20	\$ 15	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 2.763	SGD 3.794	66	0	66	0,01
RBC	01.2023	389	526	3	0	3	0,00
SCX	01.2023	14	19	0	0	0	0,00
UAG	01.2023	SGD 444	\$ 328	0	(3)	(3)	0,01
	01.2023	\$ 975	SGD 1.320	9	0	9	0,00
				\$ 221	\$ (5)	\$ 216	0,02

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ 7.139 0,66

LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PARI (000\$)	MARKT- WERT (000\$)	% DES NETTO- VERMÖGENS
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN			
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA			
3,500 % fällig am 01.01.2053	\$ 1.500	(1.363)	(0,13)
4,000 % fällig am 01.01.2053 (j)	4.100	(3.846)	(0,35)
Summe Leerverkaufte Wertpapiere		\$ (5.209)	(0,48)
Summe Anlagen		\$ 1.428.647	131,75
Sonstige Aktiva und Passiva		\$ (344.267)	(31,75)
Nettovermögen		\$ 1.084.380	100,00

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

- * Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt
- µ Bei diesem Betrag handelt es sich ganz oder teilweise um ungedeckte Darlehenszusagen. Der Zinssatz für den ungedeckten Teil wird zum Zeitpunkt der Finanzierung festgelegt. Weitere Informationen zu ungedeckten Darlehenszusagen finden Sie in Erläuterung 4, „Wertpapiere und sonstige Anlagen“, in den Erläuterungen zum Abschluss.
- ^ Das Wertpapier ist in Verzug.
- (a) Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.
- (b) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.
- (c) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.
- (d) Nullkuponwertpapier.
- (e) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.
- (f) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Low Duration Income Fund (Forts.)

- (g) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.
- (h) Mit dem Fonds verbunden.
- (i) Bedingt wandelbares Wertpapier.
- (j) Zum 31. Dezember 2022 leerverkaufte Wertpapiere sind durch langfristige Portfolioanlagen in übertragbaren Wertpapieren und Geldmarktinstrumenten abgedeckt.
- (k) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2021: 0,10 %):

Emittentenbeschreibung	Kauf-datum	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
ADLER Group S.A. 12,500 % fällig am 31.07.2025	22.12.2022	\$ 6.386	\$ 6.386	0,59
Intelsat Emergence S.A.	05.09.2018 - 23.02.2022	3.227	1.092	0,10
Neiman Marcus Group Ltd. LLC	25.09.2020	166	906	0,08
Westmoreland Mining Holdings LLC	26.03.2019	1	2	0,00
		\$ 9.780	\$ 8.386	0,77

Barmittel in Höhe von 24.006 USD (31. Dezember 2021: 28.338 USD) wurden zum 31. Dezember 2022 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von 0 USD (31. Dezember 2021: 1.120 USD) und Barmittel in Höhe von 9.984 USD (31. Dezember 2021: 0 USD) wurden gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. zum 31. Dezember 2022 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 1.018	\$ 1.197.881	\$ 14.709	\$ 1.213.608
Investmentfonds	106.140	0	0	106.140
Pensionsgeschäfte	0	98.831	0	98.831
Finanzderivate ⁽³⁾	579	14.698	0	15.277
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(5.209)	0	(5.209)
Summen	\$ 107.737	\$ 1.306.201	\$ 14.709	\$ 1.428.647

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

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 2.079	\$ 1.433.257	\$ 11.636	\$ 1.446.972
Investmentfonds	132.416	0	0	132.416
Pensionsgeschäfte	0	7.961	0	7.961
Finanzderivate ⁽³⁾	(23)	11.048	0	11.025
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(213)	0	(213)
Summen	\$ 134.472	\$ 1.452.053	\$ 11.636	\$ 1.598.161

⁽¹⁾ Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

⁽²⁾ Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

⁽³⁾ Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung des Marktwerts der außerbörslich gehandelten Finanzderivate und (erhaltenen)/verpfändeten Sicherheiten nach Kontrahenten zum 31. Dezember 2022 und 31. Dezember 2021:

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2022			Zum 31. Dez. 2021		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾
AZD	\$ (35)	\$ 0	\$ (35)	\$ 7	\$ 0	\$ 7
BOA	(2.834)	2.820	(14)	273	(230)	43
BPS	(1.952)	1.730	(222)	1.650	(1.330)	320
BRC	(307)	301	(6)	2.183	(1.290)	893
CBK	6.696	(6.666)	30	(41)	(270)	(311)
DJB	(582)	370	(212)	(22)	0	(22)
GLM	(2.097)	2.036	(61)	(1.128)	1.103	(25)
GST	(885)	904	19	245	0	245
HUS	1	0	1	864	(1.130)	(266)
MBC	4.371	(3.930)	441	k. A.	k. A.	k. A.
MEI	(56)	260	204	175	0	175
MYC	(562)	813	251	546	(670)	(124)
MYI	(223)	270	47	(18)	17	(1)
RBC	(39)	0	(39)	2.521	(2.020)	501
SAL	(49)	0	(49)	(57)	0	(57)
SCX	6.363	(5.950)	413	3.931	(3.290)	641
SSB	16	0	16	20	0	20
UAG	(687)	480	(207)	205	(320)	(115)

⁽¹⁾ Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2022:

	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	35,07	40,62
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	75,51	59,78
Sonstige übertragbare Wertpapiere	1,33	5,43
Investmentfonds	9,79	9,68
Pensionsgeschäfte	9,11	0,58
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,19	(0,04)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,57	0,01
Freiverkehrsfinanzderivate	0,66	0,83
Leerverkaufte Wertpapiere	(0,48)	(0,02)

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2022 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
Kreditbeteiligungen und -abtretungen	6,41	7,43
Unternehmensanleihen und Wechsel	26,11	35,19
Wandelanleihen und Wechsel	0,05	0,04
US-Regierungsbehörden	33,41	18,26
US-Schatzobligationen	9,02	3,63
Non-Agency-MBS	19,47	11,58
Förderungsbesicherte Wertpapiere	8,93	5,94
Staatsemissionen	3,00	3,14
Stammaktien	0,29	0,26
Bezugsrechte	0,01	k. A.
Optionsscheine	0,00	0,00
Real Estate Investment Trusts	0,00	0,00
Kurzfristige Instrumente	5,21	20,36
Investmentfonds	9,79	9,68
Pensionsgeschäfte	9,11	0,58
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,20	(0,04)
Verkaufsoptionen		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	(0,01)	k. A.
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf	0,00	0,04
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,00	0,01
Zinsswaps	0,57	(0,04)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Zinsswapoptionen	0,19	0,00
Optionen auf Wertpapiere	k. A.	0,01
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaptions auf Kreditindizes	0,00	0,00
Devisenoptionen	k. A.	0,00
Zinsswapoptionen	(0,32)	(0,08)
Zinsscaps	(0,08)	k. A.
Optionen auf Wertpapiere	(0,01)	(0,02)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf	(0,04)	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	(0,13)	0,06
Zinsswaps	k. A.	0,01
Total Return Swaps auf Indizes	0,00	0,00
Devisenterminkontrakte	(0,55)	0,04
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	1,60	0,81
Leerverkaufte Wertpapiere	(0,48)	(0,02)
Sonstige Aktiva und Passiva	(31,75)	(16,87)
Nettovermögen	100,00	100,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Low Duration Opportunities Fund

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE				ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE				ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE			
KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNGEN				KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNGEN				KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNGEN			
American Airlines, Inc. 8,993 % fällig am 20.04.2028	\$ 1.100	\$ 1.097	0,08	4,375 % fällig am 12.01.2026	\$ 1.700	\$ 1.647	0,12	ING Groep NV 1,726 % fällig am 01.04.2027	\$ 3.000	\$ 2.651	0,20
CenturyLink, Inc. 6,634 % fällig am 15.03.2027	4.395	4.182	0,31	4,972 % fällig am 16.05.2029	800	753	0,06	4,100 % fällig am 02.10.2023	1.000	992	0,07
CommScope, Inc. 7,634 % fällig am 06.04.2026	1.955	1.848	0,14	5,746 % fällig am 09.08.2033	100	95	0,01	Intesa Sanpaolo SpA 7,750 % fällig am 11.01.2027 (f)(h)	€ 2.200	2.271	0,17
Cornerstone Building Brands, Inc. 7,568 % fällig am 12.04.2028	1.338	1.207	0,09	7,125 % fällig am 15.06.2025 (f)(h)	€ 1.800	2.052	0,15	JPMorgan Chase & Co. 1,963 % fällig am 23.03.2030	1.000	933	0,07
CSC Holdings LLC 6,818 % fällig am 15.04.2027	288	258	0,02	7,250 % fällig am 15.03.2023 (f)(h)	2.200	2.623	0,19	Kennedy Wilson Europe Real Estate Ltd. 3,250 % fällig am 12.11.2025	2.900	2.434	0,18
Hilton Domestic Operating Co., Inc. 6,173 % fällig am 22.06.2026	1.046	1.044	0,08	8,000 % fällig am 15.06.2024 (f)(h)	\$ 200	195	0,01	Lazard Group LLC 4,500 % fällig am 19.09.2028	\$ 4.000	3.719	0,28
IRB Holding Corp. 7,134 % fällig am 05.02.2025	3.019	2.997	0,22	BNP Paribas S.A. 1,875 % fällig am 14.12.2027	€ 1.900	1.918	0,14	LeasePlan Corp. NV 2,875 % fällig am 24.10.2024	1.200	1.127	0,08
7,317 % fällig am 15.12.2027	4.864	4.728	0,35	1,904 % fällig am 30.09.2028	\$ 3.400	2.837	0,21	Legal & General Group PLC 5,625 % fällig am 24.03.2031 (f)(h)	€ 600	623	0,05
Kronos Acquisition Holdings, Inc. 8,485 % fällig am 22.12.2026	2.548	2.431	0,18	BPCE S.A. 1,500 % fällig am 13.01.2042 (h)	€ 1.800	1.612	0,12	Lloyds Banking Group PLC 2,250 % fällig am 16.10.2024	900	1.029	0,08
MPH Acquisition Holdings LLC 8,985 % fällig am 01.09.2028	3.851	3.307	0,25	Brookfield Finance, Inc. 4,000 % fällig am 01.04.2024	\$ 50	49	0,00	3,750 % fällig am 11.01.2027	\$ 2.500	2.329	0,17
RegionalCare Hospital Partners Holdings, Inc. 8,165 % fällig am 16.11.2025	1.215	1.148	0,08	CapitaLand Ascendas REIT 0,750 % fällig am 23.06.2028	€ 1.100	920	0,07	3,750 % fällig am 18.03.2028	1.000	925	0,07
SkyMiles IP Ltd. 7,993 % fällig am 20.10.2027	1.000	1.021	0,08	CBRE Global Investors Open-Ended Fund S.C.A. SICAV-SIF Pan European Core Fund 0,500 % fällig am 27.01.2029	1.600	1.323	0,10	4,375 % fällig am 22.03.2028	400	380	0,03
U.S. Foods, Inc. 7,134 % fällig am 22.11.2028	2.637	2.629	0,19	0,900 % fällig am 12.10.2028	1.600	1.248	0,09	4,716 % fällig am 11.08.2026	3.000	2.938	0,22
United Airlines, Inc. 8,108 % fällig am 21.04.2028	2.164	2.143	0,16	Cooperative Rabobank UA 3,100 % fällig am 29.06.2028 (f)(h)	3.800	3.146	0,23	Logicor Financing SARL 0,625 % fällig am 17.11.2025	€ 1.800	1.645	0,12
Zayo Group Holdings, Inc. 7,384 % fällig am 09.03.2027	5.627	4.583	0,34	CPI Property Group S.A. 1,750 % fällig am 14.01.2030	3.000	1.954	0,15	1,500 % fällig am 13.07.2026	1.000	904	0,07
				2,750 % fällig am 22.01.2028	€ 700	564	0,04	3,250 % fällig am 13.11.2028	700	630	0,05
		34.623	2,57	Credit Suisse AG 0,250 % fällig am 01.09.2028	€ 3.000	2.322	0,17	Midcap Financial Issuer Trust 5,625 % fällig am 15.01.2030	\$ 200	162	0,01
				6,500 % fällig am 08.08.2023 (h)	\$ 4.100	3.980	0,30	Mitsubishi HC Capital, Inc. 3,960 % fällig am 19.09.2023	1.600	1.582	0,12
				Credit Suisse Group AG 1,000 % fällig am 24.06.2027	€ 500	421	0,03	Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc. 0,339 % fällig am 19.07.2024	€ 1.600	1.631	0,12
				2,125 % fällig am 12.09.2025	€ 200	214	0,02	Mizuho Financial Group, Inc. 3,477 % fällig am 12.04.2026	\$ 3.050	2.864	0,21
				2,125 % fällig am 15.11.2029	2.400	2.055	0,15	MPT Operating Partnership LP 3,375 % fällig am 24.04.2030	€ 1.500	1.183	0,09
				3,091 % fällig am 14.05.2032	\$ 3.500	2.425	0,18	Nationwide Building Society 1,000 % fällig am 24.01.2023	300	360	0,03
				3,750 % fällig am 26.03.2025	150	135	0,01	3,766 % fällig am 08.03.2024	\$ 1.100	1.094	0,08
				4,194 % fällig am 01.04.2031	800	623	0,05	NatWest Group PLC 2,000 % fällig am 04.03.2025	€ 2.300	2.395	0,18
				4,550 % fällig am 17.04.2026	1.000	883	0,07	4,519 % fällig am 25.06.2024	\$ 200	198	0,01
				5,250 % fällig am 11.02.2027 (f)(h)	3.100	2.025	0,15	4,800 % fällig am 05.04.2026	700	685	0,05
				6,250 % fällig am 18.12.2024 (f)(h)	200	158	0,01	4,892 % fällig am 18.05.2029	700	664	0,05
				6,375 % fällig am 21.08.2026 (f)(h)	2.600	1.870	0,14	6,274 % fällig am 25.06.2024	400	400	0,03
				7,250 % fällig am 12.09.2025 (f)(h)	1.600	1.150	0,09	8,000 % fällig am 10.08.2025 (f)(h)	300	296	0,02
				7,500 % fällig am 17.07.2023 (f)(h)	400	321	0,02	NE Property BV 1,875 % fällig am 09.10.2026	€ 1.500	1.349	0,10
				Cromwell Ereit Lux Finco SARL 2,125 % fällig am 19.11.2025	€ 2.000	1.726	0,13	2,000 % fällig am 20.01.2030	3.100	2.297	0,17
				CTP NV 0,625 % fällig am 27.09.2026	2.700	2.221	0,16	Nissan Motor Acceptance Co. LLC 2,450 % fällig am 15.09.2028	\$ 800	623	0,05
				1,500 % fällig am 27.09.2031	2.500	1.604	0,12	Nova Kreditna Banka Maribor d.d. 1,875 % fällig am 27.01.2025	€ 2.200	2.130	0,16
				Deutsche Bank AG 0,750 % fällig am 17.02.2027	800	746	0,06	Nova Ljubljanska Banka d.d. 3,400 % fällig am 05.02.2030	2.400	2.126	0,16
				1,625 % fällig am 20.01.2027	2.000	1.885	0,14	3,650 % fällig am 19.11.2029	1.400	1.255	0,09
				2,625 % fällig am 16.12.2024	€ 3.000	3.356	0,25	OneMain Finance Corp. 6,125 % fällig am 15.03.2024	\$ 2.150	2.084	0,15
				3,729 % fällig am 14.01.2032 (i)	\$ 2.200	1.617	0,12	Peugeot Invest 1,875 % fällig am 30.10.2026	€ 3.800	3.334	0,25
				DVI Deutsche Vermoögens- & Immobilienverwaltungs GmbH 2,500 % fällig am 25.01.2027	€ 2.100	1.680	0,12	Piper Sandler Cos. 5,200 % fällig am 15.10.2023	\$ 1.600	1.586	0,12
				Fairfax Financial Holdings Ltd. 4,625 % fällig am 29.04.2030	\$ 700	637	0,05	Protective Life Global Funding 3,104 % fällig am 15.04.2024	5.000	4.861	0,36
				Ford Motor Credit Co. LLC 1,744 % fällig am 19.07.2024	€ 2.900	2.963	0,22	Rexford Industrial Realty LP 2,150 % fällig am 01.09.2031	21	16	0,00
				2,900 % fällig am 16.02.2028	€ 900	744	0,06	Sagax AB 1,125 % fällig am 30.01.2027	€ 1.700	1.470	0,11
				3,021 % fällig am 06.03.2024	€ 100	105	0,01	2,250 % fällig am 13.03.2025	2.900	2.860	0,21
				3,250 % fällig am 15.09.2025	200	203	0,01	Sagax Euro MTN NL BV 0,750 % fällig am 26.01.2028	600	482	0,04
				3,375 % fällig am 13.11.2025	\$ 600	543	0,04	1,000 % fällig am 17.05.2029	1.000	751	0,06
				Goldman Sachs Group, Inc. 0,673 % fällig am 08.03.2024	1.500	1.484	0,11	Santander Holdings USA, Inc. 3,244 % fällig am 05.10.2026	\$ 100	93	0,01
				3,000 % fällig am 15.03.2024	3.500	3.415	0,25	Santander UK Group Holdings PLC 3,625 % fällig am 14.01.2026	€ 300	336	0,02
				3,691 % fällig am 05.06.2028	100	93	0,01	3,823 % fällig am 03.11.2028	\$ 300	269	0,02
				Hamburg Commercial Bank AG 0,500 % fällig am 22.09.2026	€ 2.500	2.270	0,17	4,796 % fällig am 15.11.2024	4.000	3.934	0,29
				HSBC Holdings PLC 2,999 % fällig am 10.03.2026	\$ 3.600	3.387	0,25				
				3,900 % fällig am 25.05.2026	900	858	0,06				
				4,300 % fällig am 08.03.2026	400	387	0,03				
				5,750 % fällig am 20.12.2027	€ 100	119	0,01				
				6,000 % fällig am 29.03.2040	200	220	0,02				
				Huarong Finance Co. Ltd. 3,375 % fällig am 24.02.2030	\$ 800	611	0,05				
				3,625 % fällig am 30.09.2030	1.500	1.151	0,09				
				4,250 % fällig am 07.11.2027	200	171	0,01				
				4,500 % fällig am 29.05.2029	1.400	1.163	0,09				
				4,750 % fällig am 27.04.2027	1.000	874	0,06				

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
Sirius Real Estate Ltd. 1,125 % fällig am 22.06.2026	€ 1.100	\$ 919	0,07	DAE Funding LLC 1,625 % fällig am 15.02.2024 3,375 % fällig am 20.03.2028	\$ 700 3.300	\$ 665 2.934	0,05 0,22	Tesco Corporate Treasury Services PLC 0,375 % fällig am 27.07.2029 0,875 % fällig am 29.05.2026	€ 900 2.000	\$ 745 1.936	0,06 0,14
Societe Generale S.A. 7,875 % fällig am 18.12.2023 (f)(h)	\$ 200	198	0,01	Delta Air Lines, Inc. 7,000 % fällig am 01.05.2025	800	818	0,06	U.S. Airways Pass-Through Trust 3,950 % fällig am 15.05.2027	\$ 178	162	0,01
Sofina S.A. 1,000 % fällig am 23.09.2028	€ 2.500	2.087	0,15	Discovery Communications LLC 2,500 % fällig am 20.09.2024	€ 100	114	0,01	Ubisoft Entertainment S.A. 0,878 % fällig am 24.11.2027	€ 1.000	828	0,06
Standard Chartered PLC 1,214 % fällig am 23.03.2025	\$ 1.500	1.416	0,11	Exela Intermediate LLC 11,500 % fällig am 15.07.2026	\$ 218	38	0,00	Unigel Luxembourg S.A. 8,750 % fällig am 01.10.2026	\$ 200	199	0,01
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd. 2,550 % fällig am 10.03.2025	2.400	2.264	0,17	Expedia Group, Inc. 2,950 % fällig am 15.03.2031 6,250 % fällig am 01.05.2025	540 527	435 532	0,03 0,04	United Airlines Pass-Through Trust 2,700 % fällig am 01.11.2033	1.061	859	0,06
Sun Communities Operating LP 4,200 % fällig am 15.04.2032	2.500	2.209	0,16	FactSet Research Systems, Inc. 3,450 % fällig am 01.03.2032	1.400	1.177	0,09	United Airlines, Inc. 4,375 % fällig am 15.04.2026 4,625 % fällig am 15.04.2029	800 400	743 349	0,05 0,03
TP ICAP Finance PLC 2,625 % fällig am 18.11.2028 5,250 % fällig am 26.01.2024 5,250 % fällig am 29.05.2026	€ 1.000 358 1.400	887 421 1.559	0,07 0,03 0,12	GE Capital UK Funding Unlimited Co. 5,875 % fällig am 18.01.2033	€ 300	367	0,03	Venture Global Calcasieu Pass LLC 3,875 % fällig am 01.11.2033	5.000	4.094	0,30
UBS AG 5,125 % fällig am 15.05.2024 (h)	\$ 100	99	0,01	Greene King Finance PLC 5,318 % fällig am 15.09.2031 5,322 % fällig am 15.12.2034	343 100	384 93	0,03 0,01	ViaSat, Inc. 5,625 % fällig am 15.09.2025	300	279	0,02
UniCredit SpA 7,500 % fällig am 03.06.2026 (f)(h) 7,830 % fällig am 04.12.2023	€ 1.800 \$ 500	1.873 505	0,14 0,04	Grifols Escrow Issuer S.A. 3,875 % fällig am 15.10.2028	€ 2.700	2.437	0,18	Virgin Media Secured Finance PLC 4,250 % fällig am 15.01.2030	€ 1.800	1.689	0,13
VICI Properties LP 4,375 % fällig am 15.05.2025	1.300	1.264	0,09	GSK Consumer Healthcare Capital U.S. LLC 3,375 % fällig am 24.03.2027	\$ 1.000	932	0,07	Vmed 02 UK Financing PLC 4,500 % fällig am 15.07.2031	700	647	0,05
Virgin Money UK PLC 4,000 % fällig am 25.09.2026	€ 300	335	0,02	GSK Consumer Healthcare Capital UK PLC 3,125 % fällig am 24.03.2025	2.000	1.904	0,14	Warnermedia Holdings, Inc. 3,528 % fällig am 15.03.2024	\$ 4.000	3.878	0,29
Volkswagen Financial Services NV 1,125 % fällig am 18.09.2023 1,625 % fällig am 10.02.2024 1,875 % fällig am 03.12.2024	3.100 1.100 2.000	3.639 1.268 2.248	0,27 0,09 0,17	Hyatt Hotels Corp. 1,800 % fällig am 01.10.2024	900	844	0,06	Wynn Macau Ltd. 5,500 % fällig am 01.10.2027 5,625 % fällig am 26.08.2028	200 1.100	175 942	0,01 0,07
		205.248	15,25	Informa PLC 1,250 % fällig am 22.04.2028 1,500 % fällig am 05.07.2023	€ 1.500 237	1.361 251	0,10 0,02	Wynn Resorts Finance LLC 7,750 % fällig am 15.04.2025	300	299	0,02
				InterContinental Hotels Group PLC 2,125 % fällig am 24.08.2026 2,125 % fällig am 15.05.2027	€ 200 € 700	209 689	0,02 0,05		90.607	6,73	
INDUSTRIEWERTE				John Lewis PLC 4,250 % fällig am 18.12.2034 6,125 % fällig am 15.01.2025	€ 1.300 350	952 405	0,07 0,03	VERSORGUNGSUNTERNEHMEN			
Aeroporto di Roma SpA 1,750 % fällig am 30.07.2031 5,441 % fällig am 20.02.2023	€ 600 € 800	478 961	0,04 0,07	Melco Resorts Finance Ltd. 5,750 % fällig am 21.07.2028	\$ 200	168	0,01	AES Corp. 2,450 % fällig am 15.01.2031	3.000	2.394	0,18
Air Canada 3,875 % fällig am 15.08.2026	\$ 1.200	1.065	0,08	MGM China Holdings Ltd. 5,250 % fällig am 18.06.2025 5,875 % fällig am 15.05.2026	200 200	188 187	0,01 0,01	British Telecommunications PLC 4,500 % fällig am 04.12.2023	200	198	0,01
Alaska Airlines Pass-Through Trust 4,800 % fällig am 15.02.2029	1.771	1.689	0,13	Mileage Plus Holdings LLC 6,500 % fällig am 20.06.2027	104	103	0,01	Electricite de France S.A. 3,000 % fällig am 03.09.2027 (f)	€ 800	701	0,05
Altice France S.A. 4,250 % fällig am 15.10.2029 5,500 % fällig am 15.10.2029	€ 2.000 \$ 2.100	1.609 1.605	0,12 0,12	Mitchells & Butlers Finance PLC 5,219 % fällig am 15.12.2030 6,013 % fällig am 15.12.2030 6,469 % fällig am 15.09.2032	126 € 1.440 400	117 1.619 439	0,01 0,12 0,03	Georgia Power Co. 2,100 % fällig am 30.07.2023	\$ 3.080	3.027	0,23
AMC Networks, Inc. 4,750 % fällig am 01.08.2025	100	76	0,01	Nissan Motor Co. Ltd. 4,345 % fällig am 17.09.2027 4,810 % fällig am 17.09.2030	\$ 4.700 5.400	4.269 4.595	0,32 0,34	Pacific Gas & Electric Co. 1,700 % fällig am 15.11.2023 2,100 % fällig am 01.08.2027 3,150 % fällig am 01.01.2026 3,450 % fällig am 01.07.2025 3,500 % fällig am 15.06.2025 ^ 3,950 % fällig am 01.12.2047 ^ 4,000 % fällig am 01.12.2046 ^ 4,550 % fällig am 01.07.2030	400 1.900 1.300 200 600 200 300 3.500	387 1.626 1.209 189 567 136 202 3.181	0,03 0,12 0,09 0,01 0,04 0,02 0,01 0,24
American Airlines Pass-Through Trust 3,150 % fällig am 15.08.2033 3,250 % fällig am 15.04.2030 3,375 % fällig am 01.11.2028 3,650 % fällig am 15.08.2030 3,700 % fällig am 01.04.2028	605 18 1.064 734 230	502 14 889 655 199	0,04 0,00 0,07 0,05 0,01	Penske Truck Leasing Co. LP 3,950 % fällig am 10.03.2025	\$ 800	771	0,06	Rio Oil Finance Trust 8,200 % fällig am 06.04.2028 9,250 % fällig am 06.07.2024 9,750 % fällig am 06.01.2027	426 180 115	432 183 120	0,03 0,01 0,01
American Airlines, Inc. 5,500 % fällig am 20.04.2026	2.900	2.794	0,21	Prosus NV 1,207 % fällig am 19.01.2026 2,085 % fällig am 19.01.2030	€ 1.000 1.300	964 1.084	0,07 0,08	Southern California Edison Co. 2,750 % fällig am 01.02.2032	5.900	4.957	0,37
American Medical Systems Europe BV 1,375 % fällig am 08.03.2028	€ 2.000	1.888	0,14	RAC Bond Co. PLC 4,565 % fällig am 06.05.2046	€ 100	119	0,01	Sprint LLC 7,625 % fällig am 01.03.2026	800	844	0,06
Atlantia SpA 1,875 % fällig am 12.02.2028	3.900	3.470	0,26	Sabine Pass Liquefaction LLC 5,000 % fällig am 15.03.2027 5,750 % fällig am 15.05.2024 5,875 % fällig am 30.06.2026	\$ 500 200 1.000	491 200 1.013	0,04 0,01 0,08	Systems Energy Resources, Inc. 2,140 % fällig am 09.12.2025	700	641	0,05
Bellis Acquisition Co. PLC 3,250 % fällig am 16.02.2026	€ 5.200	5.113	0,38	Sands China Ltd. 2,800 % fällig am 08.03.2027	200	172	0,01	Summe Unternehmensanleihen und Wechsel		316.849	23,54
Boeing Co. 2,750 % fällig am 01.02.2026	\$ 2.100	1.948	0,14	Sasol Financing USA LLC 5,875 % fällig am 27.03.2024	5.200	5.100	0,38	KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL			
Boston Scientific Corp. 3,450 % fällig am 01.03.2024	525	515	0,04	Scripps Escrow, Inc. 3,875 % fällig am 15.01.2029	1.000	804	0,06	Golden State, California Tobacco Securitization Corp. Revenue Bonds, Series 2021 3,487 % fällig am 01.06.2036	1.300	1.039	0,08
British Airways Pass-Through Trust 3,300 % fällig am 15.06.2034 4,250 % fällig am 15.05.2034	89 322	76 289	0,01 0,02	Southern Co. 3,700 % fällig am 30.04.2030	800	724	0,05	Golden State, California Tobacco Securitization Corp. Revenue Notes, (ST APPROP Insured), Series 2021 3,000 % fällig am 01.06.2046	440	408	0,03
Broadcom, Inc. 3,469 % fällig am 15.04.2034	200	160	0,01	Spirit AeroSystems, Inc. 4,600 % fällig am 15.06.2028	1.100	890	0,07	Golden State, California Tobacco Securitization Corp. Revenue Notes, Series 2021 2,587 % fällig am 01.06.2029	4.000	3.353	0,25
Chanel Ceres PLC 0,500 % fällig am 31.07.2026 1,000 % fällig am 31.07.2031	€ 1.300 2.100	1.251 1.731	0,09 0,13	Studio City Finance Ltd. 5,000 % fällig am 15.01.2029 6,000 % fällig am 15.07.2025	1.400 200	1.036 174	0,08 0,01	Tobacco Settlement Finance Authority, West Virginia Revenue Bonds, Series 2007 0,000 % fällig am 01.06.2047 (c)	4.700	350	0,02
Cheniere Corpus Christi Holdings LLC 5,875 % fällig am 31.03.2025	\$ 20	20	0,00	Targa Resources Corp. 4,200 % fällig am 01.02.2033	800	691	0,05				
Constellation Oil Services Holding S.A. (3,000 % bar oder 4,000 % PIK) 3,000 % fällig am 31.12.2026 (a)	552	327	0,02								

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Low Duration Opportunities Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
Tobacco Settlement Finance Authority, West Virginia Revenue Bonds, Series 2020				6,000 % fällig am 25.11.2036 ^	\$	77	0,01	OBX Trust			
3,151 % fällig am 01.06.2032	\$ 200	\$ 160	0,01	6,000 % fällig am 25.07.2037	\$	433	0,02	5,039 % fällig am 25.06.2057	\$	154	\$ 146 0,01
3,401 % fällig am 01.06.2034	1.150	892	0,07	Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust				Paragon Mortgages PLC			
3,501 % fällig am 01.06.2035	1.700	1.301	0,10	5,750 % fällig am 25.12.2035 ^	12	6	0,00	4,290 % fällig am 15.05.2045	£	452	541 0,04
		7.503	0,56	5,750 % fällig am 25.02.2037 ^	504	249	0,02	Pepper Residential Securities Trust			
				5,750 % fällig am 25.08.2037	627	347	0,03	4,210 % fällig am 16.09.2059	AUD	289	195 0,02
				6,000 % fällig am 25.07.2036	271	154	0,01	Residential Accredited Loans, Inc. Trust			
				6,500 % fällig am 25.11.2036 ^	7	3	0,00	5,750 % fällig am 25.06.2036 ^	\$	22	17 0,00
				Credit Suisse Mortgage Capital Certificates				6,000 % fällig am 25.04.2036	1.001	772	0,06
				3,276 % fällig am 30.11.2037	7	7	0,00	6,000 % fällig am 25.06.2036 ^	148	117	0,01
				Domi BV				Residential Asset Securitization Trust			
				2,896 % fällig am 15.06.2051	€ 763	807	0,06	6,500 % fällig am 25.06.2037	2.896	730	0,05
				Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust				RESIMAC Bastille Trust			
				4,529 % fällig am 19.10.2036	\$ 406	325	0,02	5,022 % fällig am 05.12.2059	44	44	0,00
				Dutch Property Finance BV				Ribbon Finance PLC			
				2,228 % fällig am 28.07.2054	€ 355	375	0,03	3,826 % fällig am 20.04.2028	£	187	219 0,02
				EMF-UK PLC				RMAC PLC			
				4,491 % fällig am 13.03.2046	£ 43	51	0,00	4,206 % fällig am 12.06.2046	157	188	0,01
				Eurohome UK Mortgages PLC				4,476 % fällig am 12.06.2046	212	254	0,02
				3,946 % fällig am 15.06.2044	99	114	0,01	RMAC Securities PLC			
				European Loan Conduit DAC				3,656 % fällig am 12.06.2044	46	51	0,00
				2,803 % fällig am 17.02.2030	€ 3.520	3.594	0,27	Shamrock Residential DAC			
				Eurosail PLC				2,744 % fällig am 24.12.2059	€ 2.352	2.471	0,18
				4,461 % fällig am 13.06.2045	£ 263	311	0,02	2,744 % fällig am 24.01.2061	3.598	3.751	0,28
				Finsbury Square PLC				Silverstone Master Issuer PLC			
				4,209 % fällig am 16.03.2070	817	981	0,07	3,701 % fällig am 21.01.2070	£ 1.488	1.793	0,13
				4,419 % fällig am 16.12.2069	1.127	1.355	0,10	Stratton BTL Mortgage Funding PLC			
				Friary PLC				3,656 % fällig am 20.01.2054	10.174	11.942	0,89
				3,993 % fällig am 21.11.2067	507	610	0,05	Stratton Mortgage Funding PLC			
				Great Hall Mortgages PLC				3,826 % fällig am 20.07.2060	3.975	4.741	0,35
				3,685 % fällig am 18.06.2039	81	95	0,01	4,292 % fällig am 25.09.2051	9.061	10.761	0,80
				3,695 % fällig am 18.06.2038	42	49	0,00	Structured Asset Mortgage Investments Trust			
				GSMPs Mortgage Loan Trust				4,609 % fällig am 25.09.2047	\$ 709	574	0,04
				4,739 % fällig am 25.03.2035	\$ 95	90	0,01	Towd Point Mortgage Funding PLC			
				GSR Mortgage Loan Trust				3,826 % fällig am 20.07.2045	£ 1.411	1.679	0,13
				6,000 % fällig am 25.01.2037	1.229	840	0,06	4,071 % fällig am 20.10.2051	4.279	5.117	0,38
				HarborView Mortgage Loan Trust				4,190 % fällig am 20.02.2045	280	332	0,03
				4,048 % fällig am 19.10.2035	464	265	0,02	4,471 % fällig am 20.02.2054	939	1.126	0,08
				4,719 % fällig am 19.01.2038	38	34	0,00	Trinidad Mortgage Securities PLC			
				4,749 % fällig am 19.12.2036	4.025	3.319	0,25	3,900 % fällig am 24.01.2059	42	50	0,00
				Harmony French Home Loans				Twin Bridges PLC			
				2,558 % fällig am 27.05.2062	€ 6.709	7.177	0,53	4,237 % fällig am 12.03.2055	8.292	9.757	0,73
				IndyMac Mortgage Loan Trust				4,386 % fällig am 12.09.2050	172	207	0,02
				4,809 % fällig am 25.07.2036	\$ 1.909	1.679	0,13	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust			
				JPMorgan Alternative Loan Trust				3,290 % fällig am 25.02.2037 ^	\$ 74	67	0,01
				4,749 % fällig am 25.06.2037	4.175	2.307	0,17	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust			
				Jubilee Place BV				4,989 % fällig am 25.07.2036 ^	102	56	0,00
				2,378 % fällig am 17.10.2057	€ 1.725	1.827	0,14	Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust			
				Landmark Mortgage Securities PLC				3,615 % fällig am 25.07.2034	10	10	0,00
				3,668 % fällig am 17.04.2044	£ 163	184	0,01			104.833	7,79
				Lehman XS Trust							
				4,789 % fällig am 25.08.2046	\$ 193	172	0,01				
				4,839 % fällig am 25.08.2046	371	348	0,03				
				Ludgate Funding PLC							
				2,164 % fällig am 01.12.2060	€ 21	21	0,00				
				3,869 % fällig am 01.12.2060	£ 146	165	0,01				
				Mansard Mortgages PLC							
				3,185 % fällig am 15.04.2047	41	47	0,00				
				4,172 % fällig am 15.12.2049	149	172	0,01				
				MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust							
				6,639 % fällig am 25.11.2034	\$ 863	832	0,06				
				Morgan Stanley Mortgage Loan Trust							
				3,188 % fällig am 25.12.2037	1.089	726	0,05				
				6,354 % fällig am 25.08.2036 ^	10.669	2.172	0,16				
				Mortgage Equity Conversion Asset Trust							
				5,140 % fällig am 25.05.2042	433	378	0,03				
				NAAC Reperforming Loan REMIC Trust Certificates							
				6,500 % fällig am 25.02.2035 ^	523	462	0,04				
				New Century Alternative Mortgage Loan Trust							
				4,640 % fällig am 25.10.2036	506	107	0,01				
				Newgate Funding PLC							
				2,646 % fällig am 15.12.2050	€ 82	82	0,01				
				3,956 % fällig am 15.12.2050	£ 231	260	0,02				
				NovaStar Mortgage Funding Trust							
				0,412 % fällig am 25.09.2046	\$ 2.161	756	0,06				

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
Atlas Senior Loan Fund Ltd. 5,169 % fällig am 15.01.2031	\$ 3.045	\$ 2.987	0,22	Elevation CLO Ltd. 5,355 % fällig am 15.10.2029	\$ 1.681	\$ 1.670	0,12	4,529 % fällig am 25.03.2037	\$ 770	\$ 689	0,05
Aurium CLO DAC 2,108 % fällig am 16.01.2031	€ 4.698	4.904	0,37	Ellington Loan Acquisition Trust 5,489 % fällig am 25.05.2037	3.437	3.303	0,25	4,609 % fällig am 25.04.2037	601	439	0,03
Bain Capital Euro CLO DAC 2,602 % fällig am 24.01.2033	2.000	2.086	0,16	Euro-Galaxy CLO DAC 1,958 % fällig am 11.04.2031	€ 1.200	1.250	0,09	4,609 % fällig am 25.05.2037	664	405	0,03
Barings CLO Ltd. 5,043 % fällig am 20.01.2028	\$ 1.478	1.472	0,11	Fieldstone Mortgage Investment Trust 4,696 % fällig am 25.04.2047	\$ 2.077	1.470	0,11	OZLM Ltd. 5,099 % fällig am 15.04.2031	2.400	2.340	0,17
Bayview Financial Acquisition Trust 6,596 % fällig am 28.12.2036	440	444	0,03	Fremont Home Loan Trust 4,524 % fällig am 25.10.2036	154	136	0,01	5,159 % fällig am 17.04.2031	985	963	0,07
BBVA Consumer Auto 0,270 % fällig am 20.07.2031	€ 781	815	0,06	4,589 % fällig am 25.08.2036	215	75	0,01	5,393 % fällig am 20.01.2031	1.800	1.771	0,13
Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust 4,619 % fällig am 25.02.2037	\$ 3.000	2.744	0,20	5,259 % fällig am 25.05.2034	1.419	1.308	0,10	OZLME DAC 2,397 % fällig am 27.07.2032	€ 2.200	2.296	0,17
5,019 % fällig am 25.02.2036	1.233	1.230	0,09	GE-WMC Mortgage Securities Trust 4,689 % fällig am 25.08.2036	5.218	2.345	0,17	Palmer Square European Loan Funding DAC 3,993 % fällig am 12.04.2032	5.000	5.306	0,39
5,034 % fällig am 25.12.2035	54	54	0,00	Greenwood Park CLO Ltd. 5,109 % fällig am 15.04.2031	1.250	1.232	0,09	Popular ABS Mortgage Pass-Through Trust 4,884 % fällig am 25.07.2036	\$ 685	639	0,05
5,244 % fällig am 25.07.2034	1.409	1.348	0,10	Greystone Commercial Real Estate Notes Ltd. 5,498 % fällig am 15.09.2037	3.485	3.432	0,26	RAAC Trust 5,149 % fällig am 25.10.2046	101	96	0,01
5,409 % fällig am 25.10.2035	371	358	0,03	GSA Home Equity Trust 5,772 % fällig am 25.11.2036 ^	476	146	0,01	Residential Asset Securities Corp. Trust 4,729 % fällig am 25.11.2036	47	44	0,00
5,439 % fällig am 25.08.2037	842	754	0,06	5,985 % fällig am 25.06.2036	1.363	364	0,03	4,974 % fällig am 25.08.2036	1.129	1.110	0,08
Black Diamond CLO DAC 2,778 % fällig am 15.05.2032	€ 4.600	4.760	0,35	GSAMP Trust 4,529 % fällig am 25.11.2036	1.949	940	0,07	Sculptor European CLO DAC 2,153 % fällig am 14.01.2032	€ 5.000	5.193	0,39
2,834 % fällig am 03.10.2029	60	64	0,01	4,909 % fällig am 25.02.2046	558	510	0,04	Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust 4,709 % fällig am 25.10.2036	\$ 9.878	3.519	0,26
Blackrock European CLO DAC 1,998 % fällig am 15.10.2031	5.400	5.588	0,42	HSI Asset Securitization Corp. Trust 5,169 % fällig am 25.01.2036	2.200	1.892	0,14	5,049 % fällig am 25.08.2035 ^	57	44	0,00
Cairn CLO DAC 2,275 % fällig am 31.01.2030	614	642	0,05	ICG U.S. CLO Ltd. 5,405 % fällig am 22.07.2031	5.200	5.089	0,38	Segovia European CLO DAC 2,336 % fällig am 20.07.2032	€ 6.900	7.130	0,53
2,333 % fällig am 25.07.2029	86	91	0,01	Jubilee CLO DAC 2,128 % fällig am 12.07.2028	€ 240	256	0,02	SG Mortgage Securities Trust 4,599 % fällig am 25.10.2036	\$ 3.600	2.457	0,18
2,688 % fällig am 20.10.2028	72	76	0,01	2,846 % fällig am 15.12.2029	2.055	2.152	0,16	Sierra Madre Funding Ltd. 4,597 % fällig am 07.09.2039	2.185	1.621	0,12
Carlyle Euro CLO DAC 2,428 % fällig am 15.08.2030	2.890	3.010	0,22	LCM LP 5,283 % fällig am 20.10.2027	\$ 284	283	0,02	Sound Point CLO Ltd. 5,344 % fällig am 18.04.2031	7.400	7.242	0,54
Carlyle Global Market Strategies CLO Ltd. 5,179 % fällig am 15.10.2030	\$ 1.691	1.674	0,13	Lehman XS Trust 5,709 % fällig am 25.03.2037	2.003	1.919	0,14	5,427 % fällig am 26.07.2031	1.000	974	0,07
Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd. 2,548 % fällig am 15.11.2031	€ 800	827	0,06	LoanCore Issuer Ltd. 5,358 % fällig am 17.01.2037	500	485	0,04	Soundview Home Loan Trust 4,589 % fällig am 25.06.2037	2.306	1.666	0,12
CBAM CLO Ltd. 5,493 % fällig am 20.07.2030	\$ 2.293	2.270	0,17	Long Beach Mortgage Loan Trust 4,829 % fällig am 25.02.2036	366	353	0,03	4,649 % fällig am 25.02.2037	1.017	298	0,02
Cedar Funding CLO Ltd. 5,223 % fällig am 20.04.2031	1.100	1.085	0,08	5,304 % fällig am 25.08.2035	4.270	3.822	0,28	4,889 % fällig am 25.10.2036	1.477	1.401	0,10
5,243 % fällig am 20.01.2031	5.050	4.992	0,37	Madison Park Funding Ltd. 5,155 % fällig am 22.04.2027	836	828	0,06	Structured Asset Investment Loan Trust 5,364 % fällig am 25.01.2035	1.685	1.518	0,11
CIFC Funding Ltd. 5,043 % fällig am 20.01.2028	740	734	0,06	Man GLG Euro CLO DAC 2,058 % fällig am 15.10.2030	€ 2.816	2.936	0,22	Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust 4,544 % fällig am 25.09.2036	4.855	3.069	0,23
5,194 % fällig am 18.04.2031	700	688	0,05	2,248 % fällig am 15.01.2030	572	596	0,04	5,620 % fällig am 25.04.2035	39	38	0,00
CIT Mortgage Loan Trust 5,889 % fällig am 25.10.2037	5.500	5.237	0,39	2,462 % fällig am 15.05.2031	499	520	0,04	TICP CLO Ltd. 5,083 % fällig am 20.04.2028	932	929	0,07
Citigroup Mortgage Loan Trust 4,449 % fällig am 25.07.2045	400	285	0,02	Marathon CLO Ltd. 5,545 % fällig am 21.11.2027	\$ 17	17	0,00	Toro European CLO DAC 2,298 % fällig am 15.07.2030	€ 351	369	0,03
4,539 % fällig am 25.12.2036	101	42	0,00	Midcocean Credit CLO 5,347 % fällig am 19.07.2028	682	679	0,05	WaMu Asset-Backed Certificates WaMu Trust 4,614 % fällig am 25.05.2037	\$ 501	457	0,03
4,559 % fällig am 25.07.2045	7.446	5.343	0,40	Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust 4,459 % fällig am 25.10.2036	1.455	697	0,05	Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust 4,689 % fällig am 25.04.2037	4.701	3.196	0,24
7,250 % fällig am 25.05.2036	875	457	0,03	4,519 % fällig am 25.11.2036	1.684	783	0,06	6,114 % fällig am 25.11.2035	100	98	0,01
Citigroup Mortgage Loan Trust Asset-Backed Pass-Through Certificates 5,334 % fällig am 25.10.2034	54	52	0,00	4,529 % fällig am 25.05.2037	1.420	1.244	0,09				
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc. 4,649 % fällig am 25.03.2037	3.072	2.610	0,19	4,619 % fällig am 25.10.2036	1.179	586	0,04	233.560	17,36		
Contego CLO BV 2,148 % fällig am 15.10.2030	€ 1.599	1.668	0,12	4,619 % fällig am 25.11.2036	5.280	3.192	0,24	STAATSEMISSIONEN			
Contego CLO DAC 2,142 % fällig am 23.01.2030	3.993	4.153	0,31	4,639 % fällig am 25.07.2036	434	367	0,03	Argentina Government International Bond 0,500 % fällig am 09.07.2030	1.422	385	0,03
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust 4,083 % fällig am 25.05.2036	\$ 3.083	3.034	0,23	4,689 % fällig am 25.09.2036	15.216	5.838	0,43	1,000 % fällig am 09.07.2029	150	40	0,00
4,529 % fällig am 25.06.2035	3.428	3.097	0,23	4,889 % fällig am 25.04.2036	105	98	0,01	1,500 % fällig am 09.07.2035	2.504	636	0,05
4,569 % fällig am 25.11.2047 ^	1.019	1.120	0,08	4,929 % fällig am 25.12.2034	1.362	1.205	0,09	Israel Government International Bond 2,750 % fällig am 03.07.2030	1.900	1.730	0,13
4,589 % fällig am 25.06.2047 ^	2.890	2.474	0,18	Morgan Stanley Home Equity Loan Trust 4,899 % fällig am 25.02.2036	1.800	1.618	0,12	3,800 % fällig am 13.05.2060	2.000	1.573	0,12
4,598 % fällig am 25.05.2047 ^	74	66	0,01	Morgan Stanley Mortgage Loan Trust 6,226 % fällig am 25.10.2036 ^	277	86	0,01	Japan Finance Organization for Municipalities 0,050 % fällig am 12.02.2027	€ 1.500	1.394	0,10
4,609 % fällig am 25.09.2037 ^	388	398	0,03	Mountain View CLO Ltd. 4,761 % fällig am 13.10.2027	317	317	0,02	Letras de la Nacion Argentina con Ajuste por CER 0,000 % fällig am 19.05.2023 (c) ARS	27.893	85	0,01
5,049 % fällig am 25.08.2035	350	340	0,03	Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust 4,789 % fällig am 25.02.2037 ^	3.226	1.025	0,08	Peru Government International Bond 5,940 % fällig am 12.02.2029	PEN 33.832	8.145	0,60
Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC 3,024 % fällig am 25.12.2036 ^	163	128	0,01	NovaStar Mortgage Funding Trust 4,549 % fällig am 25.09.2037	20	20	0,00	6,350 % fällig am 12.08.2028	32.446	8.096	0,60
5,304 % fällig am 25.01.2034	491	459	0,03	4,709 % fällig am 25.05.2036	49	47	0,00	Romania Government International Bond 1,750 % fällig am 13.07.2030	€ 1.500	1.118	0,08
CVC Cordatus Loan Fund DAC 2,112 % fällig am 21.07.2030	€ 4.052	4.239	0,32	Oak Hill European Credit Partners DAC 2,186 % fällig am 20.01.2032	€ 785	819	0,06	Russia Government International Bond 4,250 % fällig am 23.06.2027 ^	\$ 200	70	0,01
2,138 % fällig am 15.04.2032	3.498	3.631	0,27	Option One Mortgage Loan Trust 4,529 % fällig am 25.01.2037	\$ 52	31	0,00	4,750 % fällig am 27.05.2026 ^	200	70	0,01
2,578 % fällig am 15.08.2032	5.500	5.722	0,43	4,529 % fällig am 25.02.2037	630	424	0,03	5,100 % fällig am 28.03.2035 ^	400	132	0,01
Dryden Euro CLO DAC 2,038 % fällig am 15.04.2033	4.500	4.660	0,35					5,250 % fällig am 23.06.2047 ^	600	222	0,02
2,228 % fällig am 15.07.2031	581	606	0,05					South Africa Government International Bond 4,850 % fällig am 30.09.2029	2.000	1.790	0,13

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Low Duration Opportunities Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Turkey Government International Bond	\$ 1.000	\$ 993	0,07	JAPAN TREASURY BILLS				PIMCO Select Funds plc –			
5,750 % fällig am 22.03.2024				(0,190) % fällig am 20.03.2023	¥13.120.000	\$ 99.472	7,39	PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (g)	5.839.300	\$ 58.125	4,32
6,350 % fällig am 10.08.2024	2.500	2.477	0,18	(c)(d)						72.181	5,37
		28.956	2,15	Summe kurzfristige Instrumente		107.689	8,00				
				Summe Übertragbare Wertpapiere		\$ 1.216.746	90,41				
AKTIEN								BÖRSENGEHANDELTE FONDS			
STAMMAKTIE								PIMCO ETFs plc – PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (g)	614.500	60.875	4,52
ENERGIE				AKTIEN				Summe Investmentfonds		\$ 133.056	9,89
Constellation Oil Services Holding S.A. 'B' (b)(i)	617.385	67	0,01	INVESTMENTFONDS							
				ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN							
VORZUGSWERTPAPIERE				PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Asia Strategic Interest Bond Fund (g)	1.197.507	10.538	0,79				
Nationwide Building Society 10,250 %	2.850	429	0,03	PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO Asia High Yield Bond Fund (g)	385.356	3.518	0,26				
KURZFRISTIGE INSTRUMENTE											
HUNGARY TREASURY BILLS											
18,250 % fällig am 03.01.2023 (c)(d)	HUF3.083.000	8.217	0,61								

PENSIONS-GESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft ⁽¹⁾	% des Netto- vermögens
FICC	4,280 %	30.12.2022	03.01.2023	\$ 118.800	U.S. Treasury Notes 4,275 % fällig am 30.04.2024	\$ (121.176)	\$ 118.800	\$ 118.856	8,83
Summe Pensions-geschäfte						\$ (121.176)	\$ 118.800	\$ 118.856	8,83

⁽¹⁾ Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
3-Month SOFR December Futures	Short	03.2024	2.036	\$ 9.575	0,71
Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 146,000 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond February 2023 Futures ⁽¹⁾	Short	01.2023	21	17	0,00
Euro-Bobl March Futures	Short	03.2023	289	1.046	0,08
Euro-BTP Italy Government Bond March Futures	Long	03.2023	237	(2.044)	(0,15)
Euro-Bund 10-Year Bond March Futures	Short	03.2023	176	1.604	0,12
Euro-Buxl 30-Year Bond March Futures	Long	03.2023	16	(437)	(0,03)
Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 138,500 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond February 2023 Futures ⁽¹⁾	Short	01.2023	21	(107)	(0,01)
U.S. Treasury 2-Year Note March Futures	Long	03.2023	1.025	(1.078)	(0,08)
U.S. Treasury 5-Year Note March Futures	Short	03.2023	239	(4)	0,00
U.S. Treasury 10-Year Note March Futures	Short	03.2023	131	340	0,02
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond March Futures	Short	03.2023	446	358	0,03
				\$ 9.270	0,69

⁽¹⁾ Future-Style-Option.

VERKAUFSoPTIONEN

OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Markt-wert	% des Netto- vermögens
Call – CME Kaufoptionen mit Ausübungskurs von USD 98,000 auf 3-Month SOFR December Futures	\$ 98,000	15.12.2023	133	\$ 0	\$ (12)	0,00
Put – CME Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von USD 96,500 auf 3-Month SOFR December Futures	96,500	15.12.2023	133	0	(403)	(0,03)
				\$ 0	\$ (415)	(0,03)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate					\$ 8.855	0,66

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽³⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
AT&T, Inc.	1,000 %	20.06.2024	\$ 3.200	\$ 7	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2026	1.900	(34)	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20.06.2027	500	8	0,00
General Electric Co.	1,000	20.06.2026	1.700	(1)	0,00
				\$ (20)	0,00

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF⁽²⁾

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽³⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.HY-34 5-Year Index	(5,000) %	20.06.2025	\$ 20.930	\$ (1.696)	(0,13)
CDX.HY-39 5-Year Index	(5,000)	20.12.2027	11.100	(235)	(0,02)
iTraxx Europe Main 32 5-Year Index	(1,000)	20.12.2024	€ 200	3	0,00
				\$ (1.928)	(0,15)

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽³⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.HY-37 5-Year Index	5,000 %	20.12.2026	\$ 396	\$ (18)	0,00
CDX.IG-39 5-Year Index	1,000	20.12.2027	1.700	14	0,00
				\$ (4)	0,00

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	0,500 %	07.02.2023	£ 53.000	\$ (754)	(0,06)
Zahlung ⁽⁴⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	2,000	15.03.2033	21.100	562	0,04
Erhalt ⁽⁴⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	2,250	15.03.2028	32.300	1.163	0,09
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	21.12.2052	\$ 49.700	3.321	0,25
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,853	18.05.2032	49.800	(6.528)	(0,49)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,350	14.12.2032	10.600	235	0,02
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,055	04.01.2027	BRL 18.600	(150)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,086	04.01.2027	114.100	(924)	(0,07)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,098	04.01.2027	132.600	(1.066)	(0,08)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,734	02.01.2025	112.000	(367)	(0,03)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,800	02.01.2025	111.000	(340)	(0,03)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,814	04.01.2027	69.000	(281)	(0,02)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,835	02.01.2025	111.000	(328)	(0,02)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,868	04.01.2027	14.300	(54)	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	2,000	14.11.2023	CAD 44.700	(933)	(0,07)
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	2,060	28.10.2023	193.100	(3.976)	(0,30)
Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	1,750	15.12.2026	KRW 135.049.300	(7.328)	(0,54)
Erhalt	3-Month KRW-KORIBOR	1,750	15.12.2031	69.068.100	6.796	0,51
Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	2,000	15.12.2026	90.071.300	(3.722)	(0,28)
Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	2,000	15.12.2031	40.820.400	3.187	0,24
Zahlung	3-Month NZD-BBR	3,000	01.11.2023	NZD 120.200	(1.642)	(0,12)
Zahlung	3-Month NZD-BBR	3,000	15.12.2023	139.900	(2.057)	(0,15)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,500	16.06.2026	\$ 83.700	(7.984)	(0,59)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,250	17.06.2030	5.000	721	0,05
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,270	04.11.2023	335.700	(11.696)	(0,87)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,500	18.12.2029	1.210	140	0,01
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,000	10.12.2029	5.100	606	0,05
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,000	12.02.2030	9.900	1.324	0,10
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,000	10.03.2030	4.900	569	0,04
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,250	20.06.2028	14.860	437	0,03
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,550	10.08.2024	€ 300	3	0,00
Erhalt ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	1,500	15.03.2028	18.900	871	0,06
Zahlung ⁽⁴⁾	6-Month EUR-EURIBOR	1,750	15.03.2033	6.540	(30)	0,00
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	6,985	11.10.2027	PLN 83.000	(587)	(0,04)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	7,015	11.10.2027	64.100	(472)	(0,04)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	7,156	13.10.2027	42.800	(374)	(0,03)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,660	24.03.2023	MXN 345.970	(215)	(0,02)
					\$ (31.873)	(2,37)
					\$ (33.825)	(2,52)

Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Low Duration Opportunities Fund (Forts.)

- (1) Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definieren, dann zahlt der Teilfonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.
- (2) Agiert der Teilfonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definieren, dann erhält der Teilfonds entweder (i) vom Sicherungsgeber einen Betrag in Höhe des Nennwerts des Swaps und liefert die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er erhält einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.
- (3) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definieren.
- (4) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

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

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

OPTIONSKAUF

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Kosten	Markt-wert	% des Netto-vermögens
BOA	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,023 %	29.06.2023	14.900	\$ 792	\$ 3.262	0,24
	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,021	25.10.2023	6.200	354	1.563	0,12
FAR	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,021	15.09.2023	10.500	551	2.533	0,19
MYC	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,021	15.09.2023	11.000	598	2.711	0,20
							\$ 2.295	\$ 10.069	0,75

VERKAUFSoPTIONEN

CREDIT DEFAULT SWAPTIONS AUF KREDITINDIZES

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/-verkauf	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Netto-vermögens
GST	Put – OTC iTraxx Europe 37 5-Year Index	Verkauf	3,000 %	15.03.2023	14.400	\$ (26)	\$ (2)	0,00

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Netto-vermögens
BOA	Put – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,021 %	29.06.2023	73.000	\$ (793)	\$ (5.725)	(0,43)
	Put – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,020	25.10.2023	31.000	(355)	(2.443)	(0,18)
BPS	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,550	31.03.2023	160.800	(268)	0	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,100	31.03.2023	160.800	(354)	(2.469)	(0,18)
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,700	28.04.2023	11.300	(20)	0	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,250	28.04.2023	11.300	(20)	(160)	(0,01)
FAR	Put – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,020	15.09.2023	52.500	(551)	(4.240)	(0,32)
GLM	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,018	20.10.2023	4.600	(30)	(6)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,018	20.10.2023	4.600	(30)	(59)	(0,01)
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,140	23.10.2023	4.600	(32)	(7)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,140	23.10.2023	4.600	(32)	(54)	(0,01)
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,190	23.10.2023	4.600	(32)	(7)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,190	23.10.2023	4.600	(32)	(52)	0,00
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,225	23.10.2023	4.600	(32)	(7)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,225	23.10.2023	4.600	(32)	(51)	0,00
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,973	25.10.2023	4.600	(32)	(6)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,973	25.10.2023	4.600	(32)	(60)	(0,01)
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,841	27.10.2023	4.700	(32)	(5)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,841	27.10.2023	4.700	(32)	(66)	(0,01)
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,250	17.11.2023	24.600	(89)	(17)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	17.11.2023	24.600	(89)	(176)	(0,01)
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,150	20.11.2023	36.100	(126)	(23)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	20.11.2023	36.100	(126)	(280)	(0,02)
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,250	07.12.2023	13.300	(41)	(11)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	07.12.2023	13.300	(42)	(92)	(0,01)
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,500	07.02.2023	355.800	(1.228)	(10.605)	(0,79)
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,700	26.04.2023	11.000	(19)	0	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,250	26.04.2023	11.000	(19)	(156)	(0,01)
	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,067	09.06.2023	4.800	(56)	(12)	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	3,140	09.06.2023	4.800	(66)	(157)	(0,01)
MYC	Put – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,020	15.09.2023	55.000	(598)	(4.494)	(0,33)
							\$ (5.240)	\$ (31.440)	(2,34)

OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Netto- vermögens
BOA	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.01.2053	\$ 101,891	05.01.2023	2.400	\$ (7)	\$ 0	0,00
SAL	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fällig am 01.03.2053	97,578	06.03.2023	2.800	(22)	(26)	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fällig am 01.03.2053	99,578	06.03.2023	2.800	(20)	(21)	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.01.2053	101,859	05.01.2023	2.000	(6)	0	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.02.2053	99,750	06.02.2023	1.300	(9)	(8)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.02.2053	100,000	06.02.2023	4.700	(32)	(33)	(0,01)
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.02.2053	101,750	06.02.2023	1.300	(8)	(3)	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.02.2053	102,000	06.02.2023	4.700	(28)	(8)	0,00
					\$ (132)	\$ (99)	(0,01)

⁽¹⁾ Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZKAUF⁽¹⁾

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag ⁽²⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	UBS AG	(1,000) %	20.06.2024	\$ 200	\$ 13	\$ (14)	\$ (1)	0,00

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽²⁾

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag ⁽³⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BRC	Turkey Government International Bond	1,000 %	20.06.2024	\$ 200	\$ (26)	\$ 17	\$ (9)	0,00
GLM	Petrobras Global Finance BV	1,000	20.12.2023	1.200	(88)	88	0	0,00
GST	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2024	200	(3)	2	(1)	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.06.2024	2.300	(102)	98	(4)	0,00
HUS	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2024	400	(12)	12	0	0,00
					\$ (231)	\$ 217	\$ (14)	0,00

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF⁽²⁾

Kontrahent	Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag ⁽³⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
GST	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500 %	17.11.2059	\$ 2.200	\$ (9)	\$ 4	\$ (5)	0,00
MYC	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	100	(4)	4	0	0,00
SAL	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	1.500	(3)	0	(3)	0,00
UAG	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	300	(9)	8	(1)	0,00
					\$ (25)	\$ 16	\$ (9)	0,00

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

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

⁽³⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definieren.

ZINSSWAPS

Kontrahent	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Netto- vermögens
BOA	Erhält	3-Month THB-THORON Compounded-OIS	1,000 %	15.12.2026	THB 5.052.060	\$ 6.599	\$ 54	\$ 6.653	0,49
	Zahlung	3-Month THB-THORON Compounded-OIS	1,500	15.12.2031	2.436.270	(5.559)	29	(5.530)	(0,41)
GLM	Zahlung	6-Month THB-THBFIX	1,500	15.12.2031	15.800	(11)	(27)	(38)	0,00
						\$ 1.029	\$ 56	\$ 1.085	0,08

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Low Duration Opportunities Fund (Forts.)

DEVIENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
BOA	01.2023	HUF	558.172	\$ 1.425	\$ 0	\$ (63)	0,00	
	01.2023	PEN	2.080	541	0	(4)	0,00	
	01.2023	PLN	1.291	294	0	0	0,00	
	01.2023	\$	216	PLN 958	2	0	2	0,00
	01.2023		657	ZAR 11.669	28	0	28	0,00
	02.2023		541	PEN 2.087	4	0	4	0,00
	02.2023		1.246	ZAR 22.325	62	0	62	0,01
	03.2023		1.388	24.515	44	0	44	0,00
	01.2023	HUF	748.809	\$ 1.958	0	(38)	(38)	0,00
01.2023	\$	773	€ 724	0	0	0	0,00	
03.2023	CLP	5.695.075	\$ 5.898	0	(715)	(715)	(0,05)	
03.2023	MXN	20.290	1.007	0	(20)	(20)	0,00	
03.2023	\$	2.645	CNY 18.278	12	0	12	0,00	
01.2023	CNH	2.226	\$ 319	0	(3)	(3)	0,00	
01.2023	HUF	1.596.059	4.162	0	(92)	(92)	(0,01)	
01.2023	\$	1.606	£ 1.334	0	(1)	(1)	0,00	
01.2023		469	PLN 2.079	6	(1)	5	0,00	
02.2023		204	ZAR 3.378	0	(6)	(6)	0,00	
01.2023	BRL	86.014	\$ 16.424	133	0	133	0,01	
01.2023	CLP	5.726.680	6.437	0	(279)	(279)	(0,02)	
01.2023	PEN	16.070	4.065	0	(143)	(143)	(0,01)	
01.2023	PLN	9.794	2.139	0	(93)	(93)	(0,01)	
01.2023	\$	16.388	BRL 86.014	0	(97)	(97)	(0,01)	
01.2023		6.008	CLP 5.724.749	706	0	706	0,05	
01.2023		1.516	PEN 5.831	12	0	12	0,00	
01.2023		4.329	PLN 20.049	239	0	239	0,02	
02.2023	BRL	17.762	\$ 3.291	0	(55)	(55)	0,00	
02.2023	NZD	4.739	2.875	0	(124)	(124)	(0,01)	
02.2023	PEN	12.459	3.124	0	(133)	(133)	(0,01)	
02.2023	\$	16.323	BRL 86.014	0	(120)	(120)	(0,01)	
02.2023		6.437	CLP 5.758.223	284	0	284	0,02	
04.2023	PEN	40.966	\$ 10.268	0	(381)	(381)	(0,03)	
05.2023		12.629	3.183	0	(93)	(93)	(0,01)	
01.2023	HUF	162.417	413	0	(20)	(20)	0,00	
01.2023	CNH	2.310	332	0	(2)	(2)	0,00	
01.2023	PLN	106.448	21.126	0	(3.127)	(3.127)	(0,23)	
01.2023	\$	734	PEN 2.953	39	0	39	0,00	
01.2023		1.436	PLN 6.757	103	0	103	0,01	
01.2023		1.276	ZAR 22.807	63	0	63	0,01	
02.2023		2.211	COP 10.070.699	0	(153)	(153)	(0,01)	
03.2023	MXN	41.612	\$ 2.024	0	(82)	(82)	(0,01)	
05.2023	PEN	50.447	12.678	0	(411)	(411)	(0,03)	
05.2023	\$	2.622	PEN 10.610	133	0	133	0,01	
05.2023		354	ZAR 5.921	0	(10)	(10)	0,00	
01.2023	CAD	1.154	\$ 860	9	0	9	0,00	
01.2023	€	209.765	219.852	0	(4.116)	(4.116)	(0,31)	
01.2023	\$	101	AUD 151	1	0	1	0,00	
01.2023		7.151	¥ 973.920	235	0	235	0,02	
01.2023		945	PLN 4.792	147	0	147	0,01	
05.2023		653	CNH 4.383	0	(13)	(13)	0,00	
01.2023	£	362	\$ 435	0	0	0	0,00	
01.2023	PLN	6.472	1.370	0	(105)	(105)	(0,01)	
01.2023	\$	3.216	AUD 4.789	32	0	32	0,00	
01.2023		25	€ 24	0	0	0	0,00	
01.2023		1.380	£ 1.145	0	(3)	(3)	0,00	
01.2023		6.109	¥ 836.817	238	0	238	0,02	
01.2023		1.826	PLN 9.156	260	0	260	0,02	
01.2023		830	ZAR 14.886	44	0	44	0,00	
02.2023	TWD	1.106	\$ 36	0	0	0	0,00	
02.2023	\$	830	ZAR 14.914	43	0	43	0,00	
01.2023	¥	6.614	\$ 49	0	(2)	(2)	0,00	
01.2023	\$	37	AUD 55	0	0	0	0,00	
03.2023		3	MXN 54	0	0	0	0,00	
04.2023	MXN	12.717	\$ 613	0	(26)	(26)	0,00	
01.2023	€	3.201	3.393	0	(25)	(25)	0,00	
01.2023	\$	216	AUD 321	1	0	1	0,00	
01.2023		1.483	£ 1.198	0	(42)	(42)	0,00	
01.2023		5.087	PEN 19.594	48	0	48	0,00	
02.2023	NZD	1.227	\$ 746	0	(31)	(31)	0,00	
02.2023	TWD	1.970	64	0	0	0	0,00	
01.2023	PEN	5.622	1.456	0	(17)	(17)	0,00	
01.2023	\$	1.456	PEN 5.622	17	0	17	0,00	
03.2023	¥	13.120.000	\$ 97.813	0	(2.629)	(2.629)	(0,19)	
01.2023	£	83.080	99.886	0	(67)	(67)	(0,01)	
01.2023	HUF	6.136	16	0	0	0	0,00	
01.2023	\$	128	PLN 565	0	0	0	0,00	
03.2023		836	ZAR 14.934	36	0	36	0,00	
				\$ 2.981	\$ (13.342)	\$ (10.361)	(0,77)	

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRÄKTE

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Investor EUR (Hedged) thesaurierend und E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu erhaltende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	01.2023	\$ 16	€ 15	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
CBK	01.2023	€ 425	\$ 450	0	(4)	(4)	0,00
	01.2023	\$ 14.573	€ 14.056	435	0	435	0,03
MBC	01.2023	€ 46	\$ 49	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 15.158	€ 14.457	278	0	278	0,02
SCX	01.2023	14.630	14.056	378	0	378	0,03
				\$ 1.091	\$ (4)	\$ 1.087	0,08

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend und Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2023	£ 1	\$ 2	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	01.2023	\$ 432.689	£ 358.563	0	(1.304)	(1.304)	(0,09)
BPS	01.2023	£ 2.654	\$ 3.199	7	0	7	0,00
BRC	01.2023	1.141	1.374	1	0	1	0,00
	01.2023	\$ 430	£ 358	0	0	0	0,00
MBC	01.2023	£ 1	\$ 2	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 395.636	£ 330.110	1.689	(173)	1.516	0,11
MYI	01.2023	£ 63	\$ 77	1	0	1	0,00
	01.2023	\$ 7	£ 5	0	0	0	0,00
TOR	01.2023	385.980	321.038	258	0	258	0,02
UAG	01.2023	£ 199	\$ 246	7	0	7	0,00
				\$ 1.963	\$ (1.477)	\$ 486	0,04

Summe Freiverkehrsfinauzderivate

\$ (29.199) (2,17)

LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN			
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.02.2053	\$ 115.500	\$ (94.108)	(6,99)
Summe Leerverkaufte Wertpapiere		\$ (94.108)	(6,99)
Summe Anlagen		\$ 1.320.325	98,11
Sonstige Aktiva und Passiva		\$ 25.456	1,89
Nettovermögen		\$ 1.345.781	100,00

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

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

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.

(b) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.

(c) Nullkuponwertpapier.

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

(e) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

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

(g) Mit dem Fonds verbunden.

(h) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(i) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2021: 0,00 %):

Emittentenbeschreibung	Kaufdatum	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
Constellation Oil Services Holding S.A. 'B'	06.10.2022	\$ 67	\$ 67	0,00
Deutsche Bank AG 3,729 % fällig am 14.01.2023	11.01.2021 - 24.02.2021	2.202	1.617	0,12
		\$ 2.269	\$ 1.684	0,12

Wertpapier mit einem Gesamtmarktwert von 0 USD (31. Dezember 2021: 1.087 USD) wurden gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen zum 31. Dezember 2022 als Sicherheiten verpfändet.

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Low Duration Opportunities Fund (Forts.)

Barmittel in Höhe von 29.843 USD (31. Dezember 2021: 29.150 USD) wurden zum 31. Dezember 2022 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Wertpapiere mit einem Gesamtwert von 0 USD (31. Dezember 2021: 1.772 USD) und Barmittel in Höhe von 27.963 USD (31. Dezember 2021: 631 USD) wurden gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. zum 31. Dezember 2022 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 1.216.185	\$ 561	\$ 1.216.746
Investmentfonds	72.181	60.875	0	133.056
Pensionsgeschäfte	0	118.800	0	118.800
Finanzderivate ⁽³⁾	79	(54.248)	0	(54.169)
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(94.108)	0	(94.108)
Summen	\$ 72.260	\$ 1.247.504	\$ 561	\$ 1.320.325

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

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 2.782.550	\$ 4.246	\$ 2.786.796
Investmentfonds	312.142	0	0	312.142
Pensionsgeschäfte	0	72.663	0	72.663
Finanzderivate ⁽³⁾	(1.587)	23.278	0	21.691
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(253.414)	0	(253.414)
Summen	\$ 310.555	\$ 2.625.077	\$ 4.246	\$ 2.939.878

⁽¹⁾ Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

⁽²⁾ Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

⁽³⁾ Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung des Marktwerts der außerbörslich gehandelten Finanzderivate und (erhaltenen)/verpfändeten Sicherheiten nach Kontrahenten zum 31. Dezember 2022 und 31. Dezember 2021:

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2022			Zum 31. Dez. 2021		
	Gesamtwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾	Gesamtwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Nettoengagement ⁽¹⁾
AZD	\$ k. A.	\$ k. A.	\$ k. A.	\$ 45	\$ 0	\$ 45
BOA	(3.452)	3.430	(22)	4.340	(4.050)	290
BPS	(3.383)	3.100	(283)	(253)	30	(223)
BRC	(105)	30	(75)	288	0	288
CBK	287	(540)	(253)	(1.013)	933	(80)
CLY	(20)	0	(20)	k. A.	k. A.	k. A.
FAR	(1.707)	1.460	(247)	(172)	280	108
GLM	(15.394)	15.157	(237)	(118)	839	721
GST	(12)	22	10	(28)	0	(28)
HUS	k. A.	k. A.	k. A.	590	(370)	220
MBC	(1.943)	1.280	(663)	k. A.	k. A.	k. A.
MYC	(1.783)	1.490	(293)	(178)	280	102
MYI	510	(320)	190	15.963	(12.640)	3.323
RBC	(28)	0	(28)	138	0	138
RYL	(25)	0	(25)	k. A.	k. A.	k. A.
SAL	(102)	94	(8)	(52)	41	(11)
SCX	354	(460)	(106)	11.660	(10.840)	820
SSB	(2.629)	1.900	(729)	157	0	157
TOR	191	(750)	(559)	49	0	49
UAG	42	(20)	22	11.656	(8.420)	3.236

⁽¹⁾ Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2022:

	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	44,59	44,94
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	43,14	39,48
Sonstige übertragbare Wertpapiere	2,68	2,20
Investmentfonds	9,89	9,70
Pensionsgeschäfte	8,83	2,26
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,66	(0,09)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(2,52)	(0,58)
Freiverkehrsfinanzderivate	(2,17)	1,34
Leerverkaufte Wertpapiere	(6,99)	(7,87)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	k. A.	(0,03)

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2022 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
Kreditbeteiligungen und -abtretungen	2,57	1,55
Unternehmensanleihen und Wechsel	23,54	27,44
Kommunalanleihen und Wechsel	0,56	0,23
US-Regierungsbehörden	14,02	1,40
US-Schatzobligationen	14,38	14,78
Non-Agency-MBS	7,79	4,45
Forderungsbesicherte Wertpapiere	17,36	8,35
Staatsemissionen	2,15	2,74
Stammaktien	0,01	k. A.
Vorzugswertpapiere	0,03	0,02
Kurzfristige Instrumente	8,00	25,66
Investmentfonds	9,89	9,70
Pensionsgeschäfte	8,83	2,26
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,69	(0,09)
Verkaufsoptionen		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	(0,03)	k. A.
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf	0,00	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	(0,15)	(0,09)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,00	0,01
Zinsswaps	(2,37)	(0,50)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Zinsswapoptionen	0,75	0,06
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaptions auf Kreditindizes	0,00	0,00
Zinsswapoptionen	(2,34)	(0,13)
Optionen auf Wertpapiere	(0,01)	(0,00)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzkauf	0,00	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf	0,00	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,00	0,00
Zinsswaps	0,08	0,01
Devisenterminkontrakte	(0,77)	(0,25)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,12	1,65
Leerverkaufte Wertpapiere	(6,99)	(7,87)
Sonstige Aktiva und Passiva	1,89	8,62
Nettovermögen	100,00	100,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Low Duration Opportunities ESG Fund

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTO-VERMÖGENS	% DES	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTO-VERMÖGENS	% DES	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	NETTO-VERMÖGENS	% DES
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE					KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNGEN					VERSÖRGUNGSUNTERNEHMEN				
CenturyLink, Inc. 6,634 % fällig am 15.03.2027	\$ 20	\$ 19	0,39		NTT Finance Corp. 0,082 % fällig am 13.12.2025	€ 100	\$ 97	1,97		Clearway Energy Operating LLC 3,750 % fällig am 15.02.2031	\$ 14	\$ 12	0,24	
CommScope, Inc. 7,634 % fällig am 06.04.2026	20	19	0,39		OneMain Finance Corp. 5,625 % fällig am 15.03.2023	\$ 16	16	0,33		Duke Energy Florida LLC 2,500 % fällig am 01.12.2029	54	46	0,93	
Hilton Domestic Operating Co., Inc. 6,173 % fällig am 22.06.2026	20	20	0,41		Pacific Life Global Funding 1,375 % fällig am 14.04.2026	19	17	0,35		Lumen Technologies, Inc. 4,000 % fällig am 15.02.2027	18	15	0,31	
U.S. Foods, Inc. 7,134 % fällig am 22.11.2028	18	17	0,34		Radian Group, Inc. 6,625 % fällig am 15.03.2025	12	12	0,24		NextEra Energy Capital Holdings, Inc. 1,900 % fällig am 15.06.2028	54	46	0,93	
		75	1,53		Santander Holdings USA, Inc. 5,807 % fällig am 09.09.2026	30	30	0,61		Verizon Communications, Inc. 1,500 % fällig am 18.09.2030	25	20	0,41	
					SBA Communications Corp. 3,875 % fällig am 15.02.2027	18	16	0,32		Vodafone Group PLC 5,125 % fällig am 04.06.2081	18	13	0,26	
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					INDUSTRIEWERTE					US-REGIERUNGSBEHÖRDEN				
BANKEN UND FINANZEN					INDUSTRIEWERTE					US-REGIERUNGSBEHÖRDEN				
Aflac, Inc. 1,125 % fällig am 15.03.2026	19	17	0,35		Ball Corp. 2,875 % fällig am 15.08.2030	16	13	0,26		Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,000 % fällig am 01.02.2053	80	70	1,43	
Alexandria Real Estate Equities, Inc. 2,950 % fällig am 15.03.2034	14	11	0,22		Elevance Health, Inc. 2,550 % fällig am 15.03.2031	28	24	0,49		3,500 % fällig am 01.02.2053	220	200	4,06	
American Tower Corp. 1,450 % fällig am 15.09.2026	36	32	0,65		FactSet Research Systems, Inc. 3,450 % fällig am 01.03.2032	18	15	0,30						
Bank of America Corp. 2,456 % fällig am 22.10.2025	52	49	0,99		Ford Motor Co. 6,100 % fällig am 19.08.2032	10	9	0,18						
Bank of Nova Scotia 5,245 % fällig am 11.03.2024	48	48	0,97		Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide 1,875 % fällig am 31.03.2028	€ 27	25	0,51						
Citigroup, Inc. 4,615 % fällig am 25.01.2026 (c)	50	49	0,99		HCA, Inc. 3,625 % fällig am 15.03.2032	\$ 28	24	0,49						
Corebridge Financial, Inc. 3,850 % fällig am 05.04.2029	18	17	0,35		Hilton Domestic Operating Co., Inc. 3,625 % fällig am 15.02.2032	20	16	0,32						
Deutsche Bank AG 1,375 % fällig am 10.06.2026	€ 25	25	0,51		3,750 % fällig am 01.05.2029	18	16	0,32						
Equinix, Inc. 1,000 % fällig am 15.09.2025	\$ 28	25	0,51		MSCI, Inc. 3,625 % fällig am 01.09.2030	22	18	0,37						
1,550 % fällig am 15.03.2028	30	25	0,51		Nucor Corp. 4,300 % fällig am 23.05.2027	10	10	0,20						
Equitable Financial Life Global Funding 1,300 % fällig am 12.07.2026	28	24	0,49		S&P Global, Inc. 4,750 % fällig am 01.08.2028	48	48	0,97						
Europäische Investitionsbank 2,375 % fällig am 24.05.2027	67	62	1,26		VeriSign, Inc. 2,700 % fällig am 15.06.2031	30	24	0,49						
Goldman Sachs Group, Inc. 4,387 % fällig am 15.06.2027	49	47	0,95		VMware, Inc. 3,900 % fällig am 21.08.2027	18	17	0,35						
HAT Holdings LLC 3,375 % fällig am 15.06.2026	16	14	0,28		Walt Disney Co. 2,200 % fällig am 13.01.2028	52	46	0,93						
HSBC Holdings PLC 5,750 % fällig am 20.12.2027	€ 16	19	0,39		Warnermedia Holdings, Inc. 4,054 % fällig am 15.03.2029	28	24	0,49						
Hudson Pacific Properties LP 5,950 % fällig am 15.02.2028	\$ 10	9	0,18		Western Digital Corp. 4,750 % fällig am 15.02.2026	16	15	0,30						
JPMorgan Chase & Co. 2,947 % fällig am 24.02.2028	52	47	0,95		Xylem, Inc. 1,950 % fällig am 30.01.2028	30	26	0,53						
Manulife Financial Corp. 3,703 % fällig am 16.03.2032	26	23	0,47				370	7,50						
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc. 3,741 % fällig am 07.03.2029	50	46	0,93											
Mizuho Financial Group, Inc. 0,214 % fällig am 07.10.2025	€ 100	98	1,99											
3,490 % fällig am 05.09.2027	100	104	2,11											
NatWest Group PLC 4,067 % fällig am 06.09.2028	100	104	2,11											

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

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablaufmonat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Euro-Bobl March Futures	Long	03.2023	1	\$ (4)	(0,09)
U.S. Treasury 2-Year Note March Futures	Long	03.2023	2	(2)	(0,04)
U.S. Treasury 5-Year Note March Futures	Long	03.2023	11	(8)	(0,16)
U.S. Treasury 10-Year Note March Futures	Short	03.2023	3	5	0,11
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond March Futures	Short	03.2023	2	0	0,00
				\$ (9)	(0,18)
				\$ (9)	(0,18)

Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	2,000 %	15.03.2033	£ 120	\$ 3	0,06
Erhalt	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	2,250	15.03.2028	100	3	0,07
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	2,060	28.10.2023	CAD 600	(4)	(0,10)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,750	15.03.2033	€ 100	(1)	(0,01)
					\$ 1	0,02
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					\$ 1	0,02

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

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

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	02.2023	CAD 10	\$ 8	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	02.2023	€ 3	\$ 3	0	0	0	0,00
	02.2023	£ 8	10	0	0	0	0,00
	02.2023	\$ 3	€ 3	0	0	0	0,00
BRC	02.2023	48	¥ 6.600	4	0	4	0,05
	02.2023	€ 100	\$ 98	0	(8)	(8)	(0,17)
CBK	02.2023	\$ 3	€ 3	0	0	0	0,00
	02.2023	€ 3	\$ 3	0	0	0	0,00
MYI	02.2023	\$ 14	AUD 20	0	0	0	0,01
	03.2023	¥ 32.400	\$ 239	0	(9)	(9)	(0,19)
SCX	03.2023	\$ 37.600	277	0	(11)	(11)	(0,21)
	02.2023	€ 623	649	0	(19)	(19)	(0,36)
				\$ 4	\$ (47)	\$ (43)	(0,87)

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend und Institutional EUR (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CBK	01.2023	€ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	01.2023	\$ 83	€ 80	2	0	2	0,04
GLM	01.2023	81	78	2	0	2	0,04
MYI	01.2023	€ 2	\$ 2	0	0	0	0,00
SCX	01.2023	\$ 81	€ 78	2	0	2	0,04
				\$ 6	\$ 0	\$ 6	0,12

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend und Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2023	\$ 81	£ 67	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
BRC	01.2023	2	1	0	0	0	0,00
CBK	01.2023	82	67	0	(1)	(1)	(0,01)
SCX	01.2023	81	67	1	0	1	0,01
				\$ 1	\$ (1)	\$ 0	0,00
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						\$ (37)	(0,75)
Summe Anlagen						\$ 5.025	101,97
Sonstige Aktiva und Passiva						\$ (97)	(1,97)
Nettovermögen						\$ 4.928	100,00

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

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

(a) Nullkuponwertpapier.

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

(c) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2021: n. z.):

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeitsdatum	Kaufdatum	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
Citigroup, Inc.	4,615 %	25.01.2026	27.07.2022	\$ 49	\$ 49	0,99

Barmittel in Höhe von 31 USD wurden zum 31. Dezember 2022 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 5.070	\$ 0	\$ 5.070
Finanzderivate ⁽³⁾	(4)	(41)	0	(45)
Summen	\$ (4)	\$ 5.029	\$ 0	\$ 5.025

⁽¹⁾ Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

⁽²⁾ Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

⁽³⁾ Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung des Marktwerts der außerbörslich gehandelten Finanzderivate und (erhaltenen)/verpfändeten Sicherheiten nach Kontrahenten zum 31. Dezember 2022 und 31. Dezember 2021:

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2022		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾
BOA	\$ 4	\$ 0	\$ 4
BRC	(8)	0	(8)
CBK	(8)	0	(8)
GLM	2	0	2
MYI	(11)	0	(11)
SCX	(16)	0	(16)

⁽¹⁾ Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2022:

	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%) ⁽¹⁾
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	32,23	k. A.
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	70,65	k. A.
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,18)	k. A.
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,02	k. A.
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,75)	k. A.

⁽¹⁾ Der Low Duration Opportunities ESG Fund wurde am 27. Juli 2022 aufgelegt.

BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
STAMMAKTIEN								U.S. TREASURY BILLS			
Enbridge, Inc.	92.200	\$ 3.601	3,00	EOG Resources, Inc.	8.700	\$ 1.127	0,94	4,034 % fällig am 26.01.2023 (b)(c)	35.500	\$ 35.412	29,48
Pembina Pipeline Corp.	128.600	4.362	3,63	EQT Corp.	74.800	2.530	2,11	4,449 % fällig am 30.03.2023 (b)(c)	1.700	1.683	1,40
TC Energy Corp.	73.720	2.937	2,44	Equitrans Midstream Corp.	492.882	3.302	2,75				
Summe Kanada		10.900	9,07	Marathon Oil Corp.	58.500	1.584	1,32				
USA				Occidental Petroleum Corp.	26.066	1.642	1,37	Summe kurzfristige Instrumente		41.989	34,95
STAMMAKTIEN ENERGIE				ONEOK, Inc.	54.130	3.556	2,96	Summe Übertragbare Wertpapiere		\$ 106.959	89,02
Antero Resources Corp. (a)	26.400	818	0,68	Pioneer Natural Resources Co.	17.400	3.974	3,31	AKTIEN			
Cheniere Energy, Inc.	36.133	5.418	4,51	Targa Resources Corp.	77.400	5.689	4,73	INVESTMENTFONDS			
Chesapeake Energy Corp.	53.400	5.039	4,19	Williams Cos., Inc.	180.200	5.929	4,92	ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN			
ConocoPhillips	19.000	2.242	1,87	Summe USA		54.070	45,00	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (d)			
Devon Energy Corp.	30.200	1.858	1,55					1.188.741		11.833	9,85
Diamondback Energy, Inc.	7.800	1.067	0,89	KURZFRISTIGE INSTRUMENTE				Summe Investmentfonds		\$ 11.833	9,85
DTE Midstream LLC	84.900	4.692	3,90	KURZFRISTIGE SCHULDITITEL							
EnLink Midstream LLC	292.900	3.603	3,00	Federal Home Loan Bank							
				4,035 % fällig am							
				27.01.2023 (b)(c)	\$ 1.900	1.894	1,57				
				4,345 % fällig am 06.03.2023	3.000	3.000	2,50				
							4,894				4,07

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft ⁽¹⁾	% des Nettovermögens
SSB	1,900 %	30.12.2022	03.01.2023	\$ 811	U.S. Treasury Notes 1,875 % fällig am 30.06.2026	\$ (827)	\$ 811	\$ 811	0,68
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (827)	\$ 811	\$ 811	0,68

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES

Kontrahent	Zahlung/Erhalt	Wertpapier	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Variabler Zinssatz	Nenn-betrag	Fälligkeits-datum	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
FAR	Erhalt	Alerian MLP Index	3.002	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	\$ 4.475	12.04.2023	\$ 0	\$ (17)	\$ (17)	(0,01)

TOTAL RETURN SWAPS AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Zahlung/Erhalt	Wertpapier	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Variabler Zinssatz	Nenn-betrag	Fälligkeits-datum	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Erhalt	Energy Transfer LP	280.669	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	\$ 3.332	18.01.2023	\$ 0	\$ (14)	\$ (14)	(0,01)
	Erhalt	Enterprise Products Partners LP	269.570	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	6.502	18.01.2023	0	(26)	(26)	(0,02)
	Erhalt	Western Midstream Partners LP	130.861	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	3.514	18.01.2023	0	(14)	(14)	(0,01)
	Erhalt	Energy Transfer LP	296.220	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	3.513	12.04.2023	0	(12)	(12)	(0,01)
	Erhalt	Genesis Energy LP	189.800	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	1.938	15.11.2023	0	(8)	(8)	(0,01)
	Erhalt	MPLX LP	230.900	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	7.583	15.11.2023	0	(29)	(29)	(0,02)
	Erhalt	Plains All American Pipeline LP	301.256	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	3.543	15.11.2023	0	(14)	(14)	(0,01)
	Erhalt	Sunoco LP	83.100	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	3.582	15.11.2023	0	(13)	(13)	(0,01)
CBK	Erhalt	Energy Transfer LP	177.084	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	2.102	12.04.2023	0	(8)	(8)	(0,01)
FAR	Erhalt	Crestwood Equity Partners LP	56.900	1-Month USD-LIBOR abzgl. eines bestimmten Spreads	1.490	06.09.2023	0	1	1	0,00
	Erhalt	Crestwood Equity Partners LP	15.800	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	414	06.09.2023	0	(2)	(2)	0,00
JPM	Erhalt	Crestwood Equity Partners LP	13.000	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	340	06.09.2023	0	(1)	(1)	0,00
MYI	Erhalt	Plains All American Pipeline LP	426.400	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	5.014	18.01.2023	0	(21)	(21)	(0,02)

Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund (Forts.)

Kontrahent	Zahlung/ Erhalt	Wertpapier	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Variabler Zinssatz	Nenn- betrag	Fälligkeits- datum	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Netto- vermögens	
	Erhalt	Enterprise Products Partners LP	34.800	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	\$ 843	12.04.2023	\$ 0	\$ (7)	\$ (7)	(0,01)	
	Erhalt	Western Midstream Partners LP	94.489	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	2.475	12.04.2023	0	51	51	0,05	
	Erhalt	Western Gas Partners LP	68.832	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	1.848	15.11.2023	0	(7)	(7)	(0,01)	
								\$ 0	\$ (124)	\$ (124)	(0,10)

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
MYI	01.2023	\$ 771	€ 723	\$ 1	\$ 0	\$ 1	0,00
SCX	01.2023	CAD 4.268	\$ 3.177	27	0	27	0,02
TOR	01.2023	10.849	8.070	63	0	63	0,06
				\$ 91	\$ 0	\$ 91	0,08

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend und Institutional EUR (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2023	\$ 12	€ 11	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
BPS	01.2023	17	16	0	0	0	0,00
CBK	01.2023	€ 1.974	\$ 2.092	0	(16)	(16)	(0,01)
	01.2023	\$ 17.490	€ 16.860	512	0	512	0,42
JPM	01.2023	789	759	21	0	21	0,02
MBC	01.2023	€ 2.477	\$ 2.620	0	(25)	(25)	(0,02)
	01.2023	\$ 17.453	€ 16.651	326	0	326	0,27
SCX	01.2023	17.007	16.340	439	0	439	0,36
				\$ 1.298	\$ (41)	\$ 1.257	1,04

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilklasse Institutional GBP (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2023	£ 45	\$ 55	\$ 1	\$ 0	\$ 1	0,00
	01.2023	\$ 32	£ 26	0	0	0	0,00
JPM	01.2023	629	521	0	(2)	(2)	0,00
MBC	01.2023	£ 45	\$ 55	1	0	1	0,00
	01.2023	\$ 613	£ 512	3	0	3	0,00
MYI	01.2023	£ 39	\$ 48	1	0	1	0,00
	01.2023	\$ 21	£ 17	0	(1)	(1)	0,00
TOR	01.2023	616	512	0	0	0	0,00
UAG	01.2023	£ 17	\$ 21	0	0	0	0,00
				\$ 6	\$ (3)	\$ 3	0,00

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ 1.210 1,01

Summe Anlagen

\$ 120.813 100,56

Sonstige Aktiva und Passiva

\$ (676) (0,56)

Nettovermögen

\$ 120.137 100,00

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

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

- Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.
- Nullkuponwertpapier.
- Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.
- Mit dem Fonds verbunden.

Barmittel in Höhe von 2.870 USD (31. Dezember 2021: 0 USD) wurden gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. zum 31. Dezember 2022 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 64.970	\$ 41.989	\$ 0	\$ 106.959
Investmentfonds	11.833	0	0	11.833
Pensionsgeschäfte	0	811	0	811
Finanzderivate ⁽³⁾	0	1.210	0	1.210
Summen	\$ 76.803	\$ 44.010	\$ 0	\$ 120.813

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

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 45.541	\$ 45.693	\$ 0	\$ 91.234
Investmentfonds	9.531	0	0	9.531
Finanzderivate ⁽³⁾	0	395	0	395
Summen	\$ 55.072	\$ 46.088	\$ 0	\$ 101.160

⁽¹⁾ Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

⁽²⁾ Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

⁽³⁾ Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung des Marktwerts der außerbörslich gehandelten Finanzderivate und (erhaltenen)/verpfändeten Sicherheiten nach Kontrahenten zum 31. Dezember 2022 und 31. Dezember 2021:

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2022			Zum 31. Dez. 2021		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾
BOA	\$ (129)	\$ 1.610	\$ 1.481	\$ (2)	\$ (400)	\$ (402)
BPS	k. A.	k. A.	k. A.	21	0	21
CBK	488	(370)	118	300	(330)	(30)
FAR	(18)	550	532	(4)	0	(4)
GLM	k. A.	k. A.	k. A.	(1)	0	(1)
JPM	18	0	18	1	0	1
MBC	305	(310)	(5)	k. A.	k. A.	k. A.
MYI	17	710	727	11	(610)	(599)
RBC	k. A.	k. A.	k. A.	68	0	68
SCX	466	(270)	196	85	0	85
TOR	63	0	63	(93)	0	(93)
UAG	k. A.	k. A.	k. A.	9	0	9

⁽¹⁾ Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2022:

	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	54,07	49,88
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	34,95	40,87
Investmentfonds	9,85	9,48
Pensionsgeschäfte	0,68	k. A.
Freiverkehrsinanzderivate	1,01	0,39

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2022 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
Kanada	9,07	9,60
USA	45,00	35,70
Kurzfristige Instrumente	34,95	45,45
Investmentfonds	9,85	9,48
Pensionsgeschäfte	0,68	k. A.
Freiverkehrsinanzderivate		
Total Return Swaps auf Indizes	(0,01)	0,02
Total Return Swaps auf Wertpapiere	(0,10)	0,29
Devisenterminkontrakte	0,08	(0,16)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	1,04	0,24
Sonstige Aktiva und Passiva	(0,56)	(0,62)
Nettovermögen	100,00	100,00

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft ⁽¹⁾	% des Nettovermögens
BPS	4,310 %	30.12.2022	03.01.2023	\$ 13.700	U.S. Treasury Notes 0,625 % fällig am 15.05.2030	\$ (14.004)	\$ 13.700	\$ 13.700	1,61
FICC	1,900	30.12.2022	03.01.2023	3.618	U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 08.06.2023 – 29.06.2023	(3.690)	3.618	3.618	0,43
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (17.694)	\$ 17.318	\$ 17.318	2,04

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
3-Month SOFR December Futures	Short	03.2024	985	\$ 261	0,03
3-Month SOFR June Futures	Long	09.2023	503	15	0,00
3-Month SOFR June Futures	Long	09.2024	340	(191)	(0,02)
3-Month SOFR March Futures	Long	06.2023	820	(145)	(0,02)
3-Month SOFR September Futures	Short	12.2023	338	200	0,02
3-Month SOFR September Futures	Short	12.2024	340	174	0,02
30-Day Fed Fund April Futures	Long	04.2023	54	31	0,00
30-Day Fed Fund June Futures	Short	06.2023	54	(9)	0,00
90-Day Eurodollar March Futures	Short	03.2023	365	4.253	0,50
U.S. Treasury 2-Year Note March Futures	Short	03.2023	573	(40)	0,00
U.S. Treasury 5-Year Note March Futures	Short	03.2023	171	15	0,00
U.S. Treasury 10-Year Note March Futures	Short	03.2023	174	53	0,01
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond March Futures	Short	03.2023	27	(8)	0,00
				\$ 4.609	0,54
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ 4.609	0,54

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

ZINSSWAPS

Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt ⁽¹⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	2,000 %	15.03.2053	£ 400	\$ 5	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2025	\$ 185.600	(4.474)	(0,53)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	21.12.2052	18.400	(830)	(0,10)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,000	21.12.2024	95.900	119	0,02
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,000	21.12.2032	73.400	848	0,10
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,250	18.03.2050	€ 2.400	1.016	0,12
Erhalt ⁽¹⁾	6-Month EUR-EURIBOR	1,750	15.03.2033	13.900	360	0,04
					\$ (2.956)	(0,35)
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					\$ (2.956)	(0,35)

(1) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

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

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

OPTIONSKAUF

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	5,500 %	18.09.2023	88.600	\$ 198	\$ 91	0,01
	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,500	08.06.2023	4.800	19	2	0,00
	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,023	29.06.2023	17.445	928	3.819	0,45
BPS	Call – OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,228	06.02.2023	5.900	63	15	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,500	05.02.2024	76.000	509	2.835	0,33
	Put – OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,513	06.03.2023	6.000	45	96	0,01
	Call – OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,800	20.12.2023	5.300	107	87	0,01
	Put – OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,550	20.12.2023	15.800	320	417	0,05
BRC	Call – OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,800	20.12.2023	5.200	107	85	0,01
	Put – OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,550	20.12.2023	15.800	319	417	0,05
CBK	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,400	19.05.2027	13.900	79	130	0,02

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Mortgage Opportunities Fund (Forts.)

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Kosten	Markt-wert	% des Netto-vernögens
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,500 %	09.02.2024	24.700	\$ 179	\$ 926	0,11
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,500	20.02.2024	61.000	530	2.301	0,27
	Put – OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,034	28.02.2023	57.500	362	2.535	0,30
	Put – OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,880	01.03.2023	18.400	114	863	0,10
	Put – OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,933	01.03.2023	57.500	362	2.640	0,31
	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,380	06.04.2023	7.100	150	209	0,03
	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,285	14.04.2023	7.000	166	262	0,03
DUB	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,720	06.03.2023	700	8	8	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,500	07.02.2024	77.500	554	2.899	0,34
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,500	28.02.2024	35.500	288	1.348	0,16
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,500	04.03.2024	35.500	259	1.352	0,16
	Call – OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,120	06.02.2023	700	8	1	0,00
	Put – OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,518	06.02.2023	31.500	273	412	0,05
	Put – OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,533	06.02.2023	8.900	76	112	0,01
	Put – OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,513	06.03.2023	6.000	44	97	0,01
GLM	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	5,500	18.09.2023	85.600	188	88	0,01
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,400	19.05.2027	20.000	107	188	0,02
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	4,000	26.10.2023	2.200	66	43	0,01
	Call – OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,123	06.02.2023	6.100	69	10	0,00
	Call – OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,655	12.12.2023	21.200	462	285	0,03
	Put – OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,405	12.12.2023	21.200	462	637	0,08
JPM	Put – OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,635	06.03.2023	5.400	42	67	0,01
MYC	Put – OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,998	07.03.2023	56.100	406	2.496	0,29
	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,348	13.04.2023	7.000	140	228	0,03
	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,225	20.04.2023	6.800	166	294	0,04
	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,273	20.04.2023	6.800	151	268	0,03
	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,200	21.04.2023	7.500	220	342	0,04
	Call – OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,203	06.02.2023	6.800	73	16	0,00
	Put – OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,515	06.02.2023	8.100	69	107	0,01
							\$ 8.688	\$ 29.028	3,42

OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
JPM	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.01.2053	\$ 117,000	05.01.2023	147.000	\$ 6	\$ 0	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.02.2053	100,000	06.02.2023	20.000	1	0	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.02.2053	75,000	06.02.2023	70.000	2	0	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fällig am 01.02.2053	65,000	06.02.2023	25.500	1	0	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fällig am 01.03.2053	77,000	06.03.2023	70.000	3	1	0,00
					\$ 13	\$ 1	0,00

VERKAUFSOPTIONEN

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Netto-vernögens
BOA	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	5,750 %	18.09.2023	44.300	\$ (78)	\$ (31)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	6,000	18.09.2023	44.300	(66)	(21)	0,00
	Put – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,021	29.06.2023	85.485	(928)	(6.704)	(0,79)
CBK	Call – OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,534	28.02.2023	57.500	(334)	0	0,00
	Call – OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,380	01.03.2023	18.400	(106)	0	0,00
	Call – OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,433	01.03.2023	57.500	(336)	0	0,00
	Put – OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	06.04.2023	39.600	(150)	(477)	(0,06)
	Put – OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	14.04.2023	38.900	(167)	(465)	(0,06)
GLM	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	5,750	18.09.2023	42.800	(75)	(30)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	6,000	18.09.2023	42.800	(62)	(20)	0,00
MYC	Call – OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	1,498	07.03.2023	56.100	(381)	0	0,00
	Put – OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	13.04.2023	38.900	(140)	(465)	(0,05)
	Put – OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,000	20.04.2023	75.200	(316)	(645)	(0,08)
	Put – OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,000	21.04.2023	41.500	(221)	(356)	(0,04)
							\$ (3.360)	\$ (9.214)	(1,08)

OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Netto-vernögens
BOA	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,000 % fällig am 01.01.2053	\$ 94,031	05.01.2023	8.500	\$ (48)	\$ (42)	(0,01)
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,000 % fällig am 01.01.2053	94,906	05.01.2023	13.000	(53)	(143)	(0,02)
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,000 % fällig am 01.01.2053	95,563	05.01.2023	27.000	(76)	(6)	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,000 % fällig am 01.01.2053	96,906	05.01.2023	13.000	(49)	0	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,000 % fällig am 01.02.2053	94,906	06.02.2023	13.000	(67)	(90)	(0,01)
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.02.2053	99,813	06.02.2023	300	(2)	(2)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.02.2053	99,977	06.02.2023	13.500	(89)	(93)	(0,01)
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.02.2053	100,000	06.02.2023	300	(2)	(2)	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.02.2053	101,813	06.02.2023	300	(2)	(1)	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.02.2053	102,000	06.02.2023	300	(2)	(1)	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.02.2053	102,438	06.02.2023	13.000	(73)	(14)	0,00
JPM	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,000 % fällig am 01.03.2053	95,250	06.03.2023	26.000	(292)	(582)	(0,07)
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.03.2053	97,000	06.03.2023	900	(8)	(14)	0,00

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.03.2053	\$ 97,156	06.03.2023	900	\$ (8)	\$ (15)	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.03.2053	99,000	06.03.2023	900	(7)	(2)	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.03.2053	99,156	06.03.2023	900	(6)	(2)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fällig am 01.03.2053	98,766	06.03.2023	2.700	(23)	(37)	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fällig am 01.03.2053	100,766	06.03.2023	2.700	(19)	(9)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.03.2053	99,766	06.03.2023	6.500	(45)	(65)	(0,01)
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.03.2053	99,781	06.03.2023	6.500	(45)	(65)	(0,01)
MSC	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,000 % fällig am 01.01.2053	94,031	05.01.2023	17.000	(96)	(84)	(0,01)
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,000 % fällig am 01.01.2053	94,703	05.01.2023	1.000	(2)	(1)	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,000 % fällig am 01.01.2053	95,266	05.01.2023	21.000	(75)	(9)	0,00
SAL	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,000 % fällig am 01.01.2053	96,031	05.01.2023	15.000	(80)	(1)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fällig am 01.02.2053	98,563	06.02.2023	9.000	(67)	(82)	(0,01)
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fällig am 01.03.2053	97,578	06.03.2023	500	(4)	(5)	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fällig am 01.03.2053	99,578	06.03.2023	500	(3)	(4)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.02.2053	100,000	06.02.2023	12.300	(81)	(86)	(0,01)
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.02.2053	100,063	06.02.2023	27.000	(177)	(196)	(0,02)
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.02.2053	102,000	06.02.2023	24.800	(142)	(44)	(0,01)
					\$ (1.643)	\$ (1.697)	(0,20)

⁽¹⁾ Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2023	£ 448	\$ 550	\$ 11	\$ 0	\$ 11	0,00
CBK	01.2023	\$ 898	€ 847	6	0	6	0,00
MBC	01.2023	AUD 200	\$ 135	0	0	0	0,00
	01.2023	€ 24.813	25.982	0	(512)	(512)	(0,06)
	01.2023	£ 109.852	133.883	1.722	0	1.722	0,20
	01.2023	\$ 427	€ 402	2	0	2	0,00
MYI	01.2023	AUD 873	\$ 586	0	(6)	(6)	0,00
	01.2023	\$ 21	£ 18	0	0	0	0,00
				\$ 1.741	\$ (518)	\$ 1.223	0,14

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilsklasse Institutional CAD (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2023	\$ 5.714	CAD 7.726	\$ 0	\$ (11)	\$ (11)	0,00
BRC	01.2023	CAD 4	\$ 3	0	0	0	0,00
CBK	01.2023	\$ 4.088	CAD 5.524	0	(11)	(11)	0,00
MBC	01.2023	5.895	7.982	0	(4)	(4)	0,00
MYI	01.2023	24	32	0	0	0	0,00
SCX	01.2023	1.641	2.204	0	(14)	(14)	(0,01)
				\$ 0	\$ (40)	\$ (40)	(0,01)

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional CHF (Hedged) thesaurierend und E CHF (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2023	\$ 1.262	CHF 1.194	\$ 29	\$ 0	\$ 29	0,00
CBK	01.2023	2.128	2.011	47	0	47	0,01
MBC	01.2023	CHF 36	\$ 38	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 20	CHF 19	0	0	0	0,00
MYI	01.2023	CHF 36	\$ 38	0	(1)	(1)	0,00
	01.2023	\$ 27	CHF 25	0	0	0	0,00
				\$ 76	\$ (1)	\$ 75	0,01

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend und E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2023	\$ 260	€ 247	\$ 3	\$ 0	\$ 3	0,00
BPS	01.2023	€ 619	\$ 661	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 27	€ 25	0	0	0	0,00
CBK	01.2023	€ 5.744	\$ 6.104	0	(29)	(29)	0,00
	01.2023	€ 78.035	75.239	2.298	0	2.298	0,27
CLY	01.2023	2.878	2.705	11	0	11	0,00
MBC	01.2023	€ 289	\$ 305	0	(4)	(4)	0,00
	01.2023	\$ 79.195	€ 75.549	1.470	0	1.470	0,17
SCX	01.2023	76.925	73.906	1.985	0	1.985	0,24
				\$ 5.767	\$ (33)	\$ 5.734	0,68

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Mortgage Opportunities Fund (Forts.)

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend und Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2023	£ 49	\$ 59	\$ 1	\$ 0	\$ 1	0,00
BRC	01.2023	18	21	0	0	0	0,00
JPM	01.2023	\$ 5.467	£ 4.527	0	(20)	(20)	0,00
MBC	01.2023	£ 89	\$ 109	1	0	1	0,00
	01.2023	\$ 5.552	£ 4.633	24	(2)	22	0,00
MYI	01.2023	£ 34	\$ 42	1	0	1	0,00
TOR	01.2023	\$ 5.442	£ 4.526	4	0	4	0,00
UAG	01.2023	£ 5	\$ 6	0	0	0	0,00
				\$ 31	\$ (22)	\$ 9	0,00

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilklasse E SGD (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2023	\$ 126	SGD 173	\$ 3	\$ 0	\$ 3	0,00
BPS	01.2023	SGD 0	\$ 0	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 129	SGD 177	3	0	3	0,00
BRC	01.2023	SGD 221	\$ 163	0	(2)	(2)	0,00
	01.2023	\$ 3	SGD 4	0	0	0	0,00
GLM	01.2023	18	24	0	0	0	0,00
MBC	01.2023	SGD 342	\$ 254	0	(1)	(1)	0,00
	01.2023	\$ 135	SGD 185	3	0	3	0,00
				\$ 9	\$ (3)	\$ 6	0,00

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ 25.125 2,96

LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN			
Ginnie Mae, TBA			
2,000 % fällig am 01.02.2053	\$ 7.900	\$ (6.629)	(0,78)
2,500 % fällig am 01.01.2053	11.500	(9.969)	(1,17)
4,000 % fällig am 01.01.2053	4.800	(4.543)	(0,54)
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA			
2,000 % fällig am 01.01.2038	27.900	(24.818)	(2,92)
2,000 % fällig am 01.01.2053	63.550	(51.725)	(6,09)
2,000 % fällig am 01.02.2053	198.000	(161.328)	(19,00)
2,500 % fällig am 01.01.2053 (g)	15.000	(12.705)	(1,50)
3,000 % fällig am 01.01.2038	2.000	(1.873)	(0,22)
3,000 % fällig am 01.02.2053	170.650	(149.936)	(17,66)
3,500 % fällig am 01.01.2053	3.500	(3.180)	(0,37)
4,000 % fällig am 01.01.2038	3.700	(3.607)	(0,43)
4,000 % fällig am 01.01.2053	32.200	(30.203)	(3,56)
4,500 % fällig am 01.01.2053	4.250	(4.091)	(0,48)
5,000 % fällig am 01.02.2053	54.400	(53.605)	(6,31)
Summe Leerverkaufte Wertpapiere	\$	(518.212)	(61,03)
Summe Anlagen	\$	1.250.906	147,31
Sonstige Aktiva und Passiva	\$	(401.758)	(47,31)
Nettovermögen	\$	849.148	100,00

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

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

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.

(b) Reines Kapitalwertpapier.

(c) Nullkuponwertpapier.

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

(e) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

(f) Mit dem Fonds verbunden.

(g) Zum 31. Dezember 2022 leerverkaufte Wertpapiere sind durch langfristige Portfolioanlagen in übertragbaren Wertpapieren und Geldmarktinstrumenten abgedeckt.

(h) Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von 324.164 USD (31. Dezember 2021: 375.312 USD) wurden gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen zum 31. Dezember 2022 als Sicherheiten verpfändet.

Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von 0 USD (31. Dezember 2021: 94 USD) und Barmittel in Höhe von 4.656 USD (31. Dezember 2021: 0 USD) wurden gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen zum 31. Dezember 2022 als Sicherheiten erhalten.

Wertpapier mit einem Gesamtmarktwert von 0 USD (31. Dezember 2021: 664 USD) und Barmittel in Höhe von 4.327 USD (31. Dezember 2021: 26.671 USD) wurden zum 31. Dezember 2022 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 4.020 USD (31. Dezember 2021: 2.840 USD) wurden gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. zum 31. Dezember 2022 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 1.723.820	\$ 1.179	\$ 1.724.999
Investmentfonds	23	0	0	23
Pensionsgeschäfte	0	17.318	0	17.318
Finanzderivate ⁽³⁾	0	26.778	0	26.778
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(518.212)	0	(518.212)
Summen	\$ 23	\$ 1.249.704	\$ 1.179	\$ 1.250.906

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

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 2.953.139	\$ 1.459	\$ 2.954.598
Investmentfonds	93.049	0	0	93.049
Pensionsgeschäfte	0	2.125	0	2.125
Finanzderivate ⁽³⁾	1.373	35.920	0	37.293
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(640.730)	0	(640.730)
Summen	\$ 94.422	\$ 2.350.454	\$ 1.459	\$ 2.446.335

⁽¹⁾ Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

⁽²⁾ Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

⁽³⁾ Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions- geschäften		% des Nettovermögens
					\$	(31,10)	
CIB	4,460 %	13.12.2022	12.01.2023	\$ (263.491)	\$ (264.111)	(31,10)	
JPS	4,820	03.11.2022	06.02.2023	(718)	(724)	(0,09)	
RCY	4,480	13.12.2022	12.01.2023	(23.137)	(23.192)	(2,73)	
SCX	2,310	14.11.2022	16.02.2023	€ (26.592)	(28.466)	(3,35)	
Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte					\$ (316.493)	(37,27)	

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung des Marktwerts der außerbörslich gehandelten Finanzderivate und (erhaltenen)/verpfändeten Sicherheiten nach Kontrahenten zum 31. Dezember 2022 und 31. Dezember 2021:

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2022			Zum 31. Dez. 2021		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Nettoengagement ⁽¹⁾
BOA	\$ (3.187)	\$ 2.810	\$ (377)	\$ (352)	\$ 460	\$ 108
BPS	3.438	(3.310)	128	3.572	(2.870)	702
BRC	500	(480)	20	8	0	8
CBK	11.235	(10.950)	285	(465)	0	(465)
CLY	11	0	11	k. A.	k. A.	k. A.
DUB	6.229	(5.990)	239	k. A.	k. A.	k. A.
FBF	k. A.	k. A.	k. A.	67	(220)	(153)
GLM	1.201	(1.080)	121	(395)	610	215
GSC	k. A.	k. A.	k. A.	(30)	0	(30)
GST	k. A.	k. A.	k. A.	151	0	151
HUS	k. A.	k. A.	k. A.	(2.383)	1.750	(633)
JPM	(743)	730	(13)	395	(280)	115
JPS	k. A.	k. A.	k. A.	(5)	(650)	(655)
MBC	2.699	(2.490)	209	k. A.	k. A.	k. A.
MSC	(94)	0	(94)	k. A.	k. A.	k. A.
MYC	2.285	(2.410)	(125)	2.940	(3.626)	(686)
MYI	(6)	0	(6)	70	20	90
RBC	k. A.	k. A.	k. A.	1.093	(710)	383

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Mortgage Opportunities Fund (Forts.)

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2022			Zum 31. Dez. 2021		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Nettoengagement ⁽¹⁾	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Nettoengagement ⁽¹⁾
SAL	\$ (418)	\$ 480	\$ 62	\$ 679	\$ (550)	\$ 129
SCX	1.971	(1.850)	121	5.399	(4.320)	1.079
TOR	4	0	4	1.214	(950)	264
UAG	k. A.	k. A.	k. A.	2.361	(1.570)	791

⁽¹⁾ Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2022:

	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	25,41	21,88
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	174,84	108,20
Sonstige übertragbare Wertpapiere	2,90	1,91
Investmentfonds	0,00	4,16
Pensionsgeschäfte	2,04	0,09
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,54	0,12
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,35)	0,91
Freiverkehrsfinanzderivate	2,96	0,64
Leerverkaufte Wertpapiere	(61,03)	(28,62)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(37,27)	(16,26)

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2022 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
Unternehmensanleihen und Wechsel	0,10	0,85
Kommunalanleihen und Wechsel	k. A.	0,06
US-Regierungsbehörden	121,51	76,22
US-Schatzobligationen	0,51	0,13
Non-Agency-MBS	37,20	26,71
Forderungsbesicherte Wertpapiere	35,71	28,02
Kurzfristige Instrumente	8,12	k. A.
Investmentfonds	0,00	4,16
Pensionsgeschäfte	2,04	0,09
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,54	0,12
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Zinsswaps	(0,35)	0,91
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Zinsswapoptionen	3,42	0,28
Optionen auf Wertpapiere	0,00	0,15
Verkaufsoptionen		
Zinsswapoptionen	(1,08)	(0,21)
Optionen auf Wertpapiere	(0,20)	(0,13)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	k. A.	0,06
Zinsswaps	k. A.	0,00
Devisenterminkontrakte	0,14	(0,16)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,68	0,65
Leerverkaufte Wertpapiere	(61,03)	(28,62)
Sonstige Aktiva und Passiva	(47,31)	(9,29)
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust				KURZFRISTIGE INSTRUMENTE				INVESTMENTFONDS			
4,659 % fällig am 25.03.2036	\$ 1.581	\$ 1.447	0,14	KURZFRISTIGE SCHULDITITEL				ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN			
4,699 % fällig am 25.08.2046	3.471	3.220	0,32	Federal Home Loan Bank				PIMCO Select Funds plc –			
4,709 % fällig am 25.10.2036	1.692	1.148	0,11	4,310 % fällig am 03.01.2023	\$ 15.400	\$ 15.400	1,53	PIMCO US Dollar Short- Term Floating NAV Fund (e)	9.317.030	\$ 92.742	9,19
4,809 % fällig am 25.02.2037	1.413	1.362	0,14	4,310 % fällig am 04.01.2023	15.800	15.600	1,54				
Toro European CLO DAC				4,310 % fällig am 25.01.2023	13.900	13.901	1,38				
2,572 % fällig am 15.02.2034	€ 5.100	5.250	0,52	4,320 % fällig am 06.01.2023	11.000	11.000	1,09				
Washington Mutual Asset-Backed Certificates Trust						55.901	5,54	Summe Investmentfonds		\$ 92.742	9,19
4,699 % fällig am 25.08.2036	\$ 949	885	0,09	U.S. TREASURY BILLS							
Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust				3,998 % fällig am 19.01.2023 (c)(d)	96.400	96.245	9,54				
4,884 % fällig am 25.05.2036	510	506	0,05	Summe kurzfristige Instrumente		152.146	15,08				
		230.507	22,85	Summe Übertragbare Wertpapiere		\$ 711.694	70,55				

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kapital- betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions- geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions- geschäft ⁽¹⁾	% des Nettovermögens
BOS	4,330 %	30.12.2022	03.01.2023	\$ 20.300	U.S. Treasury Bonds 4,625 % fällig am 15.02.2040	\$ (20.745)	\$ 20.300	\$ 20.310	2,01
FICC	1,900	30.12.2022	03.01.2023	14.743	U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 08.06.2023	(15.038)	14.743	14.745	1,46
NOM	4,320	30.12.2022	03.01.2023	60.000	U.S. Treasury Bonds 2,500 % fällig am 15.02.2046	(61.297)	60.000	60.029	5,95
SGY	4,290	30.12.2022	03.01.2023	24.500	U.S. Treasury Bonds 3,250 % fällig am 15.05.2042	(24.971)	24.500	24.512	2,43
TOR	4,080	21.12.2022	04.01.2023	CAD 50.000	Province of Ontario Canada 2,150 % fällig am 02.06.2031	(36.902)	36.902	36.980	3,67
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (158.953)	\$ 156.445	\$ 156.576	15,52

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
E-mini S&P 500 Index March Futures	Long	03.2023	2.046	\$ (14.689)	(1,46)
Euro-Bund 10-Year Bond March Futures	Short	03.2023	55	503	0,05
U.S. Treasury 2-Year Note March Futures	Short	03.2023	95	92	0,01
U.S. Treasury 5-Year Note March Futures	Long	03.2023	137	(133)	(0,01)
U.S. Treasury 10-Year Note March Futures	Short	03.2023	412	125	0,01
United Kingdom Long Gilt March Futures	Short	03.2023	6	47	0,01
				\$ (14.055)	(1,39)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ (14.055)	(1,39)

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽³⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AT&T, Inc.	1,000 %	20.12.2023	\$ 6.300	\$ (70)	(0,01)
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2026	3.200	(53)	(0,01)
AT&T, Inc.	1,000	20.12.2026	1.100	(18)	0,00
Boeing Co.	1,000	20.06.2023	7.400	(16)	0,00
Boeing Co.	1,000	20.12.2023	6.800	(36)	0,00
Boeing Co.	1,000	20.06.2026	1.800	(4)	0,00
Credit Suisse Group AG	1,000	20.12.2023	€ 9.800	0	0,00
Exelon Generation Co. LLC	1,000	20.12.2024	\$ 800	2	0,00
General Electric Co.	1,000	20.06.2026	1.700	(3)	0,00
General Electric Co.	1,000	20.12.2026	3.700	(23)	0,00
Stellantis NV	5,000	20.06.2026	€ 5.600	(576)	(0,06)
Stellantis NV	5,000	20.12.2026	1.800	(170)	(0,02)
				\$ (967)	(0,10)

Aufstellung der Wertpapieranlagen des StocksPLUS™ Fund (Forts.)

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF⁽²⁾

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽³⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.HY-38 5-Year Index	(5,000) %	20.06.2027	\$ 59.499	\$ (2.798)	(0,28)
CDX.HY-39 5-Year Index	(5,000)	20.12.2027	9.800	(198)	(0,02)
				\$ (2.996)	(0,30)

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽³⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.IG-38 5-Year Index	1,000 %	20.12.2027	\$ 58.800	\$ (14)	0,00
iTraxx Asia Ex-Japan 38 5-Year Index	1,000	20.12.2027	80	1	0,00
				\$ (13)	0,00

ZINSSWAPS

Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750 %	15.06.2024	\$ 290.800	\$ (2.252)	(0,22)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2027	26.000	(332)	(0,03)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2032	54.600	1.118	0,11
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,875	07.02.2050	300	138	0,01
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,000	15.01.2050	900	423	0,04
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,000	20.03.2050	1.900	890	0,09
Erhalt	CPURNSA	2,418	11.07.2052	11.000	294	0,03
					\$ 279	0,03
					\$ (3.697)	(0,37)

Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate

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

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

⁽³⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definieren.

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

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

TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES

Kontrahent	Zahlung/Erhalt	Wertpapier	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Variabler Zinssatz	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
FAR	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	677	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	\$ 5.537	10.05.2023	\$ 0	\$ (21)	\$ (21)	0,00
	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	32.517	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	265.925	21.06.2023	0	(1.035)	(1.035)	(0,10)
	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	2.731	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	22.334	02.08.2023	0	(87)	(87)	(0,01)
	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	167	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	1.366	15.11.2023	0	(5)	(5)	0,00
MBC	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	3.736	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	30.553	07.06.2023	0	(120)	(120)	(0,01)
RBC	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	493	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	4.032	22.02.2023	0	(16)	(16)	0,00
	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	680	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	5.561	17.05.2023	0	(22)	(22)	0,00
	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	7.270	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	59.454	24.05.2023	0	(233)	(233)	(0,03)
	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	24.342	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	199.069	19.07.2023	0	(779)	(779)	(0,08)
UBS	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	398	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	3.255	26.07.2023	0	(13)	(13)	0,00
	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	1.109	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	9.069	13.09.2023	0	(35)	(35)	(0,01)
							\$ 0	\$ (2.366)	\$ (2.366)	(0,24)

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	01.2023	\$ 553	€ 519	\$ 1	\$ 0	\$ 1	0,00
	02.2023	62	ZAR 1.121	3	0	3	0,00
BRC	01.2023	1.715	€ 1.613	7	0	7	0,00
CBK	01.2023	€ 25.203	\$ 26.683	0	(226)	(226)	(0,02)
	01.2023	ILS 5.099	1.618	173	0	173	0,02
	01.2023	\$ 40	BRL 208	0	0	0	0,00
	01.2023	3.855	€ 3.668	61	0	61	0,01
GLM	03.2023	371	MXN 7.281	0	(3)	(3)	0,00
	01.2023	BRL 208	\$ 40	1	0	1	0,00
	01.2023	CAD 50.078	36.789	0	(170)	(170)	(0,02)
	02.2023	\$ 40	BRL 208	0	(1)	(1)	0,00
	03.2023	MXN 7.067	\$ 344	0	(14)	(14)	0,00
	05.2023	\$ 8	ZAR 132	0	0	0	0,00
JPM	01.2023	£ 54.271	\$ 65.534	241	0	241	0,02
	01.2023	\$ 19.124	€ 18.391	512	0	512	0,05
MBC	01.2023	CAD 227	\$ 169	2	0	2	0,00
	01.2023	€ 216.323	226.722	0	(4.247)	(4.247)	(0,42)
	01.2023	\$ 54.722	€ 52.261	1.077	0	1.077	0,11
	01.2023	30.284	£ 24.848	0	(389)	(389)	(0,04)
	01.2023	1.525	ILS 5.077	0	(86)	(86)	(0,01)
MYI	01.2023	€ 665	\$ 710	0	(1)	(1)	0,00
	01.2023	SGD 10	7	0	0	0	0,00
SCX	01.2023	NZD 212	132	0	(2)	(2)	0,00
	02.2023	\$ 34	TWD 1.057	0	0	0	0,00
				\$ 2.078	\$ (5.139)	\$ (3.061)	(0,30)

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend und E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	01.2023	€ 31.481	\$ 32.960	\$ 0	\$ (653)	\$ (653)	(0,06)
BOA	01.2023	27.599	29.038	0	(430)	(430)	(0,04)
BPS	01.2023	\$ 440	€ 413	0	0	0	0,00
CBK	01.2023	€ 13.479	\$ 14.323	0	(68)	(68)	(0,01)
	01.2023	\$ 96.382	€ 92.808	2.710	0	2.710	0,27
CLY	01.2023	€ 13.440	\$ 14.296	0	(53)	(53)	(0,01)
MBC	01.2023	1.588	1.695	0	(1)	(1)	0,00
	01.2023	\$ 96.270	€ 91.853	1.802	0	1.802	0,18
MYI	01.2023	€ 16.698	\$ 17.610	0	(218)	(218)	(0,02)
SCX	01.2023	\$ 93.880	€ 90.195	2.422	0	2.422	0,24
				\$ 6.934	\$ (1.423)	\$ 5.511	0,55

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilsklasse Institutional GBP (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2023	£ 34	\$ 42	\$ 1	\$ 0	\$ 1	0,00
	01.2023	\$ 1.621	£ 1.347	0	(1)	(1)	0,00
BRC	01.2023	£ 41	\$ 50	0	0	0	0,00
MBC	01.2023	70	85	1	0	1	0,00
	01.2023	\$ 1.616	£ 1.349	7	0	7	0,00
MYI	01.2023	259	211	0	(5)	(5)	0,00
UAG	01.2023	1.522	1.267	2	0	2	0,00
				\$ 11	\$ (6)	\$ 5	0,00

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilsklasse Institutional SGD (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2023	\$ 78	SGD 108	\$ 2	\$ 0	\$ 2	0,00
BRC	01.2023	SGD 9	\$ 7	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 89	SGD 121	2	0	2	0,00
MBC	01.2023	SGD 5	\$ 4	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 92	SGD 125	1	0	1	0,00
SCX	01.2023	SGD 6	\$ 4	0	0	0	0,00
				\$ 5	\$ 0	\$ 5	0,00

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ 94 0,01

Summe Anlagen

\$ 943.223 93,51

Sonstige Aktiva und Passiva

\$ 65.516 6,49

Nettovermögen

\$ 1.008.739 100,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des StocksPLUS™ Fund (Forts.)

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

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

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.

(b) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.

(c) Nullkuponwertpapier.

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

(e) Mit dem Fonds verbunden.

Barmittel in Höhe von 45.395 USD (31. Dezember 2021: 119.116 USD) wurden zum 31. Dezember 2022 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von 0 USD (31. Dezember 2021: 4.781 USD) und Barmittel in Höhe von 40.550 USD (31. Dezember 2021: 0 USD) wurden gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. zum 31. Dezember 2022 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 711.694	\$ 0	\$ 711.694
Investmentfonds	92.742	0	0	92.742
Pensionsgeschäfte	0	156.445	0	156.445
Finanzderivate ⁽³⁾	(14.139)	(3.519)	0	(17.658)
Summen	\$ 78.603	\$ 864.620	\$ 0	\$ 943.223

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

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 30.009	\$ 2.312.617	\$ 0	\$ 2.342.626
Investmentfonds	342.388	0	0	342.388
Pensionsgeschäfte	0	1.471.512	0	1.471.512
Finanzderivate ⁽³⁾	29.744	39.536	0	69.280
Summen	\$ 402.141	\$ 3.823.665	\$ 0	\$ 4.225.806

⁽¹⁾ Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

⁽²⁾ Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

⁽³⁾ Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung des Marktwerts der außerbörslich gehandelten Finanzderivate und (erhaltenen)/verpfändeten Sicherheiten nach Kontrahenten zum 31. Dezember 2022 und 31. Dezember 2021:

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2022			Zum 31. Dez. 2021		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Nettoengagement ⁽¹⁾
AZD	\$ (653)	\$ 580	\$ (73)	\$ k. A.	\$ k. A.	\$ k. A.
BOA	(428)	290	(138)	404	0	404
BPS	4	0	4	(1)	(90)	(91)
BRC	9	0	9	10	1	11
CBK	2.647	(2.506)	141	3.318	(24.685)	(21.367)
CLY	(53)	0	(53)	k. A.	k. A.	k. A.
DUB	k. A.	k. A.	k. A.	(23)	0	(23)
FAR	(1.148)	18.390	17.242	19.666	(33.480)	(13.814)
GLM	(184)	0	(184)	2.661	(2.650)	11
GST	k. A.	k. A.	k. A.	(22)	(2.240)	(2.262)
HUS	k. A.	k. A.	k. A.	1.637	(1.870)	(233)
JPM	753	(700)	53	(6)	0	(6)
MBC	(1.953)	3.760	1.807	k. A.	k. A.	k. A.
MYC	k. A.	k. A.	k. A.	(13)	(860)	(873)
MYI	(224)	0	(224)	31	5	36
RBC	(1.063)	16.910	15.847	18.153	(35.390)	(17.237)
SCX	2.420	(2.270)	150	(5.902)	4.775	(1.127)
TOR	k. A.	k. A.	k. A.	1.959	(1.230)	729
UAG	2	620	622	9.319	(9.600)	(281)
UBS	(35)	0	(35)	k. A.	k. A.	k. A.

⁽¹⁾ Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2022:

	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	33,61	30,73
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	35,70	31,01
Sonstige übertragbare Wertpapiere	1,24	0,55
Investmentfonds	9,19	9,10
Pensionsgeschäfte	15,52	39,12
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(1,39)	0,77
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,37)	(0,29)
Freiverkehrsfinanzderivate	0,01	1,36

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2022 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
Unternehmensanleihen und Wechsel	6,99	10,86
US-Regierungsbehörden	0,59	0,52
US-Schatzobligationen	k. A.	5,39
Non-Agency-MBS	25,04	10,74
Forderungsbesicherte Wertpapiere	22,85	12,05
Stammaktien	k. A.	0,80
Staatsemissionen	k. A.	0,20
Kurzfristige Instrumente	15,08	21,73
Investmentfonds	9,19	9,10
Pensionsgeschäfte	15,52	39,12
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(1,39)	0,77
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf	(0,10)	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	(0,30)	k. A.
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,00	0,01
Zinsswaps	0,03	(0,30)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Verkaufsoptionen		
Zinsswapoptionen	k. A.	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf	k. A.	0,00
Total Return Swaps auf Indizes	(0,24)	1,41
Devisenterminkontrakte	(0,30)	(0,20)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,55	0,15
Sonstige Aktiva und Passiva	6,49	(12,35)
Nettovermögen	100,00	100,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO StocksPLUS™ AR Fund

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE				FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				KURZFRISTIGE INSTRUMENTE				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSELBANKEN UND FINANZEN				Ares European CLO DAC				HUNGARY TREASURY BILLS				
Avolon Holdings Funding Ltd. 2,528 % fällig am 18.11.2027	\$ 43	\$ 34	0,36	2,038 % fällig am 15.10.2030	€ 100	104	1,09	18,250 % fällig am 03.01.2023 (a)(b)	HUF 18.000	48	0,50	
CPI Property Group S.A. 2,750 % fällig am 12.05.2026	€ 100	84	0,88	Armada Euro CLO DAC 2,098 % fällig am 15.07.2031	100	104	1,09	ISRAEL TREASURY BILLS				
Goldman Sachs Group, Inc. 6,162 % fällig am 15.03.2028	\$ 100	98	1,03	Avoca CLO DAC 2,068 % fällig am 15.07.2030	87	91	0,96	0,022 % fällig am 04.01.2023 (a)(b)	ILS 100	28	0,30	
Nissan Motor Acceptance Co. LLC 2,750 % fällig am 09.03.2028	50	41	0,43	Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust 4,709 % fällig am 25.08.2036	\$ 84	81	0,85	JAPAN TREASURY BILLS				
Nykredit Realkredit A/S 1,500 % fällig am 01.10.2053	DKK 783	87	0,91	5,639 % fällig am 25.08.2037	17	17	0,18	(0,251) % fällig am 11.01.2023 (a)(b)	¥ 20.900	159	1,67	
VICI Properties LP 3,750 % fällig am 15.02.2027	\$ 100	91	0,96	Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC 2,338 % fällig am 16.01.2033	€ 100	103	1,08	(0,228) % fällig am 11.01.2023 (a)(b)	9.100	69	0,72	
Wells Fargo & Co. 1,338 % fällig am 04.05.2025	€ 100	103	1,08	Contego CLO DAC 2,142 % fällig am 23.01.2030	100	104	1,09	(0,160) % fällig am 30.01.2023 (a)(b)	30.000	227	2,38	
		538	5,65	Fremont Home Loan Trust 5,004 % fällig am 25.11.2035	\$ 100	87	0,91	(0,159) % fällig am 23.01.2023 (a)(b)	30.000	227	2,38	
				Griffith Park CLO DAC 2,522 % fällig am 21.11.2031	€ 100	103	1,08	(0,147) % fällig am 06.02.2023 (a)(b)	20.000	152	1,60	
				GSAA Home Equity Trust 6,264 % fällig am 25.02.2035	\$ 100	95	1,00	(0,138) % fällig am 06.02.2023 (a)(b)	10.000	76	0,80	
				GSAMP Trust 4,529 % fällig am 25.12.2036	143	78	0,82			910	9,55	
				Home Equity Loan Trust 4,619 % fällig am 25.04.2037	77	74	0,78	U.S. TREASURY BILLS				
				HSI Asset Securitization Corp. Trust 5,169 % fällig am 25.01.2036	100	86	0,90	4,290 % fällig am 09.03.2023 (a)(b)	\$ 2.300	2.283	23,95	
				JPMorgan Mortgage Acquisition Trust 4,599 % fällig am 25.10.2036	28	28	0,29	Summe kurzfristige Instrumente			3.269 34,30	
				Jubilee CLO DAC 1,988 % fällig am 15.04.2030	€ 100	104	1,09	Summe Übertragbare Wertpapiere			\$ 7.750 81,33	
								AKTIEN				
								INVESTMENTFONDS				
								ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN				
								PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (d)				53.037 528 5,54
								BÖRSEGEHANDELTE FONDS				
								PIMCO ETFs plc – PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (d)				3.800 376 3,95
								Summe Investmentfonds				\$ 904 9,49

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft ⁽¹⁾	% des Nettovermögens
BPS	4,310 %	30.12.2022	03.01.2023	\$ 1.200	U.S. Treasury Notes 0,625 % fällig am 15.05.2030	\$ (1.227)	\$ 1.200	\$ 1.201	12,59
SSB	1,900	30.12.2022	03.01.2023	174	U.S. Treasury Notes 1,875 % fällig am 30.06.2026	(178)	174	174	1,83
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (1.405)	\$ 1.374	\$ 1.375	14,42

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Euro-Bund 10-Year Bond March Futures	Short	03.2023	1	\$ 9	0,10
U.S. Treasury 2-Year Note March Futures	Long	03.2023	3	0	0,00
U.S. Treasury 5-Year Note March Futures	Short	03.2023	4	1	0,01
U.S. Treasury 10-Year Note March Futures	Long	03.2023	14	(16)	(0,17)
U.S. Treasury 30-Year Bond March Futures	Long	03.2023	1	(1)	(0,01)
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond March Futures	Short	03.2023	1	0	0,00
				\$ (7)	(0,07)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ (7)	(0,07)

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.EM-38 5-Year Index	1,000 %	20.12.2027	\$ 100	\$ 3	0,02
CDX.HY-39 5-Year Index	5,000	20.12.2027	200	10	0,11
CDX.IG-39 5-Year Index	1,000	20.12.2027	4.100	31	0,33
				\$ 44	0,46

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750 %	15.06.2027	\$ 200	\$ 9	0,09
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2032	200	9	0,09
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,407	21.07.2024	200	(15)	(0,15)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,500	16.06.2028	200	(23)	(0,25)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,740	15.02.2027	100	(13)	(0,14)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,000	16.12.2025	350	(39)	(0,40)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,000	16.12.2027	300	47	0,50
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,250	17.06.2030	100	24	0,25
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,250	16.06.2051	100	22	0,23
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,277	21.07.2031	200	38	0,40
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,500	18.12.2029	200	24	0,25
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,500	18.12.2024	100	10	0,11
Erhalt ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	1,500	15.03.2053	€ 100	8	0,08
Zahlung ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	1,750	15.03.2033	300	(9)	(0,09)
					\$ 92	0,97
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate				\$ 136	1,43	

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

⁽²⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definieren.

⁽³⁾ Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

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

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

TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES

Kontrahent	Zahlung/Erhalt	Wertpapier	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Variabler Zinssatz	Nenn- betrag	Fälligkeits- datum	Gezahlt/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettovermögens
BRC	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	111	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	\$ 908	04.10.2023	\$ 0	\$ (4)	\$ (4)	(0,04)
FAR	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	170	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	1.390	10.05.2023	0	(5)	(5)	(0,05)
	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	232	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	1.897	02.08.2023	0	(8)	(8)	(0,08)
RBC	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	85	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	695	27.09.2023	0	(3)	(3)	(0,03)
	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	569	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	4.653	22.02.2023	0	(17)	(17)	(0,19)
							\$ 0	\$ (37)	\$ (37)	(0,39)

Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO StocksPLUS™ AR Fund (Forts.)

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermogens
BOA	01.2023	DKK 600	\$ 84	\$ 0	\$ (2)	\$ (2)	(0,02)
	01.2023	¥ 60.000	416	0	(39)	(39)	(0,41)
	02.2023	€ 13	14	0	0	0	0,00
	02.2023	£ 91	107	0	(2)	(2)	(0,02)
BRC	02.2023	\$ 7	€ 7	0	0	0	0,00
	01.2023	HUF 3.983	\$ 10	0	0	0	0,00
CBK	01.2023	BRL 1	0	0	0	0	0,00
	01.2023	ILS 100	32	3	0	3	0,03
CLY	02.2023	PEN 97	24	0	(1)	(1)	(0,01)
	04.2023	\$ 20	PEN 79	1	0	1	0,01
DUB	01.2023	HUF 5.594	\$ 14	0	(1)	(1)	(0,01)
	02.2023	€ 1.357	1.406	0	(47)	(47)	(0,49)
GLM	01.2023	HUF 4.615	12	0	(1)	(1)	(0,01)
	01.2023	\$ 0	BRL 1	0	0	0	0,00
JPM	02.2023	BRL 1	\$ 0	0	0	0	0,00
	03.2023	\$ 3	MXN 52	0	0	0	0,00
MBC	01.2023	HUF 2	\$ 0	0	0	0	0,00
	02.2023	¥ 30.000	208	0	(21)	(21)	(0,22)
MYI	01.2023	DKK 30	4	0	0	0	0,00
	02.2023	\$ 17	£ 14	0	0	0	0,00
RBC	03.2023	0	MXN 0	0	0	0	0,00
	04.2023	MXN 44	\$ 2	0	0	0	0,00
RYL	01.2023	¥ 30.000	202	0	(26)	(26)	(0,27)
	01.2023	\$ 4	PEN 16	0	0	0	0,00
SCX	02.2023	€ 4	\$ 4	0	0	0	0,00
	01.2023	HUF 2.979	8	0	0	0	0,00
UAG							
				\$ 4	\$ (140)	\$ (136)	(1,42)

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 31. Dezember 2022 standen fur die Anteilsklasse Institutional EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermogens
AZD	01.2023	€ 354	\$ 377	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
CBK	01.2023	\$ 116	€ 112	4	0	4	0,04
JPM	01.2023	€ 1	\$ 1	0	0	0	0,00
MBC	01.2023	\$ 122	€ 116	2	0	2	0,02
SCX	01.2023	119	115	3	0	3	0,03
UAG	01.2023	13	12	0	0	0	0,00
				\$ 9	\$ 0	\$ 9	0,09

Zum 31. Dezember 2022 standen fur die Anteilsklasse Institutional GBP (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermogens
BOA	01.2023	£ 2	\$ 2	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
BRC	01.2023	\$ 69	£ 57	0	0	0	0,00
	01.2023	£ 3	\$ 4	0	0	0	0,00
MBC	01.2023	2	3	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 69	£ 58	0	0	0	0,00
MYI	01.2023	12	10	0	0	0	0,00
UAG	01.2023	64	54	0	0	0	0,00
				\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ (164) (1,72)

LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMOGENS
US-REGIERUNGSBEHORDEN			
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA	\$ 300	\$ (244)	(2,56)
2,000 % fallig am 01.01.2053			
2,500 % fallig am 01.01.2053	400	(339)	(3,56)
Summe Leerverkaufte Wertpapiere		\$ (583)	(6,12)
Summe Anlagen		\$ 9.410	98,76
Sonstige Aktiva und Passiva		\$ 118	1,24
Nettovermogen		\$ 9.528	100,00

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

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

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Nullkuponwertpapier.

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

(c) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

(d) Mit dem Fonds verbunden.

Barmittel in Höhe von 221 USD (31. Dezember 2021: 231 USD) wurden zum 31. Dezember 2022 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 640 USD (31. Dezember 2021: 0 USD) wurden gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. zum 31. Dezember 2022 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 7.750	\$ 0	\$ 7.750
Investmentfonds	528	376	0	904
Pensionsgeschäfte	0	1.374	0	1.374
Finanzderivate ⁽³⁾	9	(44)	0	(35)
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(583)	0	(583)
Summen	\$ 537	\$ 8.873	\$ 0	\$ 9.410

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

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 9.467	\$ 0	\$ 9.467
Investmentfonds	1.103	0	0	1.103
Pensionsgeschäfte	0	1.432	0	1.432
Finanzderivate ⁽³⁾	0	195	0	195
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(305)	0	(305)
Summen	\$ 1.103	\$ 10.789	\$ 0	\$ 11.892

⁽¹⁾ Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

⁽²⁾ Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

⁽³⁾ Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung des Marktwerts der außerbörslich gehandelten Finanzderivate und (erhaltenen)/verpfändeten Sicherheiten nach Kontrahenten zum 31. Dezember 2022 und 31. Dezember 2021:

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2022			Zum 31. Dez. 2021		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾
BOA	\$ (43)	\$ 0	\$ (43)	\$ 2	\$ 0	\$ 2
BRC	(4)	80	76	k. A.	k. A.	k. A.
CBK	7	0	7	(1)	0	(1)
CLY	(1)	0	(1)	k. A.	k. A.	k. A.
DUB	(47)	0	(47)	(1)	0	(1)
FAR	(16)	280	264	213	(270)	(57)
GLM	(1)	0	(1)	(1)	0	(1)
GST	k. A.	k. A.	k. A.	(5)	(530)	(535)
HUS	k. A.	k. A.	k. A.	7	0	7
JPM	k. A.	k. A.	k. A.	2	0	2
MBC	(19)	0	(19)	k. A.	k. A.	k. A.
RBC	(17)	280	263	1	0	1
RYL	(26)	0	(26)	k. A.	k. A.	k. A.
SCX	3	0	3	4	0	4

⁽¹⁾ Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2022:

	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	20,10	30,90
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	61,13	48,72
Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	0,10	1,93
Investmentfonds	9,49	9,50
Pensionsgeschäfte	14,42	12,33
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,07)	0,01
Zentral abgerechnete Finanzderivate	1,43	(0,23)
Freiverkehrsfinanzderivate	(1,72)	1,90
Leerverkaufte Wertpapiere	(6,12)	(2,63)

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2022 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
Unternehmensanleihen und Wechsel	8,52	10,05
US-Regierungsbehörden	7,38	6,90
US-Schatzobligationen	1,25	5,34
Non-Agency-MBS	9,36	6,97
Forderungsbesicherte Wertpapiere	20,52	17,70
Staatsemissionen	k. A.	0,20
Kurzfristige Instrumente	34,30	34,39
Investmentfonds	9,49	9,50
Pensionsgeschäfte	14,42	12,33
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,07)	0,01
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,46	(0,01)
Zinsswaps	0,97	(0,22)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Zinsswapoptionen	k. A.	0,05
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaptions auf Kreditindizes	k. A.	0,00
Zinsswapoptionen	k. A.	(0,04)
Total Return Swaps auf Indizes	(0,39)	1,79
Devisenterminkontrakte	(1,42)	0,04
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,09	0,06
Leerverkaufte Wertpapiere	(6,12)	(2,63)
Sonstige Aktiva und Passiva	1,24	(2,43)
Nettovermögen	100,00	100,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Strategic Income Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
4,000 % fällig am 01.01.2053	\$ 2.300		0,43	Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust	\$ 630	\$ 491	0,10	Fieldstone Mortgage Investment Trust	\$ 1.810	\$ 1.066	0,21
4,500 % fällig am 01.01.2053	13.500	13.098	2,59	5,049 % fällig am 25.02.2035				4,256 % fällig am 25.11.2036			
Uniform Mortgage-Backed Security				Countrywide Home Loan Reperforming REMIC Trust	221	200	0,04	First Franklin Mortgage Loan Trust	4.619	4.283	0,85
3,000 % fällig am 01.03.2050	355	315	0,06	Eurosaill PLC				Fremont Home Loan Trust			
3,500 % fällig am 01.04.2048 - 01.02.2050	548	506	0,10	4,211 % fällig am 13.09.2045	£ 3.032	3.515	0,69	4,539 % fällig am 25.01.2037	1.492	682	0,13
4,000 % fällig am 01.08.2039 - 01.05.2047	628	597	0,12	4,461 % fällig am 13.06.2045	1.273	1.514	0,30	GSAMP Trust			
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA				GreenPoint Mortgage Funding Trust				4,759 % fällig am 25.03.2047	9.000	6.704	1,32
2,500 % fällig am 01.01.2053	3.600	3.049	0,60	4,789 % fällig am 25.10.2046	\$ 411	363	0,07	Harley Marine Financing LLC			
3,000 % fällig am 01.01.2038 - 01.02.2053	23.500	20.822	4,11	Grifonas Finance PLC	€ 217	210	0,04	6,682 % fällig am 15.05.2043	86	79	0,02
3,500 % fällig am 01.02.2053	32.950	29.958	5,91	1,264 % fällig am 28.08.2039				Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust			
4,000 % fällig am 01.01.2053	39.400	36.975	7,30	GSMPs Mortgage Loan Trust				4,509 % fällig am 25.04.2037	1.854	1.292	0,26
4,500 % fällig am 01.02.2053	14.400	13.863	2,74	7,058 % fällig am 20.10.2032	\$ 1.459	1.259	0,25	4,549 % fällig am 25.11.2036	3.689	3.158	0,62
5,000 % fällig am 01.01.2053	5.700	5.617	1,11	GSMSC Resecuritization Trust				4,559 % fällig am 25.04.2037	1.920	1.338	0,26
5,500 % fällig am 01.02.2053	4.300	4.310	0,85	3,544 % fällig am 26.04.2037	7.355	2.124	0,42	HSI Asset Securitization Corp. Trust			
6,000 % fällig am 01.01.2053	22.700	23.023	4,55	HomeBanc Mortgage Trust				4,529 % fällig am 25.01.2037	5.125	4.033	0,80
6,500 % fällig am 01.01.2053	100	102	0,02	2,663 % fällig am 25.04.2037	23	20	0,00	Long Beach Mortgage Loan Trust			
		157.747	31,14	JPMorgan Mortgage Trust				4,749 % fällig am 25.03.2046	3.265	2.681	0,53
				3,546 % fällig am 25.08.2036 ^	35	28	0,01	4,989 % fällig am 25.01.2036	2.733	2.446	0,48
				3,850 % fällig am 25.01.2037 ^	88	72	0,01	Madison Avenue Manufactured Housing Contract Trust			
				Legacy Mortgage Asset Trust				7,639 % fällig am 25.03.2032	584	584	0,12
				6,139 % fällig am 28.01.2070	1.703	1.701	0,34	MASTR Asset-Backed Securities Trust			
				MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust				4,909 % fällig am 25.06.2036	374	337	0,07
				5,489 % fällig am 25.09.2037	7.300	3.238	0,64	Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust			
				Morgan Stanley Capital Trust				3,549 % fällig am 25.01.2035	1.009	942	0,19
				6,268 % fällig am 15.07.2035	3.026	2.910	0,57	4,499 % fällig am 25.02.2037	735	358	0,07
				Morgan Stanley Mortgage Loan Trust				4,539 % fällig am 25.02.2037	2.279	1.111	0,22
				4,649 % fällig am 25.04.2035	69	64	0,01	4,639 % fällig am 25.03.2037	8.273	3.741	0,74
				RBSGC Mortgage Loan Trust				New Century Home Equity Loan Trust			
				6,000 % fällig am 25.01.2037 ^	18	15	0,00	5,169 % fällig am 25.03.2035	72	66	0,01
				Sandwell Commercial Finance PLC				6,414 % fällig am 25.05.2034 ^	169	177	0,03
				3,894 % fällig am 30.09.2037	£ 22	21	0,00	Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates			
				Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust				5,709 % fällig am 25.01.2036 ^	5.365	4.881	0,96
				3,448 % fällig am 25.05.2035 ^	\$ 122	93	0,02	Renaissance Home Equity Loan Trust			
				3,637 % fällig am 25.09.2035	58	42	0,01	4,934 % fällig am 25.08.2035	26	25	0,00
				WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust				Saxon Asset Securities Trust			
				2,509 % fällig am 25.12.2046 ^	2.133	1.800	0,36	6,139 % fällig am 25.12.2037	1.856	1.713	0,34
				3,096 % fällig am 25.08.2046	882	673	0,13	Soundview Home Loan Trust			
				Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust				4,854 % fällig am 25.06.2036 ^	7.550	6.460	1,28
				4,466 % fällig am 25.05.2035 ^	305	260	0,05	5,389 % fällig am 25.09.2037	5.880	4.114	0,81
				Wells Fargo Alternative Loan Trust				5,424 % fällig am 25.05.2035	1.216	1.189	0,23
				6,250 % fällig am 25.07.2037 ^	970	813	0,16	Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust			
				Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust				4,729 % fällig am 25.12.2036	127	124	0,02
				4,511 % fällig am 25.10.2036 ^	13	12	0,00	4,889 % fällig am 25.11.2037	2.600	2.284	0,45
						28.845	5,69	5,514 % fällig am 25.07.2035	1.220	1.158	0,23
				FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				TruPS Financials Note Securitization Ltd.			
				ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust				6,316 % fällig am 20.09.2039	1.775	1.686	0,33
				4,869 % fällig am 25.04.2036	6.811	6.143	1,21	Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust			
				Aegis Asset-Backed Securities Trust				4,809 % fällig am 25.03.2037	8	8	0,00
				5,389 % fällig am 25.03.2035 ^	578	535	0,11			84.874	16,75
				Ameriquest Mortgage Securities Trust				STAATSEMISSIONEN			
				4,899 % fällig am 25.04.2036	961	952	0,19	Argentina Government International Bond			
				Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates				0,500 % fällig am 09.07.2030	5.595	1.443	0,29
				5,364 % fällig am 25.07.2035	3.990	3.611	0,71	1,000 % fällig am 09.07.2029	377	101	0,02
				5,364 % fällig am 25.09.2035	1.635	1.268	0,25	1,500 % fällig am 09.07.2035	2.879	680	0,13
				Argent Securities Trust				1,500 % fällig am 09.07.2046	115	30	0,01
				4,689 % fällig am 25.07.2036	5.316	4.598	0,91	15,500 % fällig am 17.10.2026 ARS	3.906	3	0,00
				Asset-Backed Funding Certificates Trust				Argentina Treasury Bond BONCER			
				5,214 % fällig am 25.08.2033	13	13	0,00	1,400 % fällig am 25.03.2023	80.814	245	0,05
				Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust				Australia Government International Bond			
				6,339 % fällig am 25.11.2039	351	347	0,07	1,750 % fällig am 21.06.2051 AUD	2.200	865	0,17
				Castlelake Aircraft Securitization Trust				Autonomous City of Buenos Aires			
				4,125 % fällig am 15.06.2043	600	527	0,10	72,986 % fällig am 22.02.2028 (a) ARS	27.495	78	0,02
				Conseco Finance Corp.				Export-Credit Bank of Turkey			
				6,280 % fällig am 01.09.2030	127	127	0,03	8,250 % fällig am 24.01.2024 \$	200	203	0,04
				Countrywide Asset-Backed Certificates Trust				Israel Government International Bond			
				4,639 % fällig am 25.11.2047 ^	5.057	4.455	0,88	3,800 % fällig am 13.05.2060	2.400	1.888	0,37
				4,649 % fällig am 25.12.2036 ^	2.035	1.866	0,37	Letras de la Nacion Argentina con Ajuste por CER			
				5,454 % fällig am 25.08.2035	1.666	1.657	0,33	0,000 % fällig am 19.05.2023 (d) ARS	154.637	470	0,09
				Credit-Based Asset Servicing & Securitization Trust				Peru Government International Bond			
				3,103 % fällig am 25.01.2037 ^	172	55	0,01	5,350 % fällig am 12.08.2040 PEN	55	11	0,00
								5,400 % fällig am 12.08.2034	83	17	0,00
								5,940 % fällig am 12.02.2029	2.189	527	0,10

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Strategic Income Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
Obayashi Corp. (c)	26.200	\$197	0,04	VERSORGUNGSUNTERNEHMEN				Cousins Properties, Inc.	25.336	641	0,13
Thales S.A.	4.403	561	0,11	EDP - Energias de Portugal S.A.	113.134	562	0,11	Digital Realty Trust, Inc.	6.878	690	0,14
		10.561	2,09	Elior Group S.A.	1.332	\$189	0,04	EPR Properties	18.335	692	0,14
INFORMATIONSTECHNOLOGIE				Endesa S.A.	10.523	198	0,04	Equity Residential	11.957	\$706	0,14
Apple, Inc.	8.491	1.103	0,22	Hydro One Ltd.	6.698	179	0,04	Gaming and Leisure Properties, Inc.	40.207	2.094	0,41
Broadcom, Inc.	3.325	1.859	0,37	Iberdrola S.A. (c)	62.661	729	0,14	Healthcare Realty Trust, Inc.	63.315	1.220	0,24
Cisco Systems, Inc. (c)	81.770	3.896	0,77	NRG Energy, Inc.	9.551	304	0,06	Healthpeak Properties, Inc.	47.665	1.195	0,24
Largan Precision Co. Ltd.	4.000	265	0,05	Red Electrica Corp. S.A. (c)	16.213	281	0,06	Highwoods Properties, Inc.	17.927	502	0,10
Lenovo Group Ltd.	284.000	231	0,04	Snam SpA (c)	80.844	391	0,08	Hudson Pacific Properties, Inc.	120.717	1.175	0,23
MediaTek, Inc.	8.000	162	0,03	SSE PLC (c)	8.647	177	0,03	Macerich Co.	50.425	568	0,11
Microsoft Corp. (c)	714	171	0,03	Tokyo Gas Co. Ltd. (c)	16.200	315	0,06	National Storage Affiliates Trust	29.245	1.056	0,21
NetApp, Inc. (c)	8.962	538	0,11			3.325	0,66	Physicians Realty Trust	49.855	721	0,14
Novatek Microelectronics Corp.	24.000	245	0,05	BEZUGSRECHTE				Piedmont Office Realty Trust, Inc. 'A'	54.014	495	0,10
Realtek Semiconductor Corp.	19.000	173	0,03	Intelsat Jackson Holdings S.A. – Exp. 05.12.2025	11.842	84	0,02	Simon Property Group, Inc.	19.988	2.348	0,46
Unimicron Technology Corp.	51.000	198	0,04	OPTIONSSCHEINE				SITE Centers Corp.	92.403	1.262	0,25
United Microelectronics Corp.	487.000	640	0,13	Guaranteed Rate, Inc. – Exp. 31.12.2060	706	0	0,00	Spirit Realty Capital, Inc.	30.528	1.219	0,24
		9.481	1,87	Intelsat Emergence S.A. – Exp. 17.02.2027	1.128	4	0,00	Uniti Group, Inc.	2.036	11	0,00
BAUSTOFFE				Windstream Holdings II, LLC – Exp. 21.09.2055	2.586	52	0,01	Ventas, Inc.	27.689	1.625	0,32
Anglo American Platinum Ltd.	2.192	183	0,03	VORZUGSWERTPAPIERE				VICI Properties, Inc.	129	4.187	0,83
Anglo American PLC	24.551	957	0,19	Gerdau S.A.	47.700	262	0,05	Weyerhaeuser Co.	9.657	299	0,06
BHP Group Ltd.	101.742	3.139	0,62	0,000 %				WP Carey, Inc.	15.526	1.213	0,24
Dow, Inc.	11.730	591	0,12	Nationwide Building Society 10,250 %	6.220	937	0,19			26.892	5,31
Evrax PLC	72.869	0	0,00	Petroleo Brasileiro S.A. 0,000 %	195.100	906	0,18	KURZFRISTIGE INSTRUMENTE			
Fortescue Metals Group Ltd.	69.888	973	0,19	Voyager Aviation Holdings LLC 9,500 %	93	25	0,00	U.S. TREASURY BILLS			
Grupo Mexico S.A.B. de C.V. 'B'	57.400	201	0,04			2.130	0,42	4,397 % fällig am 23.03.2023 (d)(e)	\$ 8.600	8.520	1,68
Impala Platinum Holdings Ltd.	34.424	432	0,08	REAL ESTATE INVESTMENT TRUSTS				Summe kurzfristige Instrumente		8.520	1,68
LyondellBasell Industries NV 'A'	5.469	454	0,09	Annaly Capital Management, Inc.	18.191	384	0,07	Summe Übertragbare Wertpapiere	\$ 610.560	120,53	
Nitto Denko Corp. (c)	5.700	326	0,06	Apartment Income REIT Corp.	41.024	1.408	0,28	AKTIEN			
Petronas Chemicals Group Bhd.	97.200	190	0,04	Apple Hospitality REIT, Inc.	74.265	1.172	0,23	INVESTMENTFONDS			
Rio Tinto Ltd.	15.305	1.203	0,24	CBL & Associates Properties, Inc.	378	9	0,00	ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN			
Rio Tinto PLC	27.945	1.957	0,39					PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (h)	2.979.857	29.661	5,86
Vale S.A.	54.300	920	0,18					Summe Investmentfonds		\$29.661	5,86
Yara International ASA	6.839	299	0,06								
		11.825	2,33								
IMMOBILIEN											
CK Asset Holdings Ltd.	82.500	506	0,10								

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kapital- betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions- geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions- geschäft ⁽¹⁾	% des Nettovermögens
FICC	1,900 %	30.12.2022	03.01.2023	\$ 781	U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 29.06.2023	\$ (797)	\$ 781	\$ 781	0,15
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (797)	\$ 781	\$ 781	0,15

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
3-Month SOFR December Futures	Short	03.2024	15	\$ 69	0,01
3-Month SOFR December Futures	Short	03.2025	7	19	0,00
3-Month SOFR December Futures	Short	03.2026	8	21	0,00
3-Month SOFR June Futures	Short	09.2024	10	34	0,01

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
3-Month SOFR June Futures	Short	09.2025	9	\$ 23	0,01
3-Month SOFR March Futures	Short	06.2024	13	52	0,01
3-Month SOFR March Futures	Short	06.2025	7	19	0,00
3-Month SOFR March Futures	Short	06.2026	9	23	0,00
3-Month SOFR September Futures	Short	12.2024	10	30	0,01
3-Month SOFR September Futures	Short	12.2025	6	15	0,00
Australia Government 10-Year Bond March Futures	Short	03.2023	103	456	0,09
Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 146,000 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond February 2023 Futures ⁽¹⁾	Short	01.2023	4	3	0,00
Euro-Bund 10-Year Bond March Futures	Short	03.2023	44	401	0,08
Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 138,500 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond February 2023 ⁽¹⁾	Short	01.2023	4	(20)	0,00
U.S. Treasury 5-Year Note March Futures	Long	03.2023	45	(2)	0,00
U.S. Treasury 10-Year Note March Futures	Long	03.2023	650	(564)	(0,11)
U.S. Treasury 30-Year Bond March Futures	Short	03.2023	156	(6)	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond March Futures	Long	03.2023	11	(2)	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond March Futures	Short	03.2023	126	(39)	(0,01)
				\$ 532	0,10

(1) Future-Style-Option.

VERKAUFSOPTIONEN**OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE**

Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
Call – CME Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 98,000 USD auf 3-Month SOFR December Futures	\$ 98,000	15.12.2023	8	\$ (7)	\$ (1)	0,00
Put – CME Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 96,500 USD auf 3-Month SOFR December Futures	96,500	15.12.2023	8	(7)	(24)	0,00
				\$ (14)	\$ (25)	0,00
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate					\$ 507	0,10

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Boeing Co.	1,000 %	20.06.2026	\$ 1.000	\$ 5	0,00
General Electric Co.	1,000	20.12.2023	300	16	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20.12.2025	€ 1.000	56	0,01
Rolls-Royce PLC	1,000	20.06.2027	800	(7)	0,00
				\$ 70	0,01

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.EM-29 5-Year Index	1,000 %	20.06.2023	\$ 850	\$ 17	0,00
CDX.EM-30 5-Year Index	1,000	20.12.2023	3.145	145	0,03
CDX.EM-31 5-Year Index	1,000	20.06.2024	946	33	0,01
CDX.EM-32 5-Year Index	1,000	20.12.2024	510	19	0,00
CDX.EM-34 5-Year Index	1,000	20.12.2025	2.208	(21)	0,00
CDX.EM-36 5-Year Index	1,000	20.12.2026	6.808	24	0,00
CDX.EM-38 5-Year Index	1,000	20.12.2027	2.500	62	0,01
CDX.HY-36 5-Year Index	5,000	20.06.2026	1.881	(115)	(0,02)
CDX.HY-37 5-Year Index	5,000	20.12.2026	891	(21)	0,00
CDX.HY-39 5-Year Index	5,000	20.12.2027	19.900	889	0,18
CDX.IG-39 5-Year Index	1,000	20.12.2027	700	5	0,00
iTraxx Asia Ex-Japan 38 5-Year Index	1,000	20.12.2027	400	9	0,00
				\$ 1.046	0,21

ZINSSWAPS

Zahlung/Erhalt	variabler Zinssatz	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt ⁽³⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	2,000 %	15.03.2033	£ 6.900	\$ (117)	(0,02)
Erhalt ⁽³⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	2,000	15.03.2053	200	2	0,00
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000	15.03.2029	¥ 2.430.000	814	0,16
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,020	20.09.2028	2.950.000	878	0,17
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,176	27.04.2027	160.000	(17)	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Strategic Income Fund (Forts.)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum		Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,400 %	15.06.2032	¥	410.000	\$ 123	0,02
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,500	15.03.2042		220.000	143	0,03
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,711	27.04.2042		40.000	26	0,01
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,000	15.06.2027	\$	15.700	(1.677)	(0,33)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,000	15.06.2027		1.200	101	0,02
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,000	15.06.2029		2.770	(356)	(0,07)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,250	15.12.2028		3.900	(527)	(0,10)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,250	15.06.2032		5.950	(727)	(0,14)
Erhalt ⁽³⁾	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,600	16.01.2026		6.600	157	0,03
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2027		26.000	925	0,18
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2029		1.209	64	0,01
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2032		1.878	121	0,02
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2032		1.840	(192)	(0,04)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,817	05.04.2032		2.200	(296)	(0,06)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,872	06.04.2032		1.100	(143)	(0,03)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,928	25.03.2027		1.100	(81)	(0,02)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,000	21.12.2027		1.250	9	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,000	21.12.2029		4.630	38	0,01
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,000	21.12.2032		6.670	54	0,01
Erhalt ⁽³⁾	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,300	17.01.2026		4.600	109	0,02
Erhalt ⁽³⁾	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,350	17.01.2025		7.900	116	0,02
Erhalt ⁽³⁾	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,450	20.12.2024		15.900	238	0,05
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,850	30.08.2027		1.000	(36)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,955	04.10.2027		1.000	(30)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,050	07.09.2027		500	(14)	(0,00)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,050	08.09.2029		500	(15)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,050	06.09.2032		700	(24)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,100	09.09.2029		500	(13)	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,350	14.12.2032		200	4	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,610	12.12.2032		400	0	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,750	13.12.2027		900	2	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	5,830	02.01.2023	BRL	10.900	(37)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	5,836	02.01.2023		8.500	(28)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	5,855	02.01.2023		2.800	(9)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	6,170	02.01.2023		74.400	(695)	(0,14)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,140	02.01.2025		1.300	(8)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,160	02.01.2025		800	(5)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,220	04.01.2027		1.500	(11)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,245	04.01.2027		700	(5)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,260	04.01.2027		800	(6)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,350	02.01.2025		1.000	(5)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,700	04.01.2027		400	(2)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,715	04.01.2027		1.700	(8)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,870	04.01.2027		4.000	(15)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,000	02.01.2025		2.800	(8)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,080	02.01.2025		4.700	(12)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,140	02.01.2025		2.300	(5)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,145	02.01.2025		2.300	(5)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,160	02.01.2025		4.700	(11)	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	12,670	02.01.2023		3.800	2	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	12,690	02.01.2023		2.600	2	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	12,740	02.01.2023		6.500	3	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	12,750	02.01.2023		3.100	2	0,00

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	1-Year BRL-CDI	12,760 %	02.01.2023	BRL 6.400	\$ 3	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	12,900	02.01.2023	13.300	3	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	12,930	02.01.2023	1.700	0	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	12,939	02.01.2023	6.700	1	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	12,946	02.01.2023	16.700	3	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	12,960	02.01.2023	13.300	2	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	12,970	02.01.2023	21.900	4	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,500	16.06.2026	\$ 32.900	3.337	0,66
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,500	16.06.2028	26.200	(3.046)	(0,60)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,750	15.12.2024	53.300	(4.188)	(0,83)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,750	16.06.2031	16.200	2.240	0,44
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,750	16.06.2031	13.442	(1.760)	(0,35)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,940	08.06.2026	2.000	214	0,04
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,000	16.12.2030	1.766	341	0,07
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,235	12.05.2028	700	97	0,02
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,250	15.12.2026	34.300	4.235	0,84
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,250	17.06.2027	12.000	(1.863)	(0,37)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,250	17.06.2030	47.620	6.063	1,21
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,250	16.06.2051	4.300	(1.008)	(0,20)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,270	04.11.2023	52.700	(1.654)	(0,33)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,350	20.01.2027	3.400	357	0,07
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,360	20.07.2031	800	149	0,03
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,370	19.07.2031	500	93	0,02
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,380	04.01.2027	1.400	(142)	(0,03)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,405	07.09.2031	1.300	239	0,05
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,425	18.01.2027	1.000	(99)	(0,02)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,443	18.01.2027	1.100	(109)	(0,02)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,450	17.02.2027	2.400	242	0,05
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,450	16.07.2031	1.200	217	0,04
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,491	21.01.2051	900	(322)	(0,06)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,500	15.12.2028	7.130	(1.078)	(0,21)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,500	12.01.2029	578	76	0,01
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,500	05.10.2031	600	(106)	(0,02)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,535	15.10.2031	600	(105)	(0,02)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,535	22.10.2031	400	(70)	(0,01)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,545	26.10.2031	400	(70)	(0,01)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,550	20.01.2027	15.100	(1.410)	(0,28)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,570	11.01.2027	800	(75)	(0,02)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,580	16.02.2027	900	(84)	(0,02)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,590	09.02.2051	7.200	(2.460)	(0,49)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,625	16.01.2050	3.100	1.060	0,21
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,625	03.02.2050	3.900	1.340	0,26
Zahlung ⁽³⁾	3-Month USD-LIBOR	1,700	06.03.2024	2.300	(73)	(0,01)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,700	17.02.2027	9.600	(834)	(0,16)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,700	12.01.2029	2.100	(245)	(0,05)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,740	16.12.2026	1.100	103	0,02
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,750	22.01.2050	7.600	2.461	0,49
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,768	02.02.2032	300	(47)	(0,01)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,785	12.08.2051	700	230	0,05
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,875	07.02.2050	400	120	0,02
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,895	18.10.2049	700	225	0,04
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,910	17.10.2049	700	221	0,04
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	2,000	18.02.2032	900	(120)	(0,02)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,000	15.01.2050	1.400	392	0,08
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	2,000	15.12.2051	6.500	(2.289)	(0,45)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,250	11.12.2049	7.100	1.673	0,33
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,250	12.03.2050	3.400	780	0,15
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,500	18.12.2024	6.000	586	0,12
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,500	20.12.2024	10.900	203	0,04
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	3,000	19.06.2024	41.600	2.568	0,51
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	3,000	19.06.2026	32.300	2.292	0,45
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	7,710	23.11.2025	ZAR 10.000	2	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	7,750	19.09.2028	14.200	(30)	(0,01)
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	2,750	17.06.2026	AUD 460	(18)	0,00
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	3,000	21.03.2027	18.640	(978)	(0,19)
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	3,250	17.12.2024	1.600	(77)	(0,02)
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	3,500	17.06.2025	19.492	(1.182)	(0,23)
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,250	17.12.2024	650	(55)	(0,01)
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,750	18.06.2024	400	(40)	(0,01)
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,150	18.03.2030	€ 6.200	1.332	0,26
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,250	18.03.2050	2.300	974	0,19
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,329	30.12.2025	100	11	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,363	30.06.2025	200	19	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,395	30.12.2024	100	8	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,425	28.06.2024	200	12	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,453	29.12.2023	200	8	0,00
Erhalt ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	0,830	09.12.2052	5.600	167	0,03
Erhalt ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	1,750	15.03.2033	3.800	109	0,02
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,000	21.09.2032	11.880	(1.414)	(0,28)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,160	06.06.2025	MXN 9.300	(46)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,535	04.05.2027	18.500	(115)	(0,02)

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Strategic Income Fund (Forts.)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,795 %	02.06.2023	MXN 3.600	\$ 9	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,950	30.01.2026	12.300	4	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,980	26.08.2024	500	0	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,990	30.01.2026	15.000	4	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	6,080	10.03.2026	20.700	3	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	6,350	01.09.2023	3.300	2	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	6,490	08.09.2026	13.700	(11)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	6,620	18.02.2030	600	(1)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	6,710	20.09.2029	500	(1)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,150	11.06.2027	28.100	(59)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,165	06.09.2032	3.000	(9)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,200	11.06.2027	2.900	(6)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,360	21.08.2037	3.100	(12)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,370	11.10.2027	14.800	(39)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,380	04.11.2026	400	(1)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	7,380	14.08.2037	700	1	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,480	18.06.2037	1.300	(5)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	7,495	14.01.2032	8.100	(1)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	7,498	15.01.2032	33.500	(7)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,520	18.04.2023	30.200	(14)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,530	18.04.2023	24.900	(12)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,530	21.04.2023	3.100	(2)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,545	18.04.2023	19.100	(10)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,603	14.04.2025	49.000	(106)	(0,02)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,610	23.01.2023	18.100	4	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,610	15.04.2025	3.000	(6)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,640	03.01.2023	2.200	0	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,645	03.01.2023	4.900	(1)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,670	05.03.2025	52.900	(107)	(0,02)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,700	02.05.2023	7.100	(3)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,710	07.03.2025	6.400	(13)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,715	07.03.2025	6.300	(13)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,745	05.01.2023	3.400	0	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	7,800	28.12.2027	2.900	6	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,805	06.02.2023	7.800	(2)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,818	17.02.2027	11.400	(38)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,820	06.02.2023	7.900	0	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,865	02.02.2027	11.900	(41)	(0,01)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	7,910	30.12.2027	600	1	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	7,984	10.12.2027	6.800	12	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	7,990	21.12.2027	100	0	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,005	21.12.2027	37.500	85	0,02
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,010	04.02.2027	5.200	(19)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,030	31.01.2028	4.600	8	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,050	31.01.2028	3.400	5	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,090	15.01.2027	13.000	(50)	(0,01)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,103	04.01.2038	5.600	12	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,120	15.01.2027	2.700	(11)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,410	31.03.2027	11.100	10	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,660	04.04.2024	38.500	48	0,01
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,675	03.04.2024	92.600	115	0,02
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,701	31.03.2032	19.500	2	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,730	06.04.2027	16.500	5	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,732	30.03.2032	8.200	0	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,750	05.04.2024	39.700	47	0,01
Zahlung	UKRPI	4,000	15.09.2031	£ 300	(43)	(0,01)
Zahlung	UKRPI	4,020	15.10.2031	400	(55)	(0,01)
Zahlung	UKRPI	4,055	15.09.2031	400	(57)	(0,01)
Zahlung	UKRPI	4,066	15.09.2031	600	(74)	(0,02)
Zahlung	UKRPI	4,140	15.10.2031	1.000	(123)	(0,02)
Zahlung	UKRPI	4,250	15.11.2031	900	(88)	(0,02)
Zahlung	UKRPI	4,400	15.10.2031	400	(41)	(0,01)
					\$ 5.695	1,12
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					\$ 6.811	1,34

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definieren.

(3) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

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

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

VERKAUFSOPTIONEN

CREDIT DEFAULT SWAPPTIONS AUF KREDITINDIZES

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/ -verkauf	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
GST	Put – OTC iTraxx Europe 37 5-Year Index	Verkauf	3,000 %	15.03.2023	500	\$ (1)	\$ 0	0,00

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
BOA	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,150 %	01.12.2023	1.100	\$ (3)	\$ (1)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	01.12.2023	1.100	(3)	(8)	0,00
	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,000	19.01.2023	300	(1)	0	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,500	19.01.2023	300	(1)	(4)	0,00
BPS	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,550	11.04.2023	500	(1)	0	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,100	11.04.2023	500	(2)	(8)	0,00
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,700	28.04.2023	1.300	(2)	0	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,250	28.04.2023	1.300	(2)	(18)	(0,01)
	Call – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,150	09.01.2023	700	(2)	0	0,00
	Put – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	09.01.2023	700	(2)	(4)	0,00
	Call – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,270	23.01.2023	300	(1)	0	0,00
	Put – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,770	23.01.2023	300	(1)	(1)	0,00
BRC	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,000	19.01.2023	300	(1)	0	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,500	19.01.2023	300	(1)	(4)	0,00
	Call – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,200	12.01.2023	500	(2)	0	0,00
	Put – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,800	12.01.2023	500	(2)	(2)	0,00
CBK	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,690	02.04.2024	300	(2)	(1)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,690	02.04.2024	300	(2)	(4)	0,00
	Call – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,150	09.01.2023	700	(2)	0	0,00
	Put – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	09.01.2023	700	(2)	(4)	0,00
DUB	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,920	13.10.2023	1.000	(6)	(1)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,920	13.10.2023	1.000	(6)	(14)	0,00
FAR	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,688	02.04.2024	600	(5)	(2)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,688	02.04.2024	600	(5)	(8)	0,00
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,781	05.04.2024	1.000	(8)	(3)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,781	05.04.2024	1.000	(8)	(12)	0,00
GLM	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,920	13.10.2023	700	(4)	(1)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,920	13.10.2023	700	(4)	(10)	0,00
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,018	20.10.2023	500	(3)	(1)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,018	20.10.2023	500	(3)	(6)	0,00
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,140	23.10.2023	500	(4)	(1)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,140	23.10.2023	500	(4)	(6)	0,00
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,190	23.10.2023	500	(4)	(1)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,190	23.10.2023	500	(4)	(6)	0,00
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,225	23.10.2023	500	(4)	(1)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,225	23.10.2023	500	(3)	(5)	0,00
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,973	25.10.2023	600	(4)	(1)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,973	25.10.2023	600	(4)	(8)	0,00
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,841	27.10.2023	600	(4)	(1)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,841	27.10.2023	600	(4)	(8)	0,00
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,088	03.11.2023	600	(4)	(1)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,088	03.11.2023	600	(4)	(7)	0,00
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,910	10.11.2023	600	(4)	(1)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,910	10.11.2023	600	(4)	(8)	0,00
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,250	17.11.2023	1.100	(4)	(1)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	17.11.2023	1.100	(4)	(8)	0,00
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,150	20.11.2023	1.100	(4)	(1)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	20.11.2023	1.100	(4)	(8)	0,00
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,250	07.12.2023	1.100	(3)	(1)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	07.12.2023	1.100	(3)	(7)	0,00
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,697	02.04.2024	1.200	(9)	(4)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,697	02.04.2024	1.200	(9)	(15)	(0,01)
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,721	08.04.2024	600	(5)	(2)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,721	08.04.2024	600	(5)	(7)	0,00
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,550	05.04.2023	1.400	(3)	0	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,100	05.04.2023	1.400	(3)	(22)	(0,01)
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,550	11.04.2023	2.400	(5)	0	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,100	11.04.2023	2.400	(5)	(36)	(0,01)
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,700	24.04.2023	1.400	(2)	0	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,250	24.04.2023	1.400	(4)	(20)	(0,01)
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,700	26.04.2023	1.300	(2)	0	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,250	26.04.2023	1.300	(2)	(18)	(0,01)
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,550	15.05.2023	1.300	(2)	0	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,100	15.05.2023	1.300	(2)	(21)	(0,01)
	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,547	07.03.2023	800	(18)	(2)	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,547	07.03.2023	800	(18)	(49)	(0,01)
	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,067	09.06.2023	1.100	(13)	(3)	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	3,140	09.06.2023	1.100	(15)	(36)	(0,01)
	Call – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,230	23.01.2023	900	(2)	0	0,00
	Put – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,730	23.01.2023	900	(2)	(5)	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Strategic Income Fund (Forts.)

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
JPM	Call – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,200 %	12.01.2023	500	(2)	0	0,00
	Put – OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,800	12.01.2023	500	(2)	(2)	0,00
MYC	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,993	11.10.2023	600	(4)	(1)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,993	11.10.2023	600	(4)	(8)	0,00
							\$ (302)	\$ (449)	(0,09)

OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Nenn- betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
BOA	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.01.2053	\$ 101,891	05.01.2023	600	\$ (2)	\$ 0	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.02.2053	99,813	06.02.2023	100	(1)	(1)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.02.2053	100,000	06.02.2023	100	(1)	(1)	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.02.2053	101,813	06.02.2023	100	(1)	0	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.02.2053	102,000	06.02.2023	100	(1)	0	0,00
JPM	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.03.2053	97,000	06.03.2023	200	(2)	(3)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.03.2053	97,156	06.03.2023	200	(2)	(3)	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.03.2053	99,000	06.03.2023	200	(1)	(1)	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.03.2053	99,156	06.03.2023	200	(1)	0	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fällig am 01.03.2053	98,766	06.03.2023	200	(1)	(3)	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fällig am 01.03.2053	100,766	06.03.2023	200	(1)	(1)	0,00
SAL	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fällig am 01.03.2053	97,578	06.03.2023	100	(1)	(1)	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fällig am 01.03.2053	99,578	06.03.2023	100	(1)	(1)	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.01.2053	102,250	05.01.2023	300	(1)	0	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.02.2053	99,750	06.02.2023	600	(4)	(4)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.02.2053	100,000	06.02.2023	200	(1)	(1)	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.02.2053	101,750	06.02.2023	600	(3)	(1)	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.02.2053	102,000	06.02.2023	200	(1)	0	0,00
					\$ (26)	\$ (21)	0,00

⁽¹⁾ Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHÜTZVERKAUF⁽¹⁾

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽²⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettovermögens
BOA	Turkey Government International Bond	1,000 %	20.12.2023	\$ 400	\$ (29)	\$ 20	\$ (9)	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.12.2024	100	(12)	6	(6)	0,00
BPS	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2027	200	(18)	4	(14)	0,00
BRC	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2023	100	(6)	6	0	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2026	300	(14)	0	(14)	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.12.2023	900	(62)	41	(21)	(0,01)
	Turkey Government International Bond	1,000	20.06.2024	400	(36)	19	(17)	(0,01)
	Turkey Government International Bond	1,000	20.12.2024	940	(110)	53	(57)	(0,01)
CBK	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2024	500	(9)	8	(1)	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2024	200	(2)	1	(1)	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2024	500	2	(7)	(5)	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2027	100	(4)	(2)	(6)	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2024	700	(11)	15	4	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.12.2024	100	(10)	4	(6)	0,00
GST	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2024	600	(9)	7	(2)	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2027	100	(4)	(2)	(6)	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2027	100	(9)	2	(7)	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2024	800	(7)	13	6	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2027	700	(29)	20	(9)	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2023	100	(5)	5	0	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.06.2024	400	(36)	19	(17)	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.12.2024	900	(101)	47	(54)	(0,01)
HUS	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2023	200	(6)	6	0	0,00
	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2024	1.300	(38)	37	(1)	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2023	3.200	(50)	68	18	0,00
JPM	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2023	100	(3)	4	1	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2026	300	(2)	3	1	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2023	800	(44)	45	1	0,00
MYC	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2027	200	(7)	(5)	(12)	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2027	200	(18)	4	(14)	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2024	600	(5)	9	4	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2025	100	(1)	1	0	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2026	1.100	3	(5)	(2)	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2027	400	(1)	(2)	(3)	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2027	1.400	(49)	31	(18)	(0,01)
					\$ (742)	\$ 475	\$ (267)	(0,05)

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Kontrahent	Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽²⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	ABX.HE.AAA.6-2 Index	0,110 %	25.05.2046	\$ 330	\$ (77)	\$ 74	\$ (3)	0,00
DUB	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	400	(7)	6	(1)	0,00
	CMBX.NA.AAA.7 Index	0,500	17.01.2047	382	(17)	17	0	0,00
FBF	CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17.08.2061	25	0	0	0	0,00
	CMBX.NA.AAA.6 Index	0,500	11.05.2063	3	0	0	0	0,00
	CMBX.NA.AAA.8 Index	0,500	17.10.2057	100	(6)	6	0	0,00
GST	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	16.000	(8)	(28)	(36)	(0,01)
	CMBX.NA.AAA.11 Index	0,500	18.11.2054	7.300	(38)	3	(35)	(0,01)
	CMBX.NA.AAA.6 Index	0,500	11.05.2063	3	0	0	0	0,00
	CMBX.NA.AAA.8 Index	0,500	17.10.2057	8.600	(339)	347	8	0,00
	CMBX.NA.AAA.9 Index	0,500	17.09.2058	298	(12)	12	0	0,00
MEI	CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17.08.2061	500	(4)	0	(4)	0,00
	CMBX.NA.AAA.8 Index	0,500	17.10.2057	200	(11)	11	0	0,00
	CMBX.NA.AAA.9 Index	0,500	17.09.2058	596	(47)	47	0	0,00
MYC	ABX.HE.AAA.6-2 Index	0,110	25.05.2046	523	(121)	116	(5)	0,00
	CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17.08.2061	500	(4)	0	(4)	0,00
	CMBX.NA.AAA.6 Index	0,500	11.05.2063	1	0	0	0	0,00
	CMBX.NA.AAA.8 Index	0,500	17.10.2057	100	(6)	6	0	0,00
SAL	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	2.075	17	(22)	(5)	0,00
	CMBX.NA.AAA.11 Index	0,500	18.11.2054	1.200	6	(12)	(6)	0,00
	CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17.08.2061	300	0	(2)	(2)	0,00
	CMBX.NA.AAA.9 Index	0,500	17.09.2058	15.400	15	(20)	(5)	0,00
UAG	CMBX.NA.AAA.8 Index	0,500	17.10.2057	100	(6)	6	0	0,00
					\$ (665)	\$ 567	\$ (98)	(0,02)

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

⁽²⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definieren.

TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES

Kontrahent	Zahlung/Erhalt	Wertpapier	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Variabler Zinssatz	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
GST	Erhalt	iBoxx USD Liquid High Yield Index	k. A.	1,058 %	\$ 200	20.06.2023	\$ (2)	\$ (2)	\$ (4)	0,00

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens	
BOA	01.2023	£	107	\$ 129	\$ 1	\$ 0	0,00	
	01.2023	\$	4.498	AUD 6.641	7	0	0,00	
	01.2023		383	£ 314	0	(5)	0,00	
	01.2023		121	KRW 157.953	5	0	0,00	
	01.2023		257	PEN 987	1	0	0,00	
	01.2023	ZAR	1.463	\$ 83	0	(3)	0,00	
	02.2023	PEN	1.791	456	0	(12)	0,00	
	02.2023	\$	826	NOK 8.197	8	0	0,00	
	02.2023	ZAR	1.301	\$ 73	0	(4)	0,00	
	03.2023	TWD	7.920	269	9	0	0,00	
	03.2023	\$	583	IDR 9.094.800	5	0	0,00	
	03.2023	ZAR	24.030	\$ 1.364	0	(40)	(40)	(0,01)
	01.2023	\$	1.154	CAD 1.549	0	(10)	(10)	0,00
	01.2023	PEN	1.131	\$ 293	0	(4)	(4)	0,00
BOM BPS	01.2023	\$	3.571	KRW 4.655.966	131	0	0,03	
	01.2023		84	ZAR 1.463	2	0	0,00	
	02.2023		385	IDR 6.057.720	6	0	0,00	
	02.2023	ZAR	16.466	\$ 917	0	(47)	(47)	(0,01)
	03.2023	MXN	31.699	1.573	0	(31)	(31)	(0,01)
	03.2023	TWD	377	13	0	0	0,00	
	03.2023	\$	22	CLP 19.175	0	0	0,00	
	03.2023		293	PEN 1.137	4	0	0,00	
	01.2023	CNH	2.513	\$ 360	0	(3)	(3)	0,00
	01.2023	CLP	952.491	1.071	0	(46)	(46)	(0,01)
BRC CBK	01.2023	PEN	8.777	2.193	0	(103)	(103)	(0,02)
	01.2023	\$	510	AUD 752	0	0	0,00	
	01.2023		7.519	BRL 39.463	0	(44)	(44)	(0,01)
	01.2023		999	CLP 952.170	117	0	117	0,02
	01.2023		399	¥ 53.100	3	0	3	0,00
	01.2023		4	PEN 17	0	0	0,00	
	01.2023		143	ZAR 2.502	4	0	4	0,00
	02.2023	BRL	7.035	\$ 1.303	0	(22)	(22)	0,00
	02.2023	\$	1.071	CLP 957.738	47	0	47	0,01

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Strategic Income Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	02.2023	\$ 1.530	NZD 2.391	\$ 0	\$ (17)	\$ (17)	0,00
	03.2023	MXN 562	\$ 28	0	(1)	(1)	0,00
	03.2023	\$ 124	CLP 107.456	1	0	1	0,00
	03.2023	825	PEN 3.250	22	0	22	0,00
	04.2023	356	1.424	14	0	14	0,00
	05.2023	MXN 197	\$ 10	0	0	0	0,00
DUB	02.2023	ZAR 1.716	103	2	0	2	0,00
GLM	01.2023	BRL 39.463	7.405	0	(70)	(70)	(0,01)
	01.2023	CNH 2.609	375	0	(2)	(2)	0,00
	01.2023	ZAR 1.329	74	0	(4)	(4)	0,00
	03.2023	MXN 716	36	0	0	0	0,00
	03.2023	\$ 3.103	MXN 63.783	125	0	125	0,03
	04.2023	7.275	BRL 39.463	71	0	71	0,01
	05.2023	1.234	PEN 4.932	46	0	46	0,01
JPM	05.2023	ZAR 3.016	\$ 180	5	0	5	0,00
	01.2023	£ 8.043	9.712	36	0	36	0,01
	01.2023	\$ 15	CNY 102	0	0	0	0,00
	02.2023	NOK 70	\$ 7	0	0	0	0,00
	02.2023	TWD 11.144	367	3	0	3	0,00
	02.2023	\$ 664	IDR 10.463.026	13	0	13	0,00
	03.2023	26	CNY 183	0	0	0	0,00
	03.2023	281	IDR 4.396.522	3	0	3	0,00
MBC	01.2023	€ 8.661	\$ 9.077	0	(171)	(171)	(0,03)
	01.2023	\$ 454	AUD 679	7	0	7	0,00
	01.2023	1.401	CAD 1.879	0	(14)	(14)	0,00
	01.2023	3.989	¥ 543.158	131	0	131	0,03
	01.2023	ZAR 9.108	\$ 522	0	(13)	(13)	0,00
	03.2023	PEN 739	192	0	(1)	(1)	0,00
	03.2023	TWD 11.006	374	13	0	13	0,00
	03.2023	\$ 170	IDR 2.668.460	2	0	2	0,00
MYI	05.2023	740	CNH 4.968	0	(15)	(15)	0,00
	01.2023	€ 173	\$ 184	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 852	AUD 1.268	9	0	9	0,00
	01.2023	3.236	¥ 443.290	126	0	126	0,02
	02.2023	TWD 20.603	\$ 676	3	0	3	0,00
	02.2023	ZAR 20.600	1.155	0	(52)	(52)	(0,01)
	03.2023	MXN 4.575	228	0	(4)	(4)	0,00
	03.2023	TWD 10.042	341	12	0	12	0,00
RBC	03.2023	\$ 240	IDR 3.759.827	3	0	3	0,00
	01.2023	CAD 4.801	\$ 3.515	0	(29)	(29)	(0,01)
	01.2023	\$ 10	AUD 15	0	0	0	0,00
	01.2023	ZAR 793	\$ 45	0	(1)	(1)	0,00
	02.2023	MXN 42.952	2.166	0	(24)	(24)	0,00
	02.2023	\$ 1.253	NOK 12.499	18	0	18	0,00
	03.2023	MXN 9.883	\$ 494	0	(8)	(8)	0,00
	03.2023	\$ 4.845	MXN 96.901	65	0	65	0,01
SCX	01.2023	57	AUD 85	0	0	0	0,00
	01.2023	1.006	CAD 1.352	0	(9)	(9)	0,00
	01.2023	329	PEN 1.263	2	0	2	0,00
	02.2023	699	IDR 11.009.467	13	0	13	0,00
	03.2023	135	PEN 521	0	0	0	0,00
	04.2023	ZAR 4.787	\$ 260	0	(19)	(19)	0,00
	09.2023	9.141	521	0	(5)	(5)	0,00
SSB	03.2023	\$ 620	CLP 542.872	11	0	11	0,00
UAG	01.2023	452	£ 365	0	(13)	(13)	0,00
	01.2023	232	ZAR 4.039	5	0	5	0,00
	01.2023	ZAR 16.500	\$ 921	0	(47)	(47)	(0,01)
	02.2023	\$ 1.029	IDR 16.339.752	27	0	27	0,01
	03.2023	ZAR 1.878	\$ 105	0	(5)	(5)	0,00
	09.2023	6.658	380	0	(4)	(4)	0,00
				\$ 1.138	\$ (902)	\$ 236	0,05

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRÄKTE

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, E EUR (Hedged) thesaurierend, E EUR (Hedged) ausschüttend II, T EUR (Hedged) thesaurierend und T EUR (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2023	CHF 853	\$ 902	\$ 0	\$ (21)	\$ (21)	0,00
	01.2023	MXN 2.485	127	0	(1)	(1)	0,00
	01.2023	SGD 1.258	916	0	(22)	(22)	0,00
	01.2023	\$ 51	€ 49	1	0	1	0,00
	01.2023	342	¥ 45.249	1	0	1	0,00
BPS	01.2023	€ 2.780	\$ 2.967	0	(2)	(2)	0,00
	01.2023	SGD 92	67	0	(2)	(2)	0,00
BRC	01.2023	NOK 3.387	340	0	(4)	(4)	0,00
	01.2023	SEK 6.273	599	0	(3)	(3)	0,00
CBK	01.2023	CHF 7.090	7.506	0	(161)	(161)	(0,03)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	01.2023	CNY 108	\$ 15	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	01.2023	€ 13.848	\$ 14.753	0	(32)	(32)	(0,01)
	01.2023	IDR 8.016.219	509	0	(10)	(10)	0,00
	01.2023	INR 15.646	191	2	0	2	0,00
	01.2023	SEK 143	14	0	0	0	0,00
	01.2023	TWD 74.965	2.440	0	(1)	(1)	0,00
	01.2023	\$ 228	AUD 341	4	0	4	0,00
	01.2023	1.255	CNY 8.678	2	0	2	0,00
	01.2023	125.572	€ 121.038	3.661	0	3.661	0,72
	01.2023	391	MXN 7.597	0	(1)	(1)	0,00
GLM	02.2023	MXN 7.597	\$ 389	1	0	1	0,00
	01.2023	BRL 3.425	623	0	(26)	(26)	(0,01)
	01.2023	MXN 5.111	264	2	0	2	0,00
	01.2023	MYR 1.764	375	0	(25)	(25)	0,00
	01.2023	\$ 994	BRL 5.265	3	0	3	0,00
	01.2023	399	MYR 1.764	1	0	1	0,00
	02.2023	BRL 5.265	\$ 988	0	(4)	(4)	0,00
JPM	02.2023	MYR 1.764	400	0	(4)	(4)	0,00
	01.2023	BRL 1.840	348	0	0	0	0,00
	01.2023	£ 4.886	5.900	22	0	22	0,00
MBC	01.2023	ZAR 7	0	0	0	0	0,00
	01.2023	AUD 131	88	0	(1)	(1)	0,00
	01.2023	CAD 2.207	1.645	16	0	16	0,00
	01.2023	DKK 2.137	299	0	(8)	(8)	0,00
	01.2023	€ 1.301	1.388	0	(1)	(1)	0,00
	01.2023	£ 218	266	3	0	3	0,00
	01.2023	ILS 695	203	6	0	6	0,00
	01.2023	¥ 575.670	4.249	0	(117)	(117)	(0,02)
	01.2023	NOK 362	37	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 163.050	€ 155.542	3.024	0	3.024	0,60
MYI	01.2023	AUD 4.162	\$ 2.795	0	(28)	(28)	(0,01)
	01.2023	¥ 493.745	3.604	0	(140)	(140)	(0,03)
	01.2023	ZAR 5.282	310	0	0	0	0,00
RBC	01.2023	AUD 48	32	0	0	0	0,00
SCX	01.2023	279	188	0	(1)	(1)	0,00
	01.2023	CNY 11.518	1.614	0	(54)	(54)	(0,01)
	01.2023	\$ 143.511	€ 137.879	3.702	0	3.702	0,72
SOG	01.2023	KRW 1.252.623	\$ 943	0	(53)	(53)	(0,01)
UAG	01.2023	HKD 21.272	2.722	0	(4)	(4)	0,00
	01.2023	IDR 6.188	0	0	0	0	0,00
	01.2023	SEK 400	38	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 2	KRW 3.023	0	0	0	0,00
				\$ 10.451	\$ (726)	\$ 9.725	1,91

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilsklasse Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2023	CHF 0	\$ 1	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	01.2023	£ 1	1	0	0	0	0,00
	01.2023	SGD 1	0	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 83	£ 69	0	0	0	0,00
BSH	01.2023	NOK 0	\$ 0	0	0	0	0,00
CBK	01.2023	AUD 0	0	0	0	0	0,00
	01.2023	BRL 3	1	0	0	0	0,00
	01.2023	CHF 4	4	0	0	0	0,00
	01.2023	CNY 0	0	0	0	0	0,00
	01.2023	€ 1	1	0	0	0	0,00
	01.2023	IDR 4.755	0	0	0	0	0,00
	01.2023	ILS 0	0	0	0	0	0,00
	01.2023	INR 2	0	0	0	0	0,00
	01.2023	¥ 324	2	0	0	0	0,00
	01.2023	MXN 4	0	0	0	0	0,00
	01.2023	NOK 2	0	0	0	0	0,00
	01.2023	TWD 43	1	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 1	BRL 3	0	0	0	0,00
	01.2023	1	CNY 5	0	0	0	0,00
	01.2023	0	MXN 4	0	0	0	0,00
	02.2023	BRL 3	\$ 1	0	0	0	0,00
MYI	02.2023	MXN 4	0	0	0	0	0,00
	01.2023	AUD 2	1	0	0	0	0,00
	01.2023	DKK 1	0	0	0	0	0,00
	01.2023	¥ 278	2	0	0	0	0,00
	01.2023	MYR 1	0	0	0	0	0,00
	01.2023	SEK 4	0	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 0	MYR 1	0	0	0	0,00
SCX	01.2023	ZAR 3	\$ 0	0	0	0	0,00
	01.2023	AUD 0	0	0	0	0	0,00
	01.2023	CNY 6	1	0	0	0	0,00
	01.2023	€ 4	4	0	(1)	(1)	0,00
	01.2023	\$ 8	£ 7	0	0	0	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Strategic Income Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Wahrung	Zu erhaltende Wahrung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermogens
SOG	01.2023	HKD 12	\$ 2	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	01.2023	KRW 706	1	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 69	£ 58	0	0	0	0,00
TOR	01.2023	CAD 1	\$ 1	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 80	£ 67	0	0	0	0,00
				\$ 0	\$ (1)	\$ (1)	0,00
Summe Freiverkehrsfina n z d e r i v a t e						\$ 9.121	1,80

LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMOGENS
US-REGIERUNGSBEHORDEN			
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA			
2,000 % fallig am 01.01.2053	\$ 10.600	\$ (8.628)	(1,70)
3,500 % fallig am 01.01.2053	1.300	(1.181)	(0,23)
4,000 % fallig am 01.01.2053 (j)	3.500	(3.283)	(0,65)
Summe Leerverkaufte Wertpapiere		\$ (13.092)	(2,58)
Summe Anlagen		\$ 644.349	127,20
Sonstige Aktiva und Passiva		\$ (137.792)	(27,20)
Nettovermogen		\$ 506.557	100,00

ERLAUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend*):

- * Auf null lautende Saldi konnen fur faktisch vorhandene Betrage stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt
- µ Bei diesem Betrag handelt es sich ganz oder teilweise um ungedeckte Darlehenszusagen. Der Zinssatz fur den ungedeckten Teil wird zum Zeitpunkt der Finanzierung festgelegt.
- ^ Das Wertpapier ist in Verzug.
- (a) Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.
- (b) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.
- (c) Das Wertpapier hat in den letzten zwolf Monaten keine Ertrage geliefert.
- (d) Nullkuponwertpapier.
- (e) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfalligkeit dar.
- (f) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.
- (g) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nachsten vertraglichen Kundigungstermin dar.
- (h) Mit dem Fonds verbunden.
- (i) Bedingt wandelbares Wertpapier.
- (j) Zum 31. Dezember 2022 leerverkaufte Wertpapiere sind durch langfristige Portfolioanlagen in ubertragbaren Wertpapieren und Geldmarktinstrumenten abgedeckt.
- (k) Eingeschrankte Wertpapiere (31. Dezember 2021: 0,39 %):

Emittentenbeschreibung	Kaufdatum	Kosten	Marktwert	% des Nettovermogens
Intelsat Emergence S.A.	19.06.2017 - 23.02.2022	\$ 5.147	\$ 1.315	0,26
Morgan Stanley 0,000 % fallig am 02.04.2032	11.02.2020	609	400	0,08
Neiman Marcus Group Ltd. LLC	25.09.2020	278	1.522	0,30
		\$ 6.034	\$ 3.237	0,64

Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von 0 USD (31. Dezember 2021: 1.825 USD) wurden gema den Rahmenvertragen fur Wertpapier-Termingeschafte zum 31. Dezember 2022 als Sicherheiten fur verzogert gelieferte Wertpapiere oder Ruckkauf-Finanzierungsgeschafte verpfandet oder geliefert.

Barmittel in Hohe von 10.994 USD (31. Dezember 2021: 13.324 USD) wurden zum 31. Dezember 2022 als Sicherheit fur borsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfandet.

Barmittel in Hohe von 376 USD (31. Dezember 2021: 894 USD) wurden gema den Rahmenvertragen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. zum 31. Dezember 2022 als Sicherheiten fur Finanzderivate verpfandet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Markten notierte Kurse fur identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Ubertragbare Wertpapiere	\$ 88.708	\$ 512.322	\$ 9.530	\$ 610.560
Investmentfonds	29.661	0	0	29.661
Pensionsgeschafte	0	781	0	781
Finanzderivate ⁽³⁾	840	15.599	0	16.439
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(13.092)	0	(13.092)
Summen	\$ 119.209	\$ 515.610	\$ 9.530	\$ 644.349

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

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen			Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
	(Stufe 1)					
Übertragbare Wertpapiere	\$	157.199		\$	9.155	\$ 758.311
Investmentfonds		15.171			0	15.171
Pensionsgeschäfte		0			476	476
Finanzderivate ⁽³⁾		(174)			263	89
Leerverkaufte Wertpapiere		0			(32.833)	(32.833)
Summen	\$	172.196		\$	559.863	\$ 9.155

⁽¹⁾ Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

⁽²⁾ Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

⁽³⁾ Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung des Marktwerts der außerbörslich gehandelten Finanzderivate und (erhaltenen)/verpfändeten Sicherheiten nach Kontrahenten zum 31. Dezember 2022 und 31. Dezember 2021:

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2022			Zum 31. Dez. 2021		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾
AZD	\$ k. A.	\$ k. A.	\$ k. A.	\$ 13	\$ 0	\$ 13
BOA	(103)	0	(103)	37	(300)	(263)
BOM	(10)	0	(10)	k. A.	k. A.	k. A.
BPS	12	0	12	(775)	630	(145)
BRC	(125)	0	(125)	(1)	0	(1)
CBK	3.416	(3.380)	36	183	(130)	53
DUB	(14)	0	(14)	9	0	9
FAR	(25)	0	(25)	k. A.	k. A.	k. A.
FBF	k. A.	k. A.	k. A.	13	0	13
GLM	(221)	81	(140)	(170)	260	90
GST	(156)	191	35	287	(340)	(53)
HUS	17	0	17	95	0	95
JPM	67	0	67	10	0	10
MBC	2.861	(2.480)	381	k. A.	k. A.	k. A.
MEI	(4)	0	(4)	9	0	9
MYC	(63)	94	31	61	(76)	(15)
MYI	(71)	(96)	(167)	(26)	0	(26)
RBC	21	0	21	1.380	(900)	480
RYL	k. A.	k. A.	k. A.	14	0	14
SAL	(26)	0	(26)	154	(260)	(106)
SCX	3.628	(3.470)	158	1.594	(1.000)	594
SOG	(53)	0	(53)	k. A.	k. A.	k. A.
SSB	11	0	11	59	0	59
TOR	k. A.	k. A.	k. A.	1.561	(1.000)	561
UAG	(41)	10	(31)	(13)	0	(13)

⁽¹⁾ Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2022:

	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	59,01	69,92
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	59,05	47,30
Sonstige übertragbare Wertpapiere	2,47	5,11
Investmentfonds	5,86	2,45
Pensionsgeschäfte	0,15	0,08
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,10	0,01
Zentral abgerechnete Finanzderivate	1,34	(0,72)
Freiverkehrsfinanzderivate	1,80	0,72
Leerverkaufte Wertpapiere	(2,58)	(5,30)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	k. A.	(0,30)

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2022 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
Kreditbeteiligungen und -abtretungen	1,83	3,82
Unternehmensanleihen und Wechsel	14,21	25,35
Wandelanleihen und Wechsel	k. A.	0,00
Kommunalanleihen und Wechsel	0,08	0,42
US-Regierungsbehörden	31,14	27,41
US-Schatzobligationen	14,89	9,97
Non-Agency-MBS	5,69	6,35

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
Forderungsbesicherte Wertpapiere	16,75	15,46
Staatsemissionen	4,32	6,93
Stammaktien	24,18	25,12
Bezugsrechte	0,02	k. A.
Optionsscheine	0,01	0,01
Vorzugswertpapiere	0,42	0,33
Real Estate Investment Trusts	5,31	0,99
Kurzfristige Instrumente	1,68	0,17
Investmentfonds	5,86	2,45
Pensionsgeschäfte	0,15	0,08
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,10	0,01
Verkaufsoptionen		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	0,00	k. A.
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf	0,01	0,03
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,21	0,05
Zinsswaps	1,12	(0,80)
Freiverkehrsfinauzderivate		
Optionskauf		
Optionen auf Wertpapiere	k. A.	0,00
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaptions auf Kreditindizes	0,00	0,00
Devisenoptionen	k. A.	(0,01)
Zinsswapoptionen	(0,09)	(0,03)
Optionen auf Wertpapiere	0,00	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf	(0,05)	0,02
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	(0,02)	0,07
Zinsswaps	k. A.	0,02
Total Return Swaps auf Indizes	0,00	0,00
Devisenterminkontrakte	0,05	(0,05)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	1,91	0,70
Leerverkaufte Wertpapiere	(2,58)	(5,30)
Sonstige Aktiva und Passiva	(27,20)	(19,57)
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	
LCM LP				Venture CLO Ltd.				National Grid Holdings Ltd.				
5,283 % fällig am 20.10.2027	\$	1.817	0,04	5,343 % fällig am 20.01.2029	\$	18.554	0,44	4,810 % fällig am 24.01.2023	\$	6.500	0,16	
Madison Park Euro Funding DAC				WaMu Asset-Backed Certificates WaMu Trust				Quanta Services, Inc.				
2,128 % fällig am 15.01.2032	€	12.300	0,31	4,749 % fällig am 25.04.2037		5.020	0,05	5,100 % fällig am 09.01.2023		6.400	0,15	
Man GLG Euro CLO DAC				Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust				Republic Services, Inc.				
2,736 % fällig am 15.12.2031		11.100	0,28	5,389 % fällig am 25.10.2034	1.054	1.021	0,02	4,650 % fällig am 12.01.2023	8.300	8.286	0,20	
Massachusetts Educational Financing Authority						401.057	9,66			40.404	0,97	
5,308 % fällig am 25.04.2038	\$	6	0,00									
Merrill Lynch First Franklin Mortgage Loan Trust				STAATSEMISSIONEN				HUNGARY TREASURY BILLS				
5,639 % fällig am 25.10.2037		9.587	0,20	Action Logement Services				18,250 % fällig am				
MF1 LLC				0,500 % fällig am 30.10.2034	€	7.600	0,14	03.01.2023 (a)(b)	HUF	2.092.000	5,576	0,14
6,471 % fällig am 19.06.2037		11.300	0,27	Canada Government International Bond				ISRAEL TREASURY BILLS				
Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust				2,250 % fällig am 01.12.2029	CAD	38.600	0,64	0,886 % fällig am 03.05.2023				
4,569 % fällig am 25.05.2037		568	0,01	Development Bank of Japan, Inc.				(a)(b)				
4,589 % fällig am 25.09.2036		961	0,01	0,010 % fällig am 15.10.2024	€	6.600	0,16	0,889 % fällig am 03.05.2023	ILS	24.000	6,722	0,16
4,619 % fällig am 25.11.2036		969	0,01	0,875 % fällig am 10.10.2025		4.300	0,10	(a)(b)		17.820	4,991	0,12
4,689 % fällig am 25.07.2036		7.838	0,08	Hungary Government International Bond				1,181 % fällig am 02.03.2023				
4,709 % fällig am 25.09.2036		7.808	0,09	1,750 % fällig am 05.06.2035		10.000	0,17	(a)(b)		35.600	10,030	0,24
5,094 % fällig am 25.01.2035		1.476	0,03	Israel Government International Bond				1,203 % fällig am 02.03.2023				
5,364 % fällig am 25.04.2035		71	0,00	3,875 % fällig am 03.07.2050	\$	1.000	0,02	(a)(b)		7.400	2,085	0,05
Mountain View CLO Ltd.				4,125 % fällig am 17.01.2048		1.000	0,02				23.828	0,57
4,761 % fällig am 13.10.2027		2.235	0,05	Japan Finance Organization for Municipalities				JAPAN TREASURY BILLS				
New Century Home Equity Loan Trust				0,010 % fällig am 02.02.2028	€	9.900	0,21	(0,120) % fällig am				
4,749 % fällig am 25.05.2036		56	0,00	Ministeries van de Vlaamse Gemeenschap				27.02.2023 (a)(b)	¥	3.520.000	26.685	0,64
5,109 % fällig am 25.10.2035		4.268	0,10	0,875 % fällig am 21.03.2046		10.000	0,15	Summe kurzfristige Instrumente			96.493	2,32
OZLM Ltd.				Paraguay Government International Bond				Summe Übertragbare Wertpapiere		\$	4.770.861	114,93
5,159 % fällig am 17.04.2031		10.246	0,24	4,950 % fällig am 28.04.2031	\$	2.300	0,05					
5,665 % fällig am 30.10.2030		10.881	0,26	Peru Government International Bond				AKTIEN				
Palmer Square European Loan Funding DAC				5,940 % fällig am 12.02.2029	PEN	4.000	0,02	INVESTMENTFONDS				
2,098 % fällig am 15.10.2031	€	11.442	0,29	6,350 % fällig am 12.08.2028		46.400	0,28	ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN				
Palmerston Park CLO DAC				8,200 % fällig am 12.08.2026		12.900	0,09	PIMCO Funds: Global				
2,053 % fällig am 18.04.2030		6.690	0,17	Province of Ontario				Investors Series plc –				
Park Place Securities, Inc.				1,850 % fällig am 01.02.2027	CAD	7.000	0,12	US Short-Term				
5,094 % fällig am 25.09.2035	\$	179	0,00	Romania Government International Bond				Fund (e)		9.400.658	93,819	2,26
Purple Finance CLO DAC				3,000 % fällig am 27.02.2027	\$	12.000	0,26	PIMCO Select Funds plc –				
2,343 % fällig am 25.01.2031	€	1.114	0,03	United Kingdom Gilt				PIMCO US Dollar				
Renaissance Home Equity Loan Trust				0,875 % fällig am 31.07.2033	£	1.300	0,03	Short-Term Floating				
5,589 % fällig am 25.11.2034	\$	155	0,00			101.970	2,46	NAV Fund (e)		19.952.031	198,602	4,79
Residential Asset Securities Corp. Trust				KURZFRISTIGE INSTRUMENTE				Summe Investmentfonds		\$	292.421	7,05
5,069 % fällig am 25.11.2035		38	0,00	COMMERCIAL PAPER								
Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust				CNH Industrial Capital LLC								
4,629 % fällig am 25.11.2036		5.966	0,04	4,950 % fällig am 21.02.2023	\$	5.200	0,12					
4,669 % fällig am 25.05.2036		448	0,01	Crown Castle International Corp.								
Starwood Commercial Mortgage Trust				5,000 % fällig am 04.01.2023		6.000	0,14					
5,520 % fällig am 15.07.2038		7.836	0,18	Fiserv, Inc.								
Structured Asset Investment Loan Trust				4,630 % fällig am 09.01.2023		8.100	0,20					
4,769 % fällig am 25.03.2036		635	0,01									
5,154 % fällig am 25.08.2035		520	0,01									
Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust												
4,544 % fällig am 25.09.2036		7.383	0,11									

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kapital- betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions- geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions- geschäft ⁽¹⁾	% des Nettovermögens
BOS	4,190 %	30.12.2022	03.01.2023	\$ 26.100	U.S. Treasury Bonds 2,875 % fällig am 15.05.2049	\$ (26.800)	\$ 26.100	\$ 26.112	0,63
FICC	1,900	30.12.2022	03.01.2023	5.795	U.S. Treasury Notes 0,125 % fällig am 15.05.2023	(5.911)	5.795	5.796	0,14
	4,280	30.12.2022	03.01.2023	139.000	U.S. Treasury Notes 0,250 % fällig am 31.10.2025	(141.780)	139.000	139.066	3,35
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (174.491)	\$ 170.895	\$ 170.974	4,12

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 146,000 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond February 2023 Futures ⁽¹⁾	Short	01.2023	71	\$ 57	0,00
Euro-Bobl March Futures	Short	03.2023	1.494	5.783	0,14
Euro-BTP Italy Government Bond March Futures	Short	03.2023	695	6.007	0,14

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Total Return Bond Fund (Forts.)

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Euro-Bund 10-Year Bond March Futures	Short	03.2023	1.745	\$ 15.686	0,38
Euro-Buxl 30-Year Bond March Futures	Short	03.2023	107	2.781	0,07
Euro-OAT France Government 10-Year Bond March Futures	Short	03.2023	643	6.492	0,16
Japan Government 10-Year Bond March Futures	Short	03.2023	137	2.774	0,07
Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 138,500 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond February 2023 Futures ⁽¹⁾	Short	01.2023	71	(363)	(0,01)
U.S. Treasury 2-Year Note March Futures	Long	03.2023	660	89	0,00
U.S. Treasury 5-Year Note March Futures	Long	03.2023	2.010	(406)	(0,01)
U.S. Treasury 10-Year Note March Futures	Long	03.2023	2.853	(2.657)	(0,06)
U.S. Treasury 30-Year Bond March Futures	Long	03.2023	148	(168)	(0,01)
				<u>\$ 36.075</u>	<u>0,87</u>

⁽¹⁾ Future-Style-Option.

VERKAUFSOPTIONEN

OPTIONEN AUF BÖRSEGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Ausübungs- kurs	Verfalls- datum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Markt- wert	% des Nettovermögens
Call – CME Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 98,000 USD auf 3-Month SOFR December Futures	\$ 98,000	15.12.2023	70	\$ (57)	\$ (6)	0,00
Put – CME Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 96,500 USD auf 3-Month SOFR December Futures	96,500	15.12.2023	70	(65)	(212)	(0,01)
				<u>\$ (122)</u>	<u>\$ (218)</u>	<u>(0,01)</u>
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate					<u>\$ 35.857</u>	<u>0,86</u>

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZKAUF⁽¹⁾

Referenzeinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽³⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Verizon Communications, Inc.	(1,000) %	20.06.2027	\$ 5.200	\$ (23)	0,00

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽²⁾

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽³⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AT&T, Inc.	1,000 %	20.06.2023	\$ 6.400	\$ 12	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.12.2023	7.300	(81)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2024	12.400	21	0,00
Barclays Bank PLC	1,000	20.12.2023	€ 3.900	7	0,00
Boeing Co.	1,000	20.12.2025	\$ 4.600	48	0,00
Boeing Co.	1,000	20.12.2027	4.600	126	0,00
General Electric Co.	1,000	20.12.2023	8.300	447	0,01
General Electric Co.	1,000	20.06.2024	4.700	41	0,00
General Electric Co.	1,000	20.12.2024	5.500	129	0,01
Rolls-Royce PLC	1,000	20.06.2025	€ 14.500	2.067	0,05
Ryder System, Inc.	1,000	20.12.2023	\$ 1.500	31	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.12.2027	6.700	40	0,00
				<u>\$ 2.888</u>	<u>0,07</u>

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF⁽¹⁾

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽³⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.HY-35 5-Year Index	(5,000) %	20.12.2025	\$ 9.504	\$ 412	0,01
CDX.HY-36 5-Year Index	(5,000)	20.06.2026	5.346	347	0,01
CDX.HY-38 5-Year Index	(5,000)	20.06.2027	98.109	(4.620)	(0,11)
CDX.IG-39 5-Year Index	(1,000)	20.12.2027	339.400	(395)	(0,01)
iTraxx Europe Main 38 5-Year Index	(1,000)	20.12.2027	€ 46.000	(647)	(0,02)
				<u>\$ (4.903)</u>	<u>(0,12)</u>

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt	variabler Zinssatz	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	0,900 %	10.03.2052	£ 6.600	\$ 3.205	0,08
Erhalt	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	0,900	11.03.2052	6.600	3.696	0,09
Erhalt	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	0,900	15.03.2052	8.400	3.872	0,09

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt ⁽¹⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	2,000 %	15.03.2033	£ 25.700	\$ 333	0,01
Erhalt ⁽¹⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	2,000	15.03.2053	6.300	55	0,00
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,062	18.09.2026	¥ 3.550.000	(595)	(0,01)
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,063	19.09.2026	7.000	(1)	0,00
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,064	19.09.2026	877.000	(149)	0,00
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,380	18.06.2028	5.170.000	(909)	(0,02)
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,500	15.03.2042	4.651.000	3.044	0,07
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,662	19.04.2042	260.000	189	0,00
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,705	31.10.2038	1.180.000	554	0,01
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,750	20.03.2038	436.000	144	0,00
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,750	20.12.2038	1.947.000	923	0,02
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,785	12.11.2038	600.000	267	0,01
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,800	22.10.2038	400.000	170	0,00
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,800	15.06.2052	4.070.000	3.875	0,09
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,573	28.02.2027	\$ 5.500	(483)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,635	18.04.2027	30.000	(2.625)	(0,06)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,690	19.04.2027	30.000	(2.545)	(0,06)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,730	24.02.2032	14.800	(2.072)	(0,05)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	21.12.2052	65.900	4.522	0,11
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,765	16.03.2032	45.000	(6.195)	(0,15)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,783	22.04.2027	16.200	(1.307)	(0,03)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,943	21.04.2032	14.800	(1.826)	(0,04)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,150	15.06.2027	88.100	(5.894)	(0,14)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,680	11.07.2032	31.600	(1.842)	(0,04)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,690	11.07.2032	31.600	(1.809)	(0,04)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,050	08.09.2029	6.800	(202)	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,050	14.12.2052	12.100	451	0,01
Erhalt ⁽¹⁾	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,270	13.09.2024	51.400	68	0,00
Erhalt ⁽¹⁾	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,350	14.09.2024	31.000	16	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	7,900	02.01.2024	BRL 8.600	27	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,838	02.01.2025	385.800	(2.772)	(0,07)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,065	02.01.2024	115.000	(615)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,371	02.01.2025	144.500	(766)	(0,02)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,587	02.01.2025	135.800	467	0,01
Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,663	02.01.2025	242.300	737	0,02
Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,692	02.01.2025	344.400	1.017	0,02
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,005	02.01.2025	139.300	(359)	(0,01)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	12,030	02.01.2024	202.300	673	0,02
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,195	02.01.2025	68.200	(144)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,200	02.01.2025	151.400	(293)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,275	02.01.2025	41.300	(76)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,590	02.01.2025	49.300	(38)	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	12,835	02.01.2024	116.600	129	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	12,958	02.01.2024	114.600	95	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,980	04.01.2027	93.500	194	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,990	04.01.2027	46.800	99	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	13,024	04.01.2027	46.800	106	0,00
Zahlung	3-Month NZD-BBR	3,750	15.06.2027	NZD 39.100	(642)	(0,02)
Zahlung ⁽¹⁾	3-Month NZD-BBR	4,000	14.06.2024	115.900	(734)	(0,02)
Zahlung	3-Month NZD-BBR	4,250	21.12.2027	3.300	(59)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,550	10.08.2024	€ 4.000	(172)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,650	12.04.2027	25.000	(2.564)	(0,06)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,000	13.05.2027	21.000	(1.856)	(0,04)
Zahlung ⁽¹⁾	6-Month EUR-EURIBOR	1,580	24.05.2024	239.500	(4.809)	(0,12)
Zahlung ⁽¹⁾	6-Month EUR-EURIBOR	1,750	15.03.2033	141.600	(17.576)	(0,42)
					\$ (33.001)	(0,79)
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					\$ (35.039)	(0,84)

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

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

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Total Return Bond Fund (Forts.)

(3) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert.

(4) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

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

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

OPTIONSKAUF

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag ⁽¹⁾	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,750 %	12.09.2023	124.000	\$ 992	\$ 1.008	0,03
FAR	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,750	11.09.2023	116.900	877	950	0,02
MYC	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,750	11.09.2023	116.700	887	948	0,02
							\$ 2.756	\$ 2.906	0,07

VERKAUFSoPTIONEN

CREDIT DEFAULT SWAPIONS AUF KREDITINDIZES

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/-verkauf	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
GST	Put – OTC iTraxx Europe 37 5-Year Index	Verkauf	3,000 %	15.03.2023	6.100	\$ (11)	\$ (1)	0,00

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,250 %	12.09.2023	124.000	\$ (620)	\$ (627)	(0,02)
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,750	12.09.2023	124.000	(372)	(353)	(0,01)
	Call – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,150	01.12.2023	68.600	(213)	(49)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	01.12.2023	68.600	(213)	(519)	(0,01)
BPS	Call – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,870	23.01.2023	2.300	(17)	(7)	0,00
	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,320	23.01.2023	2.300	(17)	(29)	0,00
	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,900	17.01.2023	4.100	(17)	0	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,400	17.01.2023	4.100	(17)	(69)	0,00
FAR	Call – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,610	17.01.2023	2.000	(18)	0	0,00
	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,110	17.01.2023	2.000	(18)	(57)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,233	11.09.2023	116.900	(549)	(602)	(0,02)
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,715	11.09.2023	116.900	(327)	(347)	(0,01)
GLM	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,000	12.01.2023	5.100	(28)	(1)	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,550	12.01.2023	5.100	(28)	(43)	0,00
	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,547	07.03.2023	7.400	(163)	(17)	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,547	07.03.2023	7.400	(163)	(466)	(0,01)
MYC	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,067	09.06.2023	9.100	(107)	(23)	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	3,140	09.06.2023	9.100	(126)	(298)	(0,01)
	Call – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,740	19.01.2023	2.000	(17)	(1)	0,00
	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,180	19.01.2023	2.000	(17)	(45)	0,00
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,233	11.09.2023	116.700	(560)	(601)	(0,01)
	Put – OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,715	11.09.2023	116.700	(327)	(346)	(0,01)
	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,070	23.01.2023	4.300	(21)	(3)	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,520	23.01.2023	4.300	(21)	(51)	0,00
							\$ (4.008)	\$ (4.631)	(0,11)

OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.02.2053	\$ 99,813	06.02.2023	700	\$ (5)	\$ (4)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.02.2053	100,000	06.02.2023	500	(3)	(4)	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.02.2053	101,813	06.02.2023	700	(4)	(2)	0,00
SAL	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.02.2053	102,000	06.02.2023	500	(3)	(1)	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.01.2053	101,859	05.01.2023	9.600	(28)	0	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.01.2053	102,250	05.01.2023	7.000	(21)	0	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.02.2053	99,750	06.02.2023	4.800	(34)	(29)	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.02.2053	100,000	06.02.2023	3.200	(22)	(22)	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.02.2053	101,750	06.02.2023	4.800	(28)	(11)	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.02.2053	102,000	06.02.2023	3.200	(19)	(6)	0,00
					\$ (167)	\$ (79)	0,00

(1) Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽²⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BPS	Colombia Government International Bond	1,000 %	20.06.2027	\$ 1.600	\$ (77)	\$ (18)	\$ (95)	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2027	400	(36)	7	(29)	0,00
BRC	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2026	2.325	(108)	1	(107)	0,00
CBK	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2027	700	(25)	(17)	(42)	0,00
GST	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2027	3.000	(112)	(66)	(178)	(0,01)
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2027	1.300	(116)	22	(94)	0,00
JPM	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2026	2.275	(104)	0	(104)	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2027	400	(15)	(9)	(24)	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2023	100	(5)	5	0	0,00
MYC	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2027	2.900	(104)	(69)	(173)	(0,01)
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2027	3.400	(303)	56	(247)	(0,01)
					\$ (1.005)	\$ (88)	\$ (1.093)	(0,03)

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

⁽²⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert.

DEVISENTERMINKONTRÄKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2023	€ 10.994	\$ 11.620	\$ 0	\$ (118)	\$ (118)	0,00
	01.2023	\$ 1.250	€ 1.176	5	0	5	0,00
	01.2023	4.153	£ 3.458	7	0	7	0,00
	02.2023	5.628	¥ 752.000	112	(9)	103	0,00
	03.2023	ILS 7.339	\$ 2.163	77	0	77	0,00
	05.2023	PEN 16.565	4.222	0	(77)	(77)	0,00
BPS	01.2023	\$ 5.544	€ 5.200	8	0	8	0,00
	01.2023	1.178	£ 975	0	(5)	(5)	0,00
	01.2023	143	ILS 489	0	(4)	(4)	0,00
	03.2023	INR 8.501	\$ 102	0	0	0	0,00
	03.2023	\$ 15.473	CLP 14.941.563	1.877	0	1.877	0,05
	03.2023	319	PEN 1.241	4	0	4	0,00
BRC	01.2023	2.888	£ 2.338	0	(75)	(75)	0,00
CBK	01.2023	CLP 14.659.223	\$ 15.385	0	(1.810)	(1.810)	(0,04)
	01.2023	€ 4.275	4.519	0	(46)	(46)	0,00
	01.2023	PEN 37.053	9.206	0	(489)	(489)	(0,01)
	01.2023	\$ 7.962	CAD 10.756	0	(24)	(24)	0,00
	01.2023	16.484	CLP 14.664.168	716	0	716	0,02
	01.2023	14.941	€ 14.083	95	0	95	0,00
	02.2023	CLP 14.744.940	\$ 16.484	0	(728)	(728)	(0,02)
	02.2023	PEN 10.603	2.659	0	(113)	(113)	0,00
	02.2023	\$ 20.986	BRL 113.258	349	0	349	0,01
	03.2023	PEN 13.369	\$ 3.325	0	(161)	(161)	0,00
	03.2023	\$ 440	PEN 1.728	10	0	10	0,00
	05.2023	ILS 41.467	\$ 12.431	595	0	595	0,01
	05.2023	PEN 44.643	11.075	0	(515)	(515)	(0,01)
CLY	03.2023	\$ 1.959	PEN 7.534	4	0	4	0,00
DUB	03.2023	ILS 35.310	\$ 10.411	374	0	374	0,01
GLM	01.2023	CNH 297	43	0	0	0	0,00
	01.2023	HKD 3.546	456	1	0	1	0,00
	01.2023	HUF 2.077.171	5.318	0	(218)	(218)	(0,01)
	03.2023	MXN 2.194	107	0	(4)	(4)	0,00
	05.2023	\$ 11.078	PEN 44.209	393	0	393	0,01
JPM	02.2023	TWD 171	\$ 6	0	0	0	0,00
MBC	01.2023	AUD 4.107	2.781	7	(11)	(4)	0,00
	01.2023	£ 168	206	3	0	3	0,00
	01.2023	HKD 14.719	1.891	4	0	4	0,00
	01.2023	\$ 15.141	€ 14.227	49	0	49	0,00
	01.2023	4.148	£ 3.404	0	(52)	(52)	0,00
	02.2023	¥ 4.154.600	\$ 30.017	0	(1.688)	(1.688)	(0,04)
	05.2023	CNH 58.919	8.779	181	0	181	0,00
MYI	01.2023	AUD 45.113	30.295	0	(305)	(305)	(0,01)
	01.2023	€ 1.221	1.301	0	(3)	(3)	0,00
	01.2023	PEN 25.740	6.645	0	(89)	(89)	0,00
	01.2023	SGD 94	70	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 186	£ 154	0	0	0	0,00
	01.2023	4	SGD 6	0	0	0	0,00
	02.2023	TWD 316	\$ 10	0	0	0	0,00
RBC	01.2023	AUD 520	348	0	(4)	(4)	0,00
SCX	01.2023	CAD 15.783	11.748	99	0	99	0,00
	01.2023	€ 800.094	832.778	0	(21.488)	(21.488)	(0,52)
	01.2023	NZD 3.254	2.027	0	(31)	(31)	0,00
	01.2023	\$ 25.464	£ 20.567	0	(720)	(720)	(0,02)
	01.2023	989	PEN 3.796	6	0	6	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Total Return Bond Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	02.2023	TWD 3.151	\$ 102	\$ 0	\$ (1)	\$ (1)	0,00
	03.2023	CLP 385.592	432	0	(16)	(16)	0,00
	03.2023	PEN 3.988	1.036	0	(3)	(3)	0,00
	03.2023	\$ 1.394	PEN 5.387	9	0	9	0,00
	04.2023	2.852	11.545	146	0	146	0,00
TOR	01.2023	CAD 40.123	\$ 29.847	234	0	234	0,01
	01.2023	£ 255.908	307.676	0	(206)	(206)	(0,01)
UAG	01.2023	CZK 5.209	205	0	(25)	(25)	0,00
	05.2023	\$ 8.473	CNH 58.716	96	0	96	0,00
				\$ 5.461	\$ (29.038)	\$ (23.577)	(0,57)

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilsklasse Institutional CAD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	01.2023	CAD 6.407	\$ 4.702	\$ 0	\$ (27)	\$ (27)	0,00
BOA	01.2023	\$ 2.998	CAD 4.053	0	(6)	(6)	0,00
CBK	01.2023	CAD 81	\$ 60	0	0	0	0,00
MBC	01.2023	\$ 5.523	CAD 7.473	0	(8)	(8)	0,00
MYI	01.2023	CAD 81	\$ 60	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 14	CAD 19	0	0	0	0,00
SCX	01.2023	1.403	1.885	0	(12)	(12)	0,00
TOR	01.2023	4.949	6.653	0	(39)	(39)	0,00
				\$ 0	\$ (92)	\$ (92)	0,00

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional CHF (Hedged) thesaurierend, Investor CHF (Hedged) thesaurierend und E CHF (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2023	\$ 6.327	CHF 5.979	\$ 140	\$ 0	\$ 140	0,00
BRC	01.2023	8	8	0	0	0	0,00
CBK	01.2023	10.180	9.617	221	0	221	0,01
MBC	01.2023	CHF 130	\$ 140	0	(1)	(1)	0,00
	01.2023	\$ 295	CHF 272	0	0	0	0,00
MYI	01.2023	CHF 28	\$ 31	0	0	0	0,00
SCX	01.2023	9	9	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 141	CHF 131	1	0	1	0,00
UAG	01.2023	CHF 17	\$ 19	0	0	0	0,00
				\$ 362	\$ (1)	\$ 361	0,01

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Investor EUR (Hedged) thesaurierend, Administrative EUR (Hedged) thesaurierend, E EUR (Hedged) thesaurierend, E EUR (Hedged) ausschüttend, R EUR (Hedged) thesaurierend und T EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2023	\$ 643	€ 610	\$ 8	\$ 0	\$ 8	0,00
BPS	01.2023	2.472	2.318	3	0	3	0,00
CBK	01.2023	€ 6.485	\$ 6.913	0	(10)	(10)	0,00
	01.2023	\$ 372.774	€ 359.186	10.729	0	10.729	0,26
MBC	01.2023	€ 196	\$ 207	0	(2)	(2)	0,00
	01.2023	\$ 435.363	€ 415.264	8.017	0	8.017	0,19
SCX	01.2023	389.990	374.685	10.062	0	10.062	0,24
				\$ 28.819	\$ (12)	\$ 28.807	0,69

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend und Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2023	£ 38	\$ 46	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	01.2023	\$ 359	£ 295	0	(4)	(4)	0,00
BPS	01.2023	11	9	0	0	0	0,00
BRC	01.2023	£ 171	\$ 205	0	0	0	0,00
JPM	01.2023	\$ 13.134	£ 10.877	0	(48)	(48)	0,00
MBC	01.2023	£ 636	\$ 778	13	0	13	0,00
	01.2023	\$ 13.309	£ 11.092	53	(18)	35	0,00
MYI	01.2023	414	337	0	(9)	(9)	0,00
TOR	01.2023	13.090	10.888	9	0	9	0,00
UAG	01.2023	165	134	0	(5)	(5)	0,00
				\$ 75	\$ (84)	\$ (9)	0,00

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional SGD (Hedged) thesaurierend und E SGD (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	01.2023	\$ 18	SGD 24	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
BOA	01.2023	12.174	16.707	285	0	285	0,01
BPS	01.2023	13.178	18.067	294	0	294	0,01
GLM	01.2023	SGD 10	\$ 7	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 619	SGD 847	12	0	12	0,00
MBC	01.2023	SGD 7.787	\$ 5.739	0	(68)	(68)	(0,01)
	01.2023	\$ 12.761	SGD 17.446	249	0	249	0,01
RBC	01.2023	SGD 15	\$ 11	0	0	0	0,00
RYL	01.2023	\$ 58	SGD 79	1	0	1	0,00
SCX	01.2023	6	7	0	0	0	0,00
SOG	01.2023	SGD 7.051	\$ 5.224	0	(34)	(34)	0,00
UAG	01.2023	217	158	0	(4)	(4)	0,00
	01.2023	\$ 24	SGD 32	0	0	0	0,00
				\$ 841	\$ (106)	\$ 735	0,02
Summe Freiverkehrsfinaizderivate						\$ 3.327	0,08

LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN			
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA			
2,000 % fällig am 01.02.2053	\$ 32.300	\$ (26.317)	(0,63)
2,500 % fällig am 01.02.2053	49.700	(42.140)	(1,02)
Summe Leerverkaufte Wertpapiere		\$ (68.457)	(1,65)
Summe Anlagen		\$ 5.169.865	124,55
Sonstige Aktiva und Passiva		\$ (1.019.148)	(24,55)
Nettovermögen		\$ 4.150.717	100,00

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

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

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Nullkuponwertpapier.

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

(c) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

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

(e) Mit dem Fonds verbunden.

(f) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(g) Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von 1.858 USD (31. Dezember 2021: 226.010 USD) und Barmittel in Höhe von 0 USD (31. Dezember 2021: 38 USD) wurden gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen zum 31. Dezember 2022 als Sicherheiten verpfändet.

(h) Wertpapier mit einem Gesamtmarktwert von 25.953 USD (31. Dezember 2021: 0 USD) wurde gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte zum 31. Dezember 2022 als Sicherheit für verzögert gelieferte Wertpapiere oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte verpfändet oder geliefert.

Barmittel in Höhe von 94.783 USD (31. Dezember 2021: 70.987 USD) wurden zum 31. Dezember 2022 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 13.885 USD (31. Dezember 2021: 19.884 USD) wurden gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. zum 31. Dezember 2022 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 4.765.456	\$ 5.405	\$ 4.770.861
Investmentfonds	292.421	0	0	292.421
Pensionsgeschäfte	0	170.895	0	170.895
Finanzderivate ⁽³⁾	39.217	(35.072)	0	4.145
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(68.457)	0	(68.457)
Summen	\$ 331.638	\$ 4.832.822	\$ 5.405	\$ 5.169.865

Aufstellung der Wertpapieranlagen des Total Return Bond Fund (Forts.)

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

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 5.405.196	\$ 0	\$ 5.405.196
Investmentfonds	423.494	0	0	423.494
Pensionsgeschäfte	0	7.152	0	7.152
Finanzderivate ⁽³⁾	11.552	(9.935)	0	1.617
Summen	\$ 435.046	\$ 5.402.413	\$ 0	\$ 5.837.459

⁽¹⁾ Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

⁽²⁾ Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

⁽³⁾ Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions- geschäften	% des Nettovermögens
BRC	0,550 %	21.09.2022	TBD ⁽¹⁾	€ (438)	\$ (468)	(0,01)
	0,600	20.09.2022	TBD ⁽¹⁾	(1.196)	(1.277)	(0,03)
Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte					\$ (1.745)	(0,04)

⁽¹⁾ Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

Ausstehende Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zum 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kredit- betrag	Zahlbar für Rückkauf- finanzierungs- geschäfte ⁽¹⁾	% des Nettovermögens
BPG	(1,500) %	30.12.2022	03.01.2023	\$ (26.267)	\$ (26.264)	(0,63)
	(1,350)	29.12.2022	30.12.2022	(25.647)	(25.646)	(0,62)
	(1,000)	28.12.2022	29.12.2022	(24.900)	(24.899)	(0,60)
Summe Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte					\$ (76.809)	(1,85)

⁽¹⁾ In dem für Rückkaufgeschäfte zahlbaren Betrag sind 1 USD für einen aufgeschobenen Kursrückgang enthalten.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung des Marktwerts der außerbörslich gehandelten Finanzderivate und (erhaltenen)/verpfändeten Sicherheiten nach Kontrahenten zum 31. Dezember 2022 und 31. Dezember 2021:

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2022			Zum 31. Dez. 2021		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾
AZD	\$ (27)	\$ 0	\$ (27)	\$ k. A.	\$ k. A.	\$ k. A.
BOA	(167)	280	113	(530)	260	(270)
BPS	1.927	(1.740)	187	(1.860)	1.690	(170)
BRC	(182)	20	(162)	8	0	8
CBK	8.777	(8.710)	67	(3.347)	3.582	235
CLY	4	0	4	k. A.	k. A.	k. A.
DUB	374	(270)	104	(1)	0	(1)
FAR	1	0	1	k. A.	k. A.	k. A.
GLM	(710)	600	(110)	(2.389)	2.430	41
GSC	k. A.	k. A.	k. A.	(6)	0	(6)
GST	(273)	260	(13)	14	0	14
HUS	k. A.	k. A.	k. A.	(1.776)	1.610	(166)
JPM	(176)	0	(176)	(1.072)	940	(132)
MBC	6.728	(6.220)	508	k. A.	k. A.	k. A.
MYC	(550)	470	(80)	k. A.	k. A.	k. A.
MYI	(406)	270	(136)	(370)	560	190
RBC	(4)	0	(4)	(3.080)	1.730	(1.350)
RYL	1	0	1	k. A.	k. A.	k. A.
SAL	(68)	0	(68)	(121)	202	81
SCX	(11.948)	11.385	(563)	(6.511)	6.880	369
SOG	(34)	0	(34)	k. A.	k. A.	k. A.
TOR	(2)	600	598	2.233	(1.550)	683
UAG	62	0	62	755	(650)	105

⁽¹⁾ Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2022:

	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	66,92	66,72
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	47,33	41,50
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,68	1,09
Investmentfonds	7,05	8,56
Pensionsgeschäfte	4,12	0,14
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,86	0,28
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,84)	0,12
Freiverkehrsfinanzderivate	0,08	(0,36)
Leerverkaufte Wertpapiere	(1,65)	k. A.
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(0,04)	(4,57)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	(1,85)	k. A.

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2022 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
Unternehmensanleihen und Wechsel	36,37	48,35
Kommunalanleihen und Wechsel	0,28	0,62
US-Regierungsbehörden	37,34	19,94
US-Schatzobligationen	17,09	15,86
Non-Agency-MBS	9,41	10,80
Forderungsbesicherte Wertpapiere	9,66	8,48
Staatsemissionen	2,46	3,77
Kurzfristige Instrumente	2,32	1,49
Investmentfonds	7,05	8,56
Pensionsgeschäfte	4,12	0,14
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,87	0,28
Verkaufsoptionen		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	(0,01)	0,00
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzkauf	0,00	k. A.
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf	0,07	0,06
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	(0,12)	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	k. A.	0,00
Zinsswaps	(0,79)	0,06
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Zinsswapoptionen	0,07	0,08
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes	0,00	k. A.
Zinsswapoptionen	(0,11)	(0,15)
Optionen auf Wertpapiere	0,00	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf	(0,03)	0,00
Devisenterminkontrakte	(0,57)	(0,62)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,72	0,33
Leerverkaufte Wertpapiere	(1,65)	k. A.
Sonstige Aktiva und Passiva	(24,55)	(18,05)
Nettovermögen	100,00	100,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE											
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL											
BANKEN UND FINANZEN											
American Express Co. 4,785 % fällig am 03.05.2024	\$ 1.400	\$ 1.399	0,32	JPMorgan Chase & Co. 0,969 % fällig am 23.06.2025 3,559 % fällig am 23.04.2024	\$ 1.000 2.000	\$ 933 1.987	0,21 0,46	CNH Industrial NV 4,500 % fällig am 15.08.2023	\$ 1.606	\$ 1.596	0,37
American Tower Corp. 3,000 % fällig am 15.06.2023 3,500 % fällig am 31.01.2023	1.000 2.425	990 2.422	0,23 0,56	Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc. 0,848 % fällig am 15.09.2024 3,837 % fällig am 17.04.2026 5,187 % fällig am 26.07.2023	2.800 2.000 500 1.000	2.769 1.931 482 1.002	0,64 0,44 0,11 0,23	Daimler Trucks Finance North America LLC 1,125 % fällig am 14.12.2023 4,918 % fällig am 14.12.2023	1.500 1.565	1.442 1.556	0,33 0,36
Aozora Bank Ltd. 1,050 % fällig am 09.09.2024	500	464	0,11	Mizuho Financial Group, Inc. 3,549 % fällig am 05.03.2023 4,899 % fällig am 10.07.2024 5,555 % fällig am 05.03.2023	300 1.100 250	299 1.098 250	0,07 0,25 0,06	Dell International LLC 5,450 % fällig am 15.06.2023	1.007	1.008	0,23
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. 0,875 % fällig am 18.09.2023	3.600	3.487	0,80	Morgan Stanley 0,529 % fällig am 25.01.2024	2.500	2.483	0,57	Gilead Sciences, Inc. 0,750 % fällig am 29.09.2023	1.900	1.841	0,42
Bank of America Corp. 5,555 % fällig am 05.03.2024	100	100	0,02	Nationwide Building Society 0,550 % fällig am 22.01.2024 3,766 % fällig am 08.03.2024	600 3.800	570 3.779	0,13 0,86	HCA, Inc. 5,000 % fällig am 15.03.2024	1.100	1.094	0,25
Bank of Nova Scotia 0,550 % fällig am 15.09.2023 5,245 % fällig am 11.03.2024	1.000 500	969 499	0,22 0,11	NatWest Group PLC 6,274 % fällig am 25.06.2024	1.000	1.000	0,23	Heineken NV 2,750 % fällig am 01.04.2023	4.000	3.976	0,91
Barclays PLC 4,967 % fällig am 15.06.2023	AUD 500	339	0,08	Nissan Motor Acceptance Co. LLC 5,375 % fällig am 08.03.2024	700	689	0,16	Hyundai Capital America 0,800 % fällig am 08.01.2024	2.000	1.903	0,44
BNP Paribas S.A. 3,500 % fällig am 01.03.2023 3,800 % fällig am 10.01.2024	\$ 1.500 2.133	1.496 2.097	0,34 0,48	Nomura Holdings, Inc. 2,648 % fällig am 16.01.2025	3.300	3.118	0,72	Illumina, Inc. 0,550 % fällig am 23.03.2023	2.000	1.980	0,45
BPCE S.A. 4,000 % fällig am 12.09.2023	1.500	1.484	0,34	Nordea Bank Abp 5,675 % fällig am 30.08.2023	1.000	1.001	0,23	Imperial Brands Finance PLC 3,125 % fällig am 26.07.2024	1.100	1.052	0,24
Canadian Imperial Bank of Commerce 5,122 % fällig am 17.03.2023	2.500	2.503	0,57	ORIX Corp. 4,050 % fällig am 16.01.2024	3.000	2.958	0,68	Kinder Morgan, Inc. 5,359 % fällig am 15.01.2023	1.000	1.000	0,23
Capital One Financial Corp. 5,476 % fällig am 09.05.2025	2.400	2.372	0,54	Pacific Life Global Funding 4,867 % fällig am 04.06.2026	1.200	1.153	0,26	Leidos, Inc. 2,950 % fällig am 15.05.2023	3.685	3.656	0,84
Citigroup, Inc. 1,678 % fällig am 15.05.2024 5,750 % fällig am 17.05.2024	1.000 300	986 301	0,23 0,07	Protective Life Global Funding 0,502 % fällig am 12.04.2023	1.400	1.383	0,32	Mercedes-Benz Finance North America LLC 5,500 % fällig am 27.11.2024	800	805	0,18
CK Hutchison International Ltd. 3,250 % fällig am 11.04.2024	1.000	977	0,22	Reliance Standard Life Global Funding 2,150 % fällig am 21.01.2023	2.000	1.997	0,46	Microchip Technology, Inc. 4,333 % fällig am 01.06.2023	1.000	996	0,23
CNH Industrial Capital LLC 1,950 % fällig am 02.07.2023	1.800	1.770	0,41	Santander UK Group Holdings PLC 3,373 % fällig am 05.01.2024 4,796 % fällig am 15.11.2024	1.500 1.500	1.500 1.475	0,34 0,34	Mitsubishi Corp. 3,375 % fällig am 23.07.2024	600	582	0,13
Cooperative Rabobank UA 1,980 % fällig am 15.12.2027	500	435	0,10	Societe Generale S.A. 4,250 % fällig am 14.09.2023	1.661	1.647	0,38	Nissan Motor Co. Ltd. 3,043 % fällig am 15.09.2023	1.600	1.568	0,36
Credit Suisse AG 4,260 % fällig am 26.05.2023	AUD 1.000	673	0,15	Standard Chartered PLC 5,123 % fällig am 23.11.2025	200	194	0,04	NXP BV 4,875 % fällig am 01.03.2024	1.500	1.489	0,34
Danske Bank A/S 5,375 % fällig am 12.01.2024 5,795 % fällig am 12.09.2023	\$ 900 2.138	893 2.138	0,20 0,49	Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc. 4,318 % fällig am 07.03.2023	AUD 1.200	814	0,19	Penske Truck Leasing Co. LP 4,250 % fällig am 17.01.2023	1.400	1.400	0,32
Deutsche Bank AG 0,898 % fällig am 28.05.2024 (d) 3,950 % fällig am 27.02.2023	1.000 2.000	936 1.993	0,21 0,46	Toronto-Dominion Bank 5,183 % fällig am 08.03.2024	\$ 200	200	0,05	SK Broadband Co. Ltd. 3,875 % fällig am 13.08.2023	1.000	992	0,23
Federation des Caisses Desjardins du Quebec 4,618 % fällig am 21.05.2024	500	494	0,11	UBS AG 4,565 % fällig am 09.08.2024	1.200	1.192	0,27	SK Hynix, Inc. 1,000 % fällig am 19.01.2024	600	570	0,13
First Abu Dhabi Bank PJSC 4,145 % fällig am 18.02.2025 5,400 % fällig am 08.08.2023	AUD 500 \$ 1.000	337 1.000	0,08 0,23	INDUSTRIEWERTE		88.333	20,25	Stellantis NV 5,250 % fällig am 15.04.2023	2.070	2.072	0,48
Five Corners Funding Trust 4,419 % fällig am 15.11.2023	2.500	2.479	0,57	7-Eleven, Inc. 0,625 % fällig am 10.02.2023	2.500	2.487	0,57	Sydney Airport Finance Co. Pty. Ltd. 3,900 % fällig am 22.03.2023	4.162	4.151	0,95
GA Global Funding Trust 5,085 % fällig am 11.04.2025	700	685	0,16	Altria Group, Inc. 2,950 % fällig am 02.05.2023	2.000	1.985	0,46	Takeda Pharmaceutical Co. Ltd. 4,400 % fällig am 26.11.2023	333	330	0,08
General Motors Financial Co., Inc. 3,250 % fällig am 05.01.2023 4,738 % fällig am 05.01.2023	2.250 592	2.250 592	0,52 0,14	Ausgrid Finance Pty. Ltd. 3,750 % fällig am 30.10.2024 3,850 % fällig am 01.05.2023	AUD 1.000 \$ 1.500	664 1.493	0,15 0,34	Thermo Fisher Scientific, Inc. 4,160 % fällig am 18.04.2023	600	599	0,14
Goldman Sachs Group, Inc. 4,605 % fällig am 02.05.2024 6,334 % fällig am 29.11.2023	AUD 1.300 \$ 2.700	884 2.721	0,20 0,62	Barry Callebaut Services NV 5,500 % fällig am 15.06.2023	2.500	2.489	0,57	Time Warner Cable Enterprises LLC 8,375 % fällig am 15.03.2023	2.793	2.811	0,64
HSBC Holdings PLC 5,965 % fällig am 11.03.2025	800	793	0,18	BAT Capital Corp. 3,222 % fällig am 15.08.2024	1.000	964	0,22	Tyson Foods, Inc. 3,900 % fällig am 28.09.2023	1.000	991	0,23
Huntington National Bank 5,345 % fällig am 16.05.2025	1.100	1.093	0,25	Baxter International, Inc. 4,495 % fällig am 01.12.2023	3.500	3.474	0,80	Zoetis, Inc. 3,250 % fällig am 01.02.2023	1.500	1.498	0,34
Hyundai Capital Services, Inc. 3,750 % fällig am 05.03.2023	1.270	1.266	0,29	Bayer U.S. Finance LLC 5,779 % fällig am 15.12.2023	2.800	2.794	0,64				
ING Bank Australia Ltd. 4,000 % fällig am 26.05.2025	AUD 1.600	1.062	0,24	Boeing Co. 1,167 % fällig am 04.02.2023 1,875 % fällig am 15.06.2023 4,508 % fällig am 01.05.2023	600 500 3.000	598 492 2.995	0,14 0,11 0,69	VERSORGUNGSUNTERNEHMEN			
ING Groep NV 4,100 % fällig am 02.10.2023	\$ 1.700	1.687	0,39	Central Japan Railway Co. 3,400 % fällig am 06.09.2023	900	890	0,20	AT&T, Inc. 5,540 % fällig am 15.02.2023	400	400	0,09
Jackson Financial, Inc. 1,125 % fällig am 22.11.2023	1.000	963	0,22	Charter Communications Operating LLC 6,090 % fällig am 01.02.2024	500	502	0,12	Atmos Energy Corp. 5,103 % fällig am 09.03.2023	1.100	1.099	0,25
Jackson National Life Global Funding 5,473 % fällig am 28.06.2024	400	400	0,09	Cigna Corp. 4,969 % fällig am 15.07.2023	1.400	1.403	0,32	British Telecommunications PLC 4,500 % fällig am 04.12.2023	2.700	2.678	0,62

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Pacific Gas & Electric Co. 1,700 % fällig am 15.11.2023 4,250 % fällig am 01.08.2023	\$ 600	\$ 581	0,13	SLM Private Credit Student Loan Trust 5,059 % fällig am 15.06.2039	\$ 410	\$ 386	0,09	4,600 % fällig am 05.01.2023	\$ 2.500		0,57
Plains All American Pipeline LP 2,850 % fällig am 31.01.2023	1.300	1.298	0,30	STAATSEMISSIONEN				Walgreens Boots Alliance, Inc. 4,900 % fällig am 11.01.2023	\$ 2.300	\$ 2.296	0,53
Southern California Gas Co. 5,103 % fällig am 14.09.2023	1.500	1.496	0,34	Emirate of Abu Dhabi Government International Bond 0,750 % fällig am 02.09.2023	1.500	1.456	0,34				
Verizon Communications, Inc. 5,706 % fällig am 15.05.2025	1.500	1.513	0,35	Israel Government International Bond 1,500 % fällig am 30.11.2023	100	28	0,01	KURZFRISTIGE SCHULDITITEL			
Victoria Power Networks Finance Pty. Ltd. 3,570 % fällig am 23.08.2024	AUD 500	336	0,08	Korea National Oil Corp. 4,954 % fällig am 16.07.2023	\$ 800	801	0,18	Federal Home Loan Bank 4,320 % fällig am 11.01.2023	3.000	3.000	0,69
		16.194	3,72			2.285	0,53	4,345 % fällig am 06.03.2023	12.000	12.001	2,75
Summe Unternehmensanleihen und Wechsel		170.715	39,15	KURZFRISTIGE INSTRUMENTE						15.001	3,44
KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL				COMMERCIAL PAPER				ISRAEL TREASURY BILLS			
California Infrastructure & Economic Development Bank Revenue Bonds, Series 2020 0,850 % fällig am 01.01.2050	\$ 1.000	998	0,23	American Electric Power Co., Inc. 4,800 % fällig am 04.01.2023	1.400	1.399	0,32	0,526 % fällig am 08.02.2023 (a)(b)	ILS 26.700	7.539	1,73
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN				Bacardi-Martini B.V. 5,170 % fällig am 11.01.2023	1.600	1.598	0,37	1,203 % fällig am 02.03.2023 (a)(b)	350	99	0,02
Ginnie Mae 4,398 % fällig am 20.09.2066	525	536	0,12	5,250 % fällig am 12.01.2023	1.500	1.498	0,34			7.638	1,75
4,672 % fällig am 20.08.2066	515	510	0,12	Bank of Nova Scotia 4,318 % fällig am 01.02.2023	CAD 2.000	1.470	0,34	JAPAN TREASURY BILLS			
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.02.2053	5.000	5.011	1,15	4,351 % fällig am 06.02.2023	4.200	3.085	0,71	(0,251) % fällig am 11.01.2023 (a)(b)	¥ 481.500	3.649	0,84
		6.057	1,39	BP Capital Markets PLC 4,750 % fällig am 10.02.2023	\$ 1.300	1.293	0,30	(0,228) % fällig am 11.01.2023 (a)(b)	208.500	1.580	0,36
NON-AGENCY-MBS				Crown Castle International Corp. 5,000 % fällig am 04.01.2023	1.500	1.499	0,34	(0,209) % fällig am 06.01.2023 (a)(b)	314.000	2.380	0,55
DBWF Mortgage Trust 5,469 % fällig am 19.12.2030	500	486	0,11	5,100 % fällig am 05.01.2023	1.500	1.499	0,34	(0,205) % fällig am 16.01.2023 (a)(b)	438.000	3.320	0,76
Dilosk RMBS DAC 2,552 % fällig am 20.02.2060	€ 339	359	0,08	5,150 % fällig am 10.01.2023	800	799	0,18	(0,201) % fällig am 16.01.2023 (a)(b)	119.000	902	0,21
Sage AR Funding PLC 4,501 % fällig am 17.11.2030	£ 200	231	0,05	Dominion Resources, Inc. 4,750 % fällig am 31.01.2023	400	398	0,09	(0,191) % fällig am 06.01.2023 (a)(b)	117.000	887	0,20
Towd Point Mortgage Funding PLC 4,071 % fällig am 20.10.2051	210	251	0,06	Duke Energy Corp. 4,620 % fällig am 11.01.2023	1.500	1.498	0,34	(0,190) % fällig am 16.01.2023 (a)(b)	427.000	3.236	0,74
Towd Point Mortgage Trust 3,773 % fällig am 25.02.2057	\$ 101	100	0,02	4,620 % fällig am 17.01.2023	250	249	0,06	(0,175) % fällig am 11.01.2023 (a)(b)	680.000	5.154	1,18
Trinity Square PLC 3,729 % fällig am 15.07.2059	£ 144	171	0,04	4,650 % fällig am 09.01.2023	800	799	0,18	(0,170) % fällig am 16.01.2023 (a)(b)	2.800.000	21.222	4,87
Tudor Rose Mortgages 4,031 % fällig am 20.06.2048	321	381	0,09	Energy Transfer Partners LP 5,080 % fällig am 05.01.2023	1.900	1.898	0,43	(0,155) % fällig am 30.01.2023 (a)(b)	1.360.000	10.309	2,36
		1.979	0,45	Entergy Corp. 4,700 % fällig am 12.01.2023	2.300	2.296	0,53	(0,111) % fällig am 20.02.2023 (a)(b)	1.590.000	12.053	2,77
FÖRDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				Fiserv, Inc. 4,630 % fällig am 09.01.2023	1.300	1.298	0,30			64.692	14,84
Carlyle Euro CLO DAC 2,688 % fällig am 15.08.2032	€ 300	311	0,07	Humana, Inc. 4,900 % fällig am 01.02.2023	2.000	1.991	0,46	U.S. TREASURY BILLS			
CBAM CLO Ltd. 5,363 % fällig am 20.10.2029	\$ 549	542	0,13	Mercedes-Benz Finance North America LLC 4,800 % fällig am 30.01.2023	2.100	2.092	0,48	4,040 % fällig am 26.01.2023 (a)(b)	\$ 2.600	2.593	0,59
EFS Volunteer LLC 5,208 % fällig am 25.10.2035	133	133	0,03	National Grid Holdings Ltd. 4,810 % fällig am 24.01.2023	250	249	0,06	4,449 % fällig am 30.03.2023 (a)(b)	6.100	6.038	1,39
Elevation CLO Ltd. 5,355 % fällig am 15.10.2029	840	835	0,19	Oracle Corp. 4,760 % fällig am 27.01.2023	1.400	1.395	0,32			8.631	1,98
Euro-Galaxy CLO DAC 2,122 % fällig am 24.04.2034	€ 250	259	0,06	4,800 % fällig am 26.01.2023	2.500	2.491	0,57	Summe kurzfristige Instrumente		149.237	34,23
Greenwood Park CLO Ltd. 5,089 % fällig am 15.04.2031	\$ 1.600	1.580	0,36	Quanta Services, Inc. 5,100 % fällig am 09.01.2023	1.100	1.099	0,25	Summe Übertragbare Wertpapiere		\$ 335.879	77,04
Harvest CLO DAC 2,775 % fällig am 26.06.2030	€ 241	252	0,06	5,100 % fällig am 11.01.2023	900	899	0,21	AKTIEN			
Oak Hill European Credit Partners DAC 2,196 % fällig am 20.10.2031	300	310	0,07	Republic Services, Inc. 4,650 % fällig am 12.01.2023	4.000	3.993	0,92	INVESTMENTFONDS			
				Royal Bank of Canada 4,291 % fällig am 31.01.2023	CAD 2.400	1.764	0,40	ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN			
				4,312 % fällig am 06.02.2023	6.000	4.407	1,01	PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (c)	1.092.919	10.879	2,49
				Toronto-Dominion Bank 4,261 % fällig am 13.01.2023	7.500	5.525	1,27	BÖRSENGEHANDELTE FONDS			
				Vodafone Group PLC				PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (c)	311.050	30.814	7,07
								Summe Investmentfonds	\$ 41.693	9,56	

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft ⁽¹⁾	% des Nettovermögens
BPS	4,100 %	30.12.2022	03.01.2023	\$ 22.700	U.S. Treasury Notes 0,375 % fällig am 30.11.2025	\$ (23.169)	\$ 22.700	\$ 22.710	5,21
SSB	1,900	30.12.2022	03.01.2023	4.752	U.S. Treasury Notes 1,875 % fällig am 30.06.2026	(4.847)	4.752	4.753	1,09
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (28.016)	\$ 27.452	\$ 27.463	6,30

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund (Forts.)

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

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf- monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
3-Month Euribor June Futures	Short	06.2024	112	\$ 28	0,01
3-Month SOFR June Futures	Long	09.2023	338	(16)	0,00
3-Month SOFR June Futures	Short	09.2024	166	92	0,02
3-Month SOFR March Futures	Short	06.2024	80	(55)	(0,01)
Amsterdam Index January Futures	Long	01.2023	3	(25)	(0,01)
Australia Government 3-Year Note March Futures	Short	03.2023	105	0	0,00
Australia Government 10-Year Bond March Futures	Short	03.2023	106	28	0,01
BIST 30 Index February Futures	Long	02.2023	2.365	135	0,03
CAC 40 Index January Futures	Long	01.2023	45	(85)	(0,02)
DAX Index March Futures	Long	03.2023	3	(32)	(0,01)
E-mini NASDAQ 100 Index March Futures	Short	03.2023	4	3	0,00
E-mini Russell 2000 Index March Futures	Short	03.2023	4	0	0,00
E-mini S&P 500 Index March Futures	Long	03.2023	1	(8)	0,00
Euro STOXX Bank March Futures	Long	03.2023	1.430	178	0,04
Euro-BTP Italy Government Bond March Futures	Short	03.2023	195	109	0,02
Euro-OAT France Government 10-Year Bond March Futures	Short	03.2023	24	51	0,01
FTSE 100 Index March Futures	Long	03.2023	92	39	0,01
FTSE China A50 Index January Futures	Short	01.2023	618	(3)	0,00
FTSE Taiwan Index January Futures	Short	01.2023	99	41	0,01
FTSE/ISE Index March Futures	Long	03.2023	123	(126)	(0,03)
FTSE/MIB Index March Futures	Long	03.2023	16	(36)	(0,01)
Hang Seng China Enterprises Index January Futures	Long	01.2023	2	0	0,00
IBEX 35 January Futures	Long	01.2023	18	(4)	0,00
MSCI Singapore Index January Futures	Short	01.2023	367	6	0,00
Nikkei 225 Index March Futures	Short	03.2023	26	34	0,01
OMXS30 Index January Futures	Long	01.2023	128	(88)	(0,02)
S&P CNX Nifty Index January Futures	Long	01.2023	72	1	0,00
S&P/Toronto Stock Exchange 60 March Futures	Long	03.2023	13	(77)	(0,02)
SPI 200 Index March Futures	Long	03.2023	60	(136)	(0,03)
Swiss Market March Futures	Short	03.2023	29	(19)	0,00
Topix Index March Futures	Short	03.2023	4	2	0,00
U.S. Treasury 2-Year Note March Futures	Short	03.2023	24	22	0,01
U.S. Treasury 5-Year Note March Futures	Short	03.2023	262	41	0,01
Volatility S&P 500 Index January Futures	Short	01.2023	279	418	0,1
VSTOXX Mini January Futures	Short	01.2023	1.241	96	0,02
WIG20 Index March Futures	Short	03.2023	330	(63)	(0,02)
				\$ 551	0,13
				\$ 551	0,13

Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
CDX.EM-35 5-Year Index	1,000 %	20.06.2026	\$ 92	\$ (1)	0,00
CDX.EM-37 5-Year Index	1,000	20.06.2027	784	21	0,01
CDX.EM-38 5-Year Index	1,000	20.12.2027	21.100	150	0,03
CDX.HY-38 5-Year Index	5,000	20.06.2027	5.841	10	0,00
CDX.HY-39 5-Year Index	5,000	20.12.2027	2.400	15	0,00
iTraxx Crossover 38 5-Year Index	5,000	20.12.2027	€ 10.500	198	0,05
				\$ 393	0,09

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
Erhalt ⁽³⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	2,000 %	15.03.2033	£ 5.900	\$ (16)	0,00
Erhalt ⁽³⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	2,000	15.03.2053	800	14	0,00
Erhalt	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	4,175	16.09.2025	INR 33.800	11	0,00
Zahlung	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	4,313	16.12.2025	200	0	0,00
Erhalt	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	4,710	17.03.2026	50.700	22	0,01
Zahlung	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	5,250	15.09.2026	727.500	280	0,06
Erhalt	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	5,260	15.09.2026	242.200	(93)	(0,02)
Erhalt	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	5,400	17.03.2026	85.500	49	0,01
Erhalt	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	5,400	16.06.2026	15.300	8	0,00
Erhalt	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	5,500	15.12.2026	1.400	(1)	0,00
Erhalt	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	5,500	16.03.2027	762.900	(316)	(0,07)
Zahlung	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	5,750	16.03.2027	141.100	(34)	(0,01)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	6,000 %	15.06.2027	INR 168.300	\$ 27	0,01
Erhalt	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	6,250	21.09.2027	2.154.300	(588)	(0,13)
Zahlung	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	6,250	21.12.2027	1.397.900	(118)	(0,03)
Zahlung	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	6,500	21.12.2027	4.613.820	(214)	(0,05)
Erhalt	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	6,750	21.09.2027	550.400	(131)	(0,03)
Erhalt	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	7,000	15.06.2027	113.900	(38)	(0,01)
Erhalt	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	7,000	21.09.2027	175.050	(64)	(0,01)
Erhalt ⁽³⁾	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,500	15.03.2033	¥ 2.560.000	113	0,03
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,800	15.06.2052	80.000	24	0,01
Erhalt ⁽³⁾	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	1,000	15.03.2053	490.000	40	0,01
Zahlung	1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS	0,750	15.09.2026	SGD 10.000	(206)	(0,05)
Erhalt	1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS	1,000	15.12.2026	26.990	473	0,11
Zahlung	1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS	1,250	16.03.2027	12.400	(276)	(0,06)
Erhalt	1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS	1,500	16.03.2027	2.800	63	0,01
Erhalt	1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS	2,000	15.06.2027	4.600	71	0,02
Erhalt	1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS	2,500	15.06.2027	9.200	(2)	0,00
Zahlung	1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS	2,750	15.06.2027	4.600	(91)	(0,02)
Erhalt	1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS	3,000	21.09.2027	15.200	(247)	(0,06)
Zahlung	1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS	3,250	21.12.2027	8.000	72	0,02
Erhalt ⁽³⁾	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,500	15.03.2028	\$ 3.600	53	0,01
Erhalt ⁽³⁾	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,500	15.03.2033	900	33	0,01
Erhalt ⁽³⁾	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,500	15.03.2053	200	14	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	5,338	02.01.2025	BRL 14.100	(168)	(0,04)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	5,580	02.01.2025	10.300	(199)	(0,05)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	5,770	02.01.2025	3.300	(68)	(0,02)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	5,840	02.01.2025	11.400	(234)	(0,05)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	5,877	02.01.2025	3.000	(61)	(0,01)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	6,620	02.01.2025	5.500	110	0,03
Erhalt	1-Year BRL-CDI	6,630	02.01.2025	4.900	98	0,02
Erhalt	1-Year BRL-CDI	6,840	02.01.2025	16.800	384	0,09
Erhalt	1-Year BRL-CDI	7,010	02.01.2025	7.900	174	0,04
Erhalt	1-Year BRL-CDI	7,328	02.01.2025	20.000	407	0,09
Zahlung	1-Year BRL-CDI	7,715	02.01.2025	7.800	(154)	(0,04)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	7,733	02.01.2025	8.200	153	0,04
Erhalt	1-Year BRL-CDI	8,180	02.01.2025	14.600	258	0,06
Zahlung	1-Year BRL-CDI	8,550	02.01.2025	700	(13)	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	8,730	02.01.2025	21.700	331	0,08
Erhalt	1-Year BRL-CDI	8,985	02.01.2025	10.900	153	0,04
Erhalt	1-Year BRL-CDI	9,525	02.01.2025	13.300	156	0,04
Erhalt	1-Year BRL-CDI	9,630	02.01.2025	4.500	49	0,01
Erhalt	1-Year BRL-CDI	10,295	04.01.2027	6.000	17	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,445	04.01.2027	20.100	(233)	(0,05)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,813	02.01.2025	10.500	(68)	(0,02)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,043	04.01.2027	10.400	85	0,02
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,070	04.01.2027	8.900	(73)	(0,02)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,180	04.01.2027	17.900	(136)	(0,03)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,240	04.01.2027	24.300	(146)	(0,03)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,350	04.01.2027	63.000	(370)	(0,08)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,426	04.01.2027	7.500	(43)	(0,01)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,451	04.01.2027	37.800	193	0,04
Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,595	04.01.2027	28.200	124	0,03
Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,665	04.01.2027	9.100	45	0,01
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,918	04.01.2027	28.000	(92)	(0,02)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,945	04.01.2027	21.800	73	0,02
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,080	04.01.2027	12.200	(31)	(0,01)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	12,140	04.01.2027	6.000	14	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	12,195	04.01.2027	25.200	28	0,01
Erhalt	1-Year BRL-CDI	12,455	04.01.2027	7.900	6	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	12,718	04.01.2027	35.400	(18)	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	12,740	04.01.2027	45.700	(44)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,770	04.01.2027	11.000	9	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	13,080	04.01.2027	47.200	(116)	(0,03)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	13,190	04.01.2027	34.700	(102)	(0,02)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	13,280	04.01.2027	9.600	31	0,01
Erhalt ⁽³⁾	3-Month CAD-Bank Bill	3,250	15.03.2028	CAD 5.300	(1)	0,00
Erhalt ⁽³⁾	3-Month CAD-Bank Bill	3,250	15.03.2033	8.300	10	0,00
Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,250	21.12.2027	CNY 61.900	(108)	(0,02)
Erhalt	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,268	16.09.2025	3.000	(5)	0,00
Erhalt	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,295	16.09.2025	17.900	(31)	(0,01)
Erhalt	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,345	16.09.2025	6.000	(10)	0,00
Erhalt	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,500	15.09.2026	14.100	13	0,00
Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,500	15.12.2026	28.900	(41)	(0,01)
Erhalt	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,500	16.03.2027	54.900	75	0,02
Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,500	15.06.2027	50.500	(129)	(0,03)
Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,500	21.09.2027	149.120	(284)	(0,07)
Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,500	21.12.2027	35.200	(81)	(0,02)
Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,630	16.12.2025	2.400	2	0,00
Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,645	16.12.2025	7.400	-7	0,00
Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,645	16.12.2025	8.600	8	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund (Forts.)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variable Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2.663 %	17.03.2026	CNY 4.200	\$ 4	0,00
Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2.700	17.03.2026	7.000	5	0,00
Erhalt	3-Month CNY-CNREPOFIX	2.718	16.12.2025	2.900	(2)	0,00
Erhalt	3-Month CNY-CNREPOFIX	2.725	16.09.2025	3.000	(2)	0,00
Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2.750	15.09.2026	81.800	(120)	(0,03)
Erhalt	3-Month CNY-CNREPOFIX	2.750	21.09.2027	121.200	58	0,01
Erhalt	3-Month CNY-CNREPOFIX	2.750	21.12.2027	482.200	15	0,00
Erhalt ⁽⁹⁾	3-Month CNY-CNREPOFIX	2.750	15.03.2028	41.900	20	0,00
Erhalt	3-Month CNY-CNREPOFIX	2.760	17.03.2026	12.500	(8)	0,00
Erhalt	3-Month CNY-CNREPOFIX	2.780	16.12.2025	15.900	(9)	0,00
Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2.790	17.03.2026	2.800	1	0,00
Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2.800	16.06.2026	55.700	43	0,01
Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2.823	17.03.2026	4.500	2	0,00
Erhalt	3-Month CNY-CNREPOFIX	2.828	17.03.2026	4.300	(2)	0,00
Erhalt	3-Month CNY-CNREPOFIX	2.900	17.03.2026	20.900	(27)	(0,01)
Erhalt	3-Month CNY-CNREPOFIX	2.903	17.03.2026	5.500	(1)	0,00
Erhalt	3-Month CNY-CNREPOFIX	2.993	17.03.2026	8.300	0	0,00
Zahlung ⁽⁹⁾	3-Month CNY-CNREPOFIX	3.000	15.03.2028	37.400	18	0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	3.034	13.01.2026	COP 2.305.800	(99)	(0,02)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	3.220	11.12.2025	1.542.400	35	0,01
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	3.295	09.10.2025	1.638.900	(42)	(0,01)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	3.400	28.08.2025	1.571.400	37	0,01
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	3.850	24.04.2025	2.558.800	(67)	(0,02)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	3.940	05.03.2026	4.713.300	175	0,04
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	4.110	23.03.2026	6.908.300	249	0,06
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	4.240	16.04.2026	4.566.900	173	0,04
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	4.350	27.03.2025	625.600	17	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	4.360	30.03.2025	836.600	22	0,01
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	4.490	30.04.2026	3.271.600	(119)	(0,03)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	4.660	11.06.2026	1.410.500	49	0,01
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	4.880	07.05.2026	3.283.600	(111)	(0,03)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	5.150	13.03.2025	121.800	4	0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	5.980	14.10.2026	4.816.400	(145)	(0,03)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	6.190	05.11.2026	9.002.000	251	0,06
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	6.360	19.11.2026	5.335.800	(142)	(0,03)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	6.410	08.11.2026	5.252.200	159	0,04
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	6.950	04.02.2027	6.498.500	153	0,04
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	7.900	08.04.2027	4.251.300	(73)	(0,02)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8.494	27.05.2027	5.817.600	73	0,02
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8.850	06.05.2027	6.000.000	61	0,01
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8.970	05.08.2027	8.528.200	(78)	(0,02)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	9.160	20.05.2027	8.106.600	63	0,01
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	10.050	09.09.2027	8.150.200	3	0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	10.210	18.11.2027	3.214.900	3	0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	10.275	18.11.2027	6.380.400	8	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	10.390	30.09.2027	10.319.800	(21)	0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	10.420	21.11.2027	6.380.400	16	0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	10.430	21.11.2027	6.563.400	17	0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	10.443	21.11.2027	19.784.200	53	0,01
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	10.478	29.09.2027	10.549.600	(28)	(0,01)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	10.800	31.10.2027	32.387.900	(412)	(0,09)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	10.810	14.10.2027	5.776.200	(32)	(0,01)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	10.920	18.10.2027	2.950.700	(19)	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	10.940	18.10.2027	5.920.600	(39)	(0,01)
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	11.424	21.10.2027	13.833.600	143	0,03
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	11.450	21.10.2027	4.011.800	42	0,01
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	11.800	24.10.2027	33.238.700	(372)	(0,09)
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	11.850	24.10.2027	1.323.300	18	0,00
Zahlung	3-Month HKD-HIBOR	0.500	17.03.2026	HKD 26.700	(359)	(0,08)
Zahlung	3-Month HKD-HIBOR	0.508	17.03.2026	4.700	(68)	(0,02)
Erhalt	3-Month HKD-HIBOR	0.550	16.12.2025	4.700	65	0,02
Zahlung	3-Month HKD-HIBOR	0.560	17.03.2026	3.200	(46)	(0,01)
Zahlung	3-Month HKD-HIBOR	0.565	16.12.2025	7.800	(109)	(0,02)
Erhalt	3-Month HKD-HIBOR	0.568	17.03.2026	6.300	92	0,02
Zahlung	3-Month HKD-HIBOR	0.583	16.12.2025	7.900	(110)	(0,03)
Erhalt	3-Month HKD-HIBOR	0.607	17.03.2026	9.400	138	0,03
Erhalt	3-Month HKD-HIBOR	0.608	17.03.2026	7.900	116	0,03
Zahlung	3-Month HKD-HIBOR	0.618	16.09.2025	7.800	(104)	(0,02)
Erhalt	3-Month HKD-HIBOR	0.670	17.03.2026	12.600	177	0,04
Zahlung	3-Month HKD-HIBOR	0.680	16.12.2025	3.200	(46)	(0,01)
Erhalt	3-Month HKD-HIBOR	0.698	16.12.2025	3.100	44	0,01
Erhalt	3-Month HKD-HIBOR	0.700	16.09.2025	11.100	151	0,03
Erhalt	3-Month HKD-HIBOR	0.750	15.09.2026	39.600	155	0,04
Zahlung	3-Month HKD-HIBOR	0.790	16.09.2025	4.700	(65)	(0,01)
Erhalt	3-Month HKD-HIBOR	0.867	17.03.2026	31.700	422	0,10
Zahlung	3-Month HKD-HIBOR	0.883	15.09.2026	7.800	(115)	(0,03)
Erhalt	3-Month HKD-HIBOR	1.000	17.03.2026	11.100	145	0,03
Zahlung	3-Month HKD-HIBOR	1.000	16.06.2026	43.400	(622)	(0,14)
Erhalt	3-Month HKD-HIBOR	1.085	16.09.2025	11.200	163	0,04
Erhalt	3-Month HKD-HIBOR	1.100	16.06.2026	12.700	162	0,04
Erhalt	3-Month HKD-HIBOR	1.120	17.06.2025	3.200	44	0,01
Erhalt	3-Month HKD-HIBOR	1.250	15.12.2026	48.800	215	0,05

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens	
Zahlung	3-Month HKD-HIBOR	1,340 %	18.03.2025	HKD	8.000	\$ (109)	(0,02)
Zahlung	3-Month HKD-HIBOR	1,500	16.03.2027		48.910	(507)	(0,12)
Zahlung	3-Month HKD-HIBOR	1,600	17.06.2025		5.900	(89)	(0,02)
Zahlung	3-Month HKD-HIBOR	1,715	18.03.2025		10.800	(157)	(0,04)
Erhalt	3-Month HKD-HIBOR	1,750	16.03.2027		9.800	120	0,03
Erhalt	3-Month HKD-HIBOR	2,000	16.03.2027		11.500	129	0,03
Zahlung	3-Month HKD-HIBOR	2,750	16.03.2027		18.400	(131)	(0,03)
Zahlung	3-Month HKD-HIBOR	3,000	15.06.2027		5.000	(33)	(0,01)
Erhalt	3-Month HKD-HIBOR	3,000	21.09.2027		10.400	31	0,01
Erhalt	3-Month HKD-HIBOR	3,250	21.09.2027		46.600	3	0,00
Erhalt	3-Month HKD-HIBOR	3,500	21.09.2027		27.940	93	0,02
Erhalt	3-Month HKD-HIBOR	3,750	21.09.2027		40.600	63	0,01
Zahlung	3-Month HKD-HIBOR	4,000	21.12.2027		88.700	60	0,01
Erhalt	3-Month HKD-HIBOR	4,500	21.12.2027		150.900	(583)	(0,13)
Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	0,520	28.07.2026	ILS	24.300	(739)	(0,17)
Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	0,601	05.07.2026		2.800	85	0,02
Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	0,628	25.06.2026		5.600	(152)	(0,03)
Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	0,692	13.09.2026		48.400	1.406	0,32
Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	0,728	04.06.2026		4.100	(112)	(0,03)
Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	0,730	21.05.2026		3.500	92	0,02
Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	0,750	10.12.2026		34.100	(1.038)	(0,24)
Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	0,900	07.10.2026		9.000	(255)	(0,06)
Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	0,905	25.11.2026		8.100	(247)	(0,06)
Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	0,965	14.01.2027		10.600	291	0,07
Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	1,040	28.10.2026		10.400	(292)	(0,07)
Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	1,049	12.11.2026		12.000	326	0,07
Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	1,105	21.01.2027		16.900	433	0,10
Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	1,178	04.02.2027		13.800	341	0,08
Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	2,183	06.05.2027		7.500	99	0,02
Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	2,390	27.05.2027		11.400	127	0,03
Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	2,666	18.07.2027		7.500	42	0,01
Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	2,670	15.07.2027		34.800	25	0,01
Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	2,825	10.06.2027		10.900	(62)	(0,01)
Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	3,210	17.06.2027		1.900	11	0,00
Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	3,260	18.11.2027		38.400	(217)	(0,05)
Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	3,290	16.11.2027		25.363	(121)	(0,03)
Erhalt ⁽⁹⁾	3-Month ILS-TELBOR	3,650	02.01.2028		18.900	7	0,00
Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	3,670	30.12.2027		19.000	2	0,00
Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	3,720	21.10.2027		72.900	(30)	(0,01)
Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	0,830	16.09.2025	KRW	950.500	(33)	(0,01)
Erhalt	3-Month KRW-KORIBOR	0,888	16.12.2025		509.100	19	0,00
Erhalt	3-Month KRW-KORIBOR	0,910	16.09.2025		737.100	26	0,01
Erhalt	3-Month KRW-KORIBOR	0,994	16.12.2025		450.000	18	0,00
Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	1,000	16.12.2025		907.600	(36)	(0,01)
Erhalt	3-Month KRW-KORIBOR	1,120	17.03.2026		4.208.600	186	0,04
Erhalt	3-Month KRW-KORIBOR	1,400	17.03.2026		5.001.700	246	0,06
Erhalt	3-Month KRW-KORIBOR	1,500	16.06.2026		3.925.900	210	0,05
Erhalt	3-Month KRW-KORIBOR	1,500	15.09.2026		9.830.000	88	0,02
Erhalt	3-Month KRW-KORIBOR	1,625	15.09.2026		900.700	8	0,00
Erhalt	3-Month KRW-KORIBOR	1,750	16.03.2027		6.778.400	214	0,05
Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	2,000	15.12.2026		6.833.600	(77)	(0,02)
Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	2,500	16.03.2027		3.811.300	(155)	(0,04)
Erhalt	3-Month KRW-KORIBOR	2,500	15.06.2027		123.300	2	0,00
Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	2,750	15.06.2027		4.069.700	(123)	(0,03)
Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	3,000	15.06.2027		2.600.000	(52)	(0,01)
Erhalt	3-Month KRW-KORIBOR	3,000	21.09.2027		5.600.600	(6)	0,00
Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	3,250	21.09.2027		2.313.900	(27)	(0,01)
Zahlung ⁽⁹⁾	3-Month KRW-KORIBOR	3,500	15.03.2028		5.822.300	(56)	(0,01)
Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	3,750	21.12.2027		10.681.300	25	0,01
Erhalt	3-Month KRW-KORIBOR	4,000	21.12.2027		20.304.200	(388)	(0,09)
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	4,900	12.11.2025	ZAR	3.400	(16)	0,00
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	4,938	18.09.2025		7.000	35	0,01
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	5,120	02.09.2025		500	3	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	5,330	13.05.2025		8.300	(44)	(0,01)
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	5,375	27.05.2025		7.800	(42)	(0,01)
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	5,601	09.06.2026		31.050	(131)	(0,03)
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	5,680	08.06.2026		41.150	(175)	(0,04)
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	5,739	28.07.2026		72.100	(298)	(0,07)
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	5,780	03.03.2026		36.600	131	0,03
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	5,860	23.06.2026		75.600	285	0,07
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	5,950	17.03.2026		1.200	4	0,00
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	5,980	22.09.2026		43.900	169	0,04
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	6,023	01.07.2026		28.100	95	0,02
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	6,200	22.04.2025		7.800	(50)	(0,01)
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	6,231	29.09.2026		55.400	187	0,04
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	6,300	23.12.2026		30.900	(108)	(0,02)
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	6,320	23.04.2025		5.600	(37)	(0,01)
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	6,400	30.12.2026		33.600	(111)	(0,03)
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	6,540	04.01.2027		37.100	(110)	(0,03)
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	6,540	23.02.2027		64.600	(203)	(0,05)
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	6,670	12.01.2027		73.700	202	0,05
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	6,690	04.11.2026		2.000	6	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund (Forts.)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettvermögens
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	6,835 %	28.08.2024	ZAR 100	\$ 1	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	6,855	03.11.2026	22.830	(50)	(0,01)
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	7,049	09.03.2027	70.000	151	0,03
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	7,489	18.05.2027	112.100	66	0,02
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	7,600	19.06.2024	7.100	53	0,01
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	7,710	06.05.2027	22.200	14	0,00
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	7,740	17.08.2027	63.300	(65)	(0,01)
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	7,750	20.03.2024	9.180	(67)	(0,02)
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	7,800	19.12.2023	3.100	(21)	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,055	14.11.2027	8.400	4	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,064	27.07.2027	21.200	(28)	(0,01)
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	8,500	17.10.2027	12.000	(14)	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	1,130	31.07.2025	CLP 332.000	(41)	(0,01)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	1,190	14.08.2025	6.000	0	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	1,310	23.10.2025	4.700	0	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	1,750	12.02.2026	901.600	181	0,04
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	1,915	09.03.2025	325.300	(43)	(0,01)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	2,280	14.02.2025	317.700	(48)	(0,01)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	2,290	09.03.2026	1.057.700	185	0,04
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	2,525	22.03.2026	755.000	110	0,03
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	3,170	21.06.2026	791.600	93	0,02
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	3,245	19.07.2026	1.399.300	217	0,05
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	3,570	09.07.2026	1.279.600	(185)	(0,04)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	3,728	20.08.2026	2.239.800	286	0,07
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	5,220	19.11.2026	2.363.300	(109)	(0,02)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	5,261	17.11.2027	3.774.600	(139)	(0,03)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	5,280	17.11.2027	3.854.600	(138)	(0,03)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	5,300	17.11.2027	940.100	(33)	(0,01)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	5,358	18.11.2027	2.390.300	(76)	(0,02)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,420	28.10.2026	1.284.200	58	0,01
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	5,420	18.11.2027	7.201.400	(215)	(0,05)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	5,530	18.11.2027	2.406.700	(55)	(0,01)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,620	22.10.2026	1.673.000	59	0,01
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,975	18.01.2027	1.912.300	60	0,01
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,207	31.05.2027	1.836.600	10	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,230	27.05.2027	1.675.600	9	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	6,885	13.05.2027	1.642.400	(56)	(0,01)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	7,160	21.10.2027	5.870.000	(295)	(0,07)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	7,161	17.06.2027	2.386.300	(129)	(0,03)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	7,174	17.06.2027	1.432.400	(81)	(0,02)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	7,420	09.09.2027	2.595.500	(156)	(0,04)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	7,900	30.09.2027	2.317.200	(206)	(0,05)
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	0,421	15.05.2025	CZK 900	(4)	0,00
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	0,590	26.03.2025	10.900	(55)	(0,01)
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	0,637	24.07.2025	7.700	(47)	(0,01)
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	0,665	22.09.2025	5.100	(30)	(0,01)
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	0,690	04.05.2025	4.100	(20)	0,00
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	0,710	30.03.2025	100	(1)	0,00
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	0,776	20.08.2025	7.900	(48)	(0,01)
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	1,100	31.12.2025	57.000	329	0,08
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	1,124	13.03.2025	12.000	(66)	(0,02)
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	1,570	09.03.2026	59.800	335	0,08
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	1,580	19.03.2026	51.600	270	0,06
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	1,715	23.07.2026	100.200	(645)	(0,15)
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	1,775	04.06.2026	57.900	(292)	(0,07)
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	1,934	02.07.2026	95.200	590	0,14
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	1,972	07.07.2026	55.500	350	0,08
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	2,015	10.08.2026	132.200	740	0,17
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	3,770	11.02.2027	72.000	(172)	(0,04)
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	4,300	18.03.2027	80.900	93	0,02
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	4,440	12.12.2027	253.100	(397)	(0,09)
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	4,560	09.12.2027	156.700	(211)	(0,05)
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	4,640	07.12.2027	156.700	(189)	(0,04)
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	4,680	08.12.2027	156.700	(176)	(0,04)
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	5,103	16.11.2027	240.300	(94)	(0,02)
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	5,140	11.07.2027	58.000	(46)	(0,01)
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	5,175	11.07.2027	82.400	(104)	(0,02)
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	5,185	24.05.2027	64.000	(52)	(0,01)
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	5,285	20.05.2027	83.300	(83)	(0,02)
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	5,538	02.09.2027	52.400	(9)	0,00
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	5,640	10.06.2027	3.400	(6)	0,00
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	5,740	03.10.2027	121.600	(85)	(0,02)
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	5,788	20.10.2027	538.000	(625)	(0,14)
Erhalt ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	1,500	15.03.2053	€ 5.300	43	0,01
Erhalt ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	1,750	15.03.2033	7.400	118	0,03
Erhalt	6-Month HUF-BBR	1,085	14.08.2025	HUF 186.300	140	0,03
Zahlung	6-Month HUF-BBR	1,115	08.01.2026	1.131.600	(887)	(0,20)
Erhalt	6-Month HUF-BBR	1,220	15.01.2026	559.700	458	0,11
Erhalt	6-Month HUF-BBR	1,230	15.01.2026	872.700	716	0,16
Zahlung	6-Month HUF-BBR	1,920	16.04.2026	426.000	(319)	(0,07)
Erhalt	6-Month HUF-BBR	1,958	19.03.2026	1.746.000	1.294	0,30
Erhalt	6-Month HUF-BBR	1,980	09.03.2026	646.300	486	0,11

Zahlung/ Erhalt		Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zinssatz	Variabler Zinssatzindex					
Erhalt	6-Month HUF-BBR	2,499 %	05.07.2026	HUF 78.800	\$ 61	0,01
Erhalt	6-Month HUF-BBR	2,558	06.08.2026	1.156.900	914	0,21
Zahlung	6-Month HUF-BBR	5,060	18.02.2027	885.100	(479)	(0,11)
Erhalt	6-Month HUF-BBR	5,500	04.03.2027	627.800	310	0,07
Erhalt	6-Month HUF-BBR	6,100	11.03.2027	498.000	213	0,05
Zahlung	6-Month HUF-BBR	7,480	03.06.2027	700.700	(96)	(0,02)
Erhalt	6-Month HUF-BBR	7,640	13.05.2027	721.400	192	0,04
Zahlung	6-Month HUF-BBR	9,625	15.08.2027	695.900	(43)	(0,01)
Zahlung	6-Month HUF-BBR	9,750	22.11.2027	283.976	(43)	(0,01)
Zahlung	6-Month HUF-BBR	9,800	16.11.2027	2.235.924	(337)	(0,08)
Erhalt	6-Month HUF-BBR	9,900	16.12.2027	162.500	20	0,00
Zahlung	6-Month HUF-BBR	10,000	18.11.2027	319.400	(41)	(0,01)
Erhalt	6-Month HUF-BBR	10,050	15.12.2027	164.000	18	0,00
Zahlung	6-Month HUF-BBR	10,070	18.07.2027	428.900	(62)	(0,01)
Zahlung	6-Month HUF-BBR	10,100	15.07.2027	488.900	(69)	(0,02)
Erhalt	6-Month HUF-BBR	10,340	15.12.2027	334.200	28	0,01
Erhalt	6-Month HUF-BBR	11,140	23.12.2027	2.021.500	61	0,01
Zahlung	6-Month HUF-BBR	11,350	11.11.2027	289.300	(29)	(0,01)
Erhalt	6-Month HUF-BBR	11,524	12.09.2027	2.052.600	27	0,01
Erhalt	6-Month HUF-BBR	11,650	09.09.2027	359.200	(7)	0,00
Erhalt	6-Month HUF-BBR	12,500	19.10.2027	4.079.400	(421)	(0,10)
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	0,481	11.08.2025	PLN 3.400	(128)	(0,03)
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	0,560	17.04.2025	1.900	(61)	(0,01)
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	0,580	11.01.2026	8.500	(353)	(0,08)
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	0,585	22.09.2025	6.000	(224)	(0,05)
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	0,635	08.05.2025	1.100	(36)	(0,01)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	0,730	05.02.2026	6.500	265	0,06
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	0,890	12.02.2026	20.900	823	0,19
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	1,188	19.03.2026	17.800	613	0,14
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	1,229	09.03.2026	7.000	252	0,06
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	1,405	10.08.2026	27.100	1.040	0,24
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	1,450	05.07.2026	5.300	(217)	(0,05)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	1,465	07.06.2026	2.400	79	0,02
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	2,185	08.10.2026	8.300	(275)	(0,06)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	2,983	08.11.2026	20.100	529	0,12
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	3,525	24.12.2026	3.300	(70)	(0,02)
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	3,600	27.12.2026	3.300	(68)	(0,02)
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	3,739	03.01.2027	1.000	(19)	0,00
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	3,934	04.03.2027	19.200	(178)	(0,04)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	4,219	04.02.2027	10.200	151	0,03
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	4,830	18.03.2027	2.000	15	0,00
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	5,179	01.04.2027	7.900	31	0,01
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	5,460	16.08.2027	1.300	(3)	0,00
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	5,490	12.12.2027	19.700	(134)	(0,03)
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	5,525	12.12.2027	6.500	(42)	(0,01)
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	5,670	09.12.2027	19.500	(100)	(0,02)
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	5,750	08.12.2027	16.300	(71)	(0,02)
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	5,800	07.12.2027	32.600	(128)	(0,03)
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	5,830	08.12.2027	32.600	(118)	(0,03)
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	6,310	18.11.2027	14.800	8	0,00
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	6,348	09.09.2027	14.800	(10)	0,00
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	6,365	17.11.2027	15.600	17	0,00
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	6,455	16.11.2027	23.630	45	0,01
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	6,650	29.09.2027	33.200	(280)	(0,06)
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	7,223	29.06.2027	23.200	290	0,07
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	7,726	24.10.2027	87.700	(1.087)	(0,25)
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	7,761	21.10.2027	7.052	94	0,02
Erhalt	28-Day MXN-TIE	4,775	26.06.2025	MXN 4.900	28	0,01
Erhalt	28-Day MXN-TIE	4,800	05.02.2026	65.500	346	0,08
Zahlung	28-Day MXN-TIE	5,080	09.10.2025	14.500	(92)	(0,02)
Zahlung	28-Day MXN-TIE	5,095	30.10.2025	23.500	(146)	(0,03)
Zahlung	28-Day MXN-TIE	5,120	06.05.2025	15.800	(94)	(0,02)
Zahlung	28-Day MXN-TIE	5,443	17.04.2025	5.700	(35)	(0,01)
Erhalt	28-Day MXN-TIE	5,550	12.03.2026	32.800	167	0,04
Zahlung	28-Day MXN-TIE	6,050	04.06.2026	22.600	(103)	(0,02)
Erhalt	28-Day MXN-TIE	6,095	20.03.2026	51.800	226	0,05
Zahlung	28-Day MXN-TIE	6,210	28.03.2025	4.300	(30)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIE	6,230	07.04.2025	16.700	(116)	(0,03)
Erhalt	28-Day MXN-TIE	6,255	21.05.2026	23.500	101	0,02
Erhalt	28-Day MXN-TIE	6,460	18.06.2026	43.000	164	0,04
Erhalt	28-Day MXN-TIE	6,625	11.09.2026	21.100	82	0,02
Erhalt	28-Day MXN-TIE	6,635	11.09.2026	21.100	81	0,02
Erhalt	28-Day MXN-TIE	6,740	17.09.2026	28.500	104	0,02
Zahlung	28-Day MXN-TIE	7,109	03.12.2026	102.300	(323)	(0,07)
Erhalt	28-Day MXN-TIE	7,113	24.09.2026	134.600	408	0,09
Erhalt	28-Day MXN-TIE	7,264	17.12.2026	30.000	86	0,02
Zahlung	28-Day MXN-TIE	7,273	12.11.2026	33.880	(96)	(0,02)
Erhalt	28-Day MXN-TIE	7,353	05.11.2026	58.150	158	0,04
Zahlung	28-Day MXN-TIE	7,370	14.10.2026	24.200	(65)	(0,01)
Erhalt	28-Day MXN-TIE	7,383	28.01.2027	29.500	81	0,02
Zahlung	28-Day MXN-TIE	7,460	04.02.2027	44.800	(115)	(0,03)
Erhalt	28-Day MXN-TIE	7,530	14.01.2027	24.100	58	0,01

Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund (Forts.)

Zahlung/ Erhalt	variabler Zinssatz	variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettovermögens
Erhalt	28-Day MXN-TIE		7,590 %	29.10.2026	MXN	40.000	\$ 90		0,02
Erhalt	28-Day MXN-TIE		7,673	31.12.2026		23.900	53		0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIE		7,745	11.02.2027		53.100	(109)		(0,02)
Zahlung	28-Day MXN-TIE		8,250	02.12.2032		89.200	(148)		(0,03)
Zahlung	28-Day MXN-TIE		8,280	29.07.2027		40.300	(58)		(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIE		8,400	21.05.2027		47.400	(43)		(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIE		8,402	20.05.2027		34.800	(32)		(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIE		8,453	30.11.2027		332.600	(272)		(0,06)
Zahlung	28-Day MXN-TIE		8,480	30.11.2027		105.200	(80)		(0,02)
Zahlung	28-Day MXN-TIE		8,498	11.03.2027		25.400	(18)		0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIE		8,616	05.11.2027		165.400	(79)		(0,02)
Zahlung	28-Day MXN-TIE		8,620	09.11.2027		82.900	(10)		0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIE		8,740	30.08.2027		30.800	(1)		0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIE		8,785	06.05.2027		24.900	4		0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIE		8,810	01.07.2027		60.100	(6)		0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIE		8,921	25.08.2027		61.100	2		0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIE		9,020	03.06.2027		91.300	(34)		(0,01)
Erhalt	28-Day MXN-TIE		9,060	14.09.2027		61.100	(31)		(0,01)
Erhalt	28-Day MXN-TIE		9,070	24.06.2027		13.500	(5)		0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIE		9,114	24.06.2027		11.700	(5)		0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIE		9,290	23.09.2027		22.500	20		0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIE		9,295	21.10.2027		116.100	(107)		(0,02)
Zahlung	28-Day MXN-TIE		9,300	24.09.2027		34.400	31		0,01
Erhalt	28-Day MXN-TIE		9,382	12.10.2027		153.800	(168)		(0,04)
Erhalt	28-Day MXN-TIE		9,390	07.10.2027		40.300	(43)		(0,01)
Erhalt	28-Day MXN-TIE		9,536	22.09.2027		67.800	(92)		(0,02)
							\$ (663)		(0,15)
							\$ (270)		(0,06)

Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate

- (1) Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definieren, dann zahlt der Teilfonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.
- (2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definieren.
- (3) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

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

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

ZINSSWAPS

Kontrahent	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettovermögens		
BOA	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	0,230 %	02.12.2025	ILS	2.100	\$ 0	\$ (58)	(58)	(0,01)	
	Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	0,250	20.08.2025		2.100	3	50	53	0,01	
	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	0,265	29.05.2025		3.700	0	(85)	(85)	(0,02)	
	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	0,270	04.11.2025		2.900	0	(79)	(79)	(0,02)	
	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	0,305	15.05.2025		2.900	0	(66)	(66)	(0,02)	
	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	0,330	14.02.2025		2.900	0	(59)	(59)	(0,01)	
	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	0,335	29.11.2024		2.200	0	(41)	(41)	(0,01)	
	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	0,361	03.02.2026		2.800	0	(78)	(78)	(0,02)	
	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	0,403	31.01.2025		2.900	0	(57)	(57)	(0,01)	
	Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	0,405	30.10.2024		1.500	0	28	28	0,01	
	Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	0,666	06.04.2026		6.400	0	169	169	0,04	
	Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	0,684	10.03.2026		7.800	0	188	188	0,04	
	Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	0,712	19.03.2026		19.700	0	471	471	0,11	
	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	1,345	23.11.2023		5.900	0	(41)	(41)	(0,01)	
	Zahlung	3-Month MYR-KLIBOR	2,153	17.03.2026	MYR	2.700	0	(30)	(30)	(0,01)	
	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	2,367	17.03.2026		5.700	0	54	54	0,01	
	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	2,500	15.09.2026		21.600	22	193	215	0,05	
	Zahlung	3-Month MYR-KLIBOR	2,700	16.06.2026		7.800	10	(70)	(60)	(0,01)	
	Zahlung	3-Month MYR-KLIBOR	2,750	15.12.2026		10.700	(8)	(83)	(91)	(0,02)	
	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	2,750	15.12.2026		14.000	13	106	119	0,03	
	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,000	16.03.2027		17.600	78	41	119	0,03	
	Zahlung	3-Month MYR-KLIBOR	3,000	16.03.2027		8.200	(10)	(46)	(56)	(0,01)	
	Zahlung	3-Month MYR-KLIBOR	3,500	15.06.2027		20.900	(14)	(34)	(48)	(0,01)	
	Zahlung	3-Month MYR-KLIBOR	3,750	21.09.2027		15.100	28	(27)	1	0,00	
	Zahlung	3-Month MYR-KLIBOR	3,750	21.12.2027		143.400	98	(110)	(12)	0,00	
	Zahlung	3-Month THB-THORON Compounded-OIS		2,250	21.12.2027	THB	124.000	27	(21)	6	0,00
	Zahlung	3-Month THB-THORON Compounded-OIS		2,500	21.12.2027		353.000	144	(4)	140	0,03
	Zahlung	3-Month THB-THORON Compounded-OIS		2,750	21.09.2027		76.800	(3)	59	56	0,01

Kontrahent	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag	Gezahlt/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt- wert	% des Nettovermögens
	Zahlung	3-Month THB-THORON Compounded-OIS	3,000 %	21.12.2027	THB 170.700	\$ 145	\$ 41	\$ 186	0,04
	Erhalt	3-Month THB-THORON Compounded-OIS	3,000	21.12.2027	159.900	(34)	(141)	(175)	(0,04)
	Zahlung	3-Month TWD-TAIBOR	1,000	21.12.2027	TWD 249.200	(49)	(99)	(148)	(0,03)
	Zahlung	3-Month TWD-TAIBOR	1,250	21.12.2027	501.700	41	(137)	(96)	(0,02)
	Erhalt	3-Month TWD-TAIBOR	1,500	21.09.2027	355.684	3	(75)	(72)	(0,02)
	Erhalt	3-Month TWD-TAIBOR	1,500	21.12.2027	556.800	93	(210)	(117)	(0,03)
BPS	Erhalt	3-Month TWD-TAIBOR	0,200	06.03.2025	ILS 2.900	0	62	62	0,01
	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	0,285	19.05.2025	1.500	0	(34)	(34)	(0,01)
	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	0,375	13.03.2025	1.500	0	(30)	(30)	(0,01)
	Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	0,410	18.10.2024	2.200	0	40	40	0,01
	Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	0,710	25.03.2025	3.300	0	57	57	0,01
	Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	1,480	30.11.2023	6.000	0	39	39	0,01
	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	2,646	17.03.2026	MYR 8.800	0	65	65	0,01
CBK	Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	0,257	11.12.2025	ILS 1.300	0	35	35	0,01
	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	0,293	18.05.2025	3.000	0	(68)	(68)	(0,02)
	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	0,406	01.11.2024	1.500	0	(27)	(27)	(0,01)
	Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	0,413	08.11.2024	2.200	0	38	38	0,01
	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	0,573	20.04.2026	4.800	0	(133)	(133)	(0,03)
	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	1,202	19.09.2023	10.400	0	(48)	(48)	(0,01)
	Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	1,373	07.09.2023	11.032	0	38	38	0,01
	Zahlung	3-Month MYR-KLIBOR	1,987	16.12.2025	MYR 1.800	0	(20)	(20)	0,00
	Zahlung	3-Month TWD-TAIBOR	1,250	21.12.2027	TWD 132.800	(4)	(22)	(26)	(0,01)
CKL	Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	1,060	15.02.2024	ILS 3.100	8	14	22	0,01
GLM	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	0,223	23.10.2025	2.900	0	(80)	(80)	(0,02)
	Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	0,233	02.12.2025	2.400	0	66	66	0,02
	Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	0,250	20.08.2025	2.200	0	56	56	0,01
	Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	0,320	15.01.2026	1.900	0	53	53	0,01
	Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	0,370	28.08.2025	1.400	0	34	34	0,01
	Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	0,393	02.01.2025	2.800	0	55	55	0,01
	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	0,586	23.04.2026	10.400	0	(286)	(286)	(0,07)
	Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	0,635	27.03.2025	4.200	0	75	75	0,02
	Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	0,650	26.03.2025	3.300	0	58	58	0,01
	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	0,967	19.06.2024	3.000	0	(31)	(31)	(0,01)
	Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	1,026	19.02.2024	2.300	0	17	17	0,00
	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	2,840	16.06.2026	MYR 3.500	(5)	28	23	0,01
	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,500	21.09.2027	48.400	188	(64)	124	0,03
	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	4,000	15.06.2027	10.000	(8)	(18)	(26)	(0,01)
	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	4,000	21.12.2027	39.700	131	(236)	(105)	(0,02)
GST	Zahlung	3-Month MYR-KLIBOR	3,750	21.12.2027	86.500	103	(110)	(7)	0,00
	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	4,000	21.12.2027	47.600	101	(227)	(126)	(0,03)
	Zahlung	3-Month THB-THORON Compounded-OIS	2,000	21.09.2027	THB 681.770	(171)	(12)	(183)	(0,04)
	Erhalt	3-Month THB-THORON Compounded-OIS	2,250	21.09.2027	643.310	(31)	(8)	(39)	(0,01)
	Zahlung	3-Month THB-THORON Compounded-OIS	2,250	21.12.2027	124.000	28	(22)	6	0,00
	Zahlung	3-Month THB-THORON Compounded-OIS	2,500	21.09.2027	127.100	43	7	50	0,01
HUS	Zahlung	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	5,195	18.03.2025	INR 82.600	0	(28)	(28)	(0,01)
	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	0,350	18.09.2024	ILS 1.400	0	(23)	(23)	(0,01)
	Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	0,390	05.02.2026	10.500	0	289	289	0,07
	Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	1,035	25.03.2024	3.900	1	28	29	0,01
	Erhalt	3-Month TWD-TAIBOR	1,500	21.09.2027	TWD 40.670	1	(9)	(8)	0,00
IND	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	1,030	19.06.2024	ILS 2.900	0	(29)	(29)	(0,01)
JPM	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	1,280	11.01.2024	17.620	0	(102)	(102)	(0,02)
	Zahlung	3-Month MYR-KLIBOR	3,750	21.12.2027	MYR 40.300	46	(49)	(3)	0,00
	Erhalt	3-Month THB-THORON Compounded-OIS	2,250	21.09.2027	THB 147.970	20	(29)	(9)	0,00
	Zahlung	3-Month TWD-TAIBOR	1,000	21.12.2027	TWD 120.900	(27)	(45)	(72)	(0,02)
MBC	Zahlung	3-Month TWD-TAIBOR	1,250	21.12.2027	390.900	31	(106)	(75)	(0,02)
MYC	Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	0,266	16.11.2025	ILS 1.400	(1)	39	38	0,01
	Zahlung	3-Month MYR-KLIBOR	1,975	16.12.2025	MYR 1.800	0	(20)	(20)	0,00
	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	4,000	15.06.2027	6.000	(6)	(10)	(16)	0,00
	Zahlung	3-Month MYR-KLIBOR	4,250	21.12.2027	38.980	14	195	209	0,05
	Erhalt	3-Month THB-THORON Compounded-OIS	2,250	21.09.2027	THB 114.200	33	(40)	(7)	0,00
SCX	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	2,033	16.12.2025	MYR 3.500	0	38	38	0,01
	Zahlung	3-Month MYR-KLIBOR	2,212	17.03.2026	2.600	0	(27)	(27)	(0,01)
	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	2,363	17.03.2026	3.000	0	28	28	0,01
	Erhalt	3-Month THB-THORON Compounded-OIS	2,250	21.09.2027	THB 89.030	17	(22)	(5)	0,00
	Zahlung	3-Month THB-THORON Compounded-OIS	2,250	21.12.2027	126.900	34	(28)	6	0,00
	Zahlung	3-Month TWD-TAIBOR	1,250	21.12.2027	TWD 482.100	61	(154)	(93)	(0,02)
						\$ 1.194	\$ (994)	\$ 200	0,04

Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund (Forts.)

TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES

Kontrahent	Zahlung/Erhalt	Wertpapier	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Variabler Zinssatz	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Gezahlte/erhaltene Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens	
MEI	Zahlung	Brazil Stock Exchange Index	399	0,000 %	BRL	42.534	15.02.2023	\$ 0	\$ (341)	\$ (341)	(0,08)
	Zahlung	KOSPI2 Index	9.250.000	4,030	KRW	2.779.523	09.03.2023	0	56	56	0,01
	Erhalt	SET 50 Index	284.800	0,000	THB	282.717	30.03.2023	0	120	120	0,03
								\$ 0	\$ (165)	\$ (165)	(0,04)

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens	
AZD	02.2023	\$ 7	€ 7	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00	
BOA	01.2023	¥ 1.121.000	\$ 7.860	0	(641)	(641)	(0,15)	
	01.2023	KRW 15.314.237	11.584	0	(589)	(589)	(0,13)	
	01.2023	PEN 9.335	2.431	0	(11)	(11)	0,00	
	01.2023	\$ 971	PLN 4.356	22	0	22	0,01	
	01.2023	9.152	RON 42.863	91	0	91	0,02	
	02.2023	CAD 6.117	\$ 4.608	93	0	93	0,02	
	02.2023	€ 1.831	1.952	0	(7)	(7)	0,00	
	02.2023	¥ 60.800	463	0	0	0	0,00	
	02.2023	NOK 60	6	0	0	0	0,00	
	02.2023	PEN 654	167	0	(4)	(4)	0,00	
	02.2023	SEK 890	86	1	0	1	0,00	
	02.2023	\$ 100	AUD 147	0	0	0	0,00	
	02.2023	625	€ 586	2	0	2	0,00	
	02.2023	3.732	ZAR 64.564	48	0	48	0,01	
	03.2023	ILS 347	\$ 102	4	0	4	0,00	
	03.2023	\$ 4.655	€ 4.375	38	(1)	37	0,01	
	03.2023	8.300	IDR 129.978.000	102	0	102	0,02	
	03.2023	1.997	RON 9.266	0	(7)	(7)	0,00	
	03.2023	1.900	SEK 19.846	12	0	12	0,00	
	BPS	01.2023	BRL 2.523	\$ 483	5	0	5	0,00
		01.2023	CAD 7.500	5.650	114	0	114	0,03
		01.2023	THB 689.347	19.923	0	(9)	(9)	0,00
		01.2023	\$ 1.531	CZK 35.467	35	0	35	0,01
		01.2023	58	HUF 22.143	1	0	1	0,00
		01.2023	5.037	PHP 280.116	5	0	5	0,00
		01.2023	223	SGD 301	2	0	2	0,00
		01.2023	290	TRY 5.471	0	0	0	0,00
		02.2023	480	BRL 2.523	0	(5)	(5)	0,00
		03.2023	CAD 8.178	\$ 6.000	0	(39)	(39)	(0,01)
		03.2023	COP 11.842.550	2.420	9	0	9	0,00
		03.2023	INR 1.769.973	21.336	53	0	53	0,01
		03.2023	MXN 409.950	20.448	0	(322)	(322)	(0,07)
		03.2023	\$ 8.700	BRL 45.226	0	(245)	(245)	(0,06)
03.2023		4.600	CHF 4.210	0	(15)	(15)	0,00	
03.2023		1.031	CLP 897.493	13	0	13	0,00	
03.2023		2.655	HUF 1.028.642	34	0	34	0,01	
03.2023		2.880	NZD 4.500	0	(32)	(32)	(0,01)	
03.2023		3.299	PEN 12.769	28	0	28	0,01	
03.2023		6.703	RON 31.255	22	(12)	10	0,00	
04.2023		CLP 210	\$ 0	0	0	0	0,00	
BRC		01.2023	CNH 50.737	7.317	0	(25)	(25)	(0,01)
		01.2023	¥ 3.480.000	23.715	0	(2.699)	(2.699)	(0,62)
		01.2023	PLN 686	155	0	(1)	(1)	0,00
		01.2023	RON 171	37	0	0	0	0,00
		01.2023	\$ 2.102	BRL 10.994	0	(20)	(20)	0,00
		01.2023	70	ILS 245	0	(1)	(1)	0,00
		01.2023	4.609	SGD 6.208	21	0	21	0,01
		02.2023	£ 393	\$ 480	6	0	6	0,00
		02.2023	\$ 212	£ 175	0	(2)	(2)	0,00
		02.2023	15	SEK 155	0	0	0	0,00
		03.2023	COP 10.308.702	\$ 2.098	1	0	1	0,00
		03.2023	IDR 204.965	13	0	0	0	0,00
	03.2023	ILS 7.788	2.220	4	0	4	0,00	
	03.2023	INR 266.797	3.204	0	(4)	(4)	0,00	
	CBK	01.2023	BRL 2.523	482	4	0	4	0,00
		01.2023	PLN 785	179	0	0	0	0,00
		01.2023	TRY 7.630	404	0	0	0	0,00
		01.2023	\$ 1.835	BRL 9.594	0	(18)	(18)	0,00
		01.2023	188	HUF 75.012	11	0	11	0,00
		01.2023	114	ILS 401	0	0	0	0,00
		01.2023	13	TRY 244	0	0	0	0,00
02.2023		AUD 8.842	\$ 5.927	0	(80)	(80)	(0,02)	
02.2023		CAD 247	181	0	(1)	(1)	0,00	
02.2023		ILS 26.558	7.720	183	0	183	0,04	
02.2023		¥ 763.200	5.707	0	(109)	(109)	(0,02)	
02.2023		SEK 2.280	221	2	0	2	0,00	
02.2023		\$ 15	AUD 22	0	0	0	0,00	
02.2023		479	BRL 2.523	0	(4)	(4)	0,00	
02.2023		197	¥ 26.000	1	0	1	0,00	

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	03.2023	COP	\$	3.595.112	734	\$ 2	0,00
	03.2023	\$	CLP	3.640	3.145.957	20	0,00
	03.2023		KRW	110	139.040	1	0,00
	03.2023		MXN	37.454	752.620	680	0,16
CLY	11.2023	ILS	\$	98	30	1	0,00
	01.2023	\$	PLN	54	238	1	0,00
	02.2023		ZAR	35	608	1	0,00
	03.2023		CLP	2.597	2.356.648	143	0,03
DUB	03.2023		PEN	5.587	21.494	12	0,00
GLM	02.2023		CHF	12	11	0	0,00
	01.2023	HUF	\$	192.916	501	0	0,00
	01.2023	MYR		128	29	0	0,00
	01.2023	PLN		478	108	0	0,00
	01.2023	THB		64.210	1.842	0	0,00
	01.2023	\$	HUF	603	233.977	19	0,00
	01.2023		MYR	3.818	16.637	0	0,00
	01.2023		PLN	16	70	0	0,00
	01.2023		RUB	931	62.115	0	(0,02)
	01.2023		TRY	226	4.273	0	0,00
	02.2023	ZAR	\$	4.845	280	0	0,00
	03.2023	COP		14.510.409	3.006	54	0,01
	03.2023	ILS		10.859	3.100	11	0,00
	03.2023	MXN		199.236	9.943	0	(0,03)
	03.2023	\$	AUD	2.508	3.700	8	0,00
	03.2023		CLP	680	590.845	7	0,00
	03.2023		COP	3.009	14.510.409	0	(0,01)
	03.2023		£	4.461	3.625	0	(0,02)
	03.2023		HUF	1.245	481.623	13	0,00
	03.2023		MXN	2.037	40.713	26	0,01
	04.2023		PEN	30	115	0	0,00
JPM	01.2023	BRL	\$	19.424	3.724	45	0,01
	01.2023	ILS		64.808	18.907	530	0,12
	01.2023	PHP		479	9	0	0,00
	01.2023	RUB		62.115	891	39	0,01
	01.2023	\$	HUF	2.045	818.431	130	0,03
	01.2023		TRY	1.384	26.053	0	0,00
	02.2023	CAD	\$	253	186	0	(0,01)
	02.2023	\$	MXN	55	1.124	2	0,00
	02.2023		ZAR	19	326	0	0,00
	02.2023	ZAR	\$	3.406	197	0	(0,01)
	03.2023	IDR		400.391.725	25.581	0	(0,07)
	03.2023	ILS		1.611	460	2	0,00
	03.2023	MXN		41.257	2.058	1	(0,01)
	03.2023	\$	MXN	225	4.516	4	0,00
MBC	04.2023		BRL	3.658	19.424	0	(0,01)
	01.2023	CAD	\$	298	222	2	0,00
	01.2023	CNH		174	25	0	0,00
	01.2023	€		1.073	1.124	0	(0,01)
	01.2023	£		916	1.116	14	0,00
	01.2023	\$	HKD	106	829	0	0,00
	01.2023		ILS	87	299	0	(0,01)
	01.2023		MXN	20	387	0	0,00
	01.2023		PLN	9	40	0	0,00
	01.2023		TRY	423	7.975	0	(0,01)
	02.2023	AUD	\$	718	483	0	(0,01)
	02.2023	CHF		63	69	0	0,00
	02.2023	¥		58.600	433	0	(0,01)
	02.2023	\$	AUD	14	20	0	0,00
	02.2023		SEK	39	405	0	0,00
	03.2023	COP	\$	2.667.859	585	42	0,01
	03.2023	IDR		42.168.006	2.700	0	(0,01)
	03.2023	INR		232.795	2.796	0	(0,01)
	03.2023	\$	¥	2.400	322.475	67	0,02
MYI	03.2023		SGD	4.200	5.648	16	0,00
	01.2023	€	\$	171	182	0	(0,01)
	01.2023	\$	£	317	263	0	(0,01)
	01.2023		HUF	77	29.158	1	0,00
	02.2023	CHF	\$	365	394	0	(0,01)
	02.2023	SEK		8.650	851	19	0,00
	02.2023	\$	CHF	178	164	0	0,00
	02.2023		¥	187	25.400	7	0,00
	02.2023		NZD	6.575	10.199	0	(0,03)
	02.2023		ZAR	98	1.709	2	0,00
	02.2023	ZAR	\$	965	55	0	(0,01)
	03.2023	MXN		3.614	180	0	(0,01)
	03.2023	\$	CNH	5.100	35.198	15	0,00
	03.2023		€	1.342	1.250	0	(0,01)
	03.2023		MXN	7	146	0	0,00
	03.2023		NZD	1.658	2.600	0	(0,01)
RBC	01.2023	HKD	\$	9.279	1.192	3	0,00
	01.2023	\$	HKD	539	4.195	0	(0,01)
	01.2023		KRW	9	11.595	0	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	01.2023	\$ 177	SGD 240	\$ 2	\$ 0	\$ 2	0,00
	02.2023	CAD 184	\$ 135	0	(1)	(1)	0,00
	02.2023	\$ 21	AUD 31	0	0	0	0,00
	02.2023	2.346	£ 1.888	0	(72)	(72)	(0,02)
	03.2023	MXN 5	\$ 0	0	0	0	0,00
RYL	01.2023	\$ 57	SGD 77	0	0	0	0,00
	02.2023	5.260	CHF 4.837	0	(7)	(7)	0,00
	03.2023	INR 333.865	\$ 4.000	0	(14)	(14)	0,00
SCX	01.2023	\$ 271	TRY 5.125	1	0	1	0,00
	02.2023	AUD 2.973	\$ 2.046	26	0	26	0,01
	02.2023	CHF 105	114	0	0	0	0,00
	02.2023	\$ 23	CHF 21	0	0	0	0,00
	02.2023	105	€ 98	0	0	0	0,00
	02.2023	43	¥ 5.900	2	0	2	0,00
	02.2023	37	ZAR 635	0	0	0	0,00
	03.2023	CLP 36.535	\$ 41	0	(2)	(2)	0,00
	03.2023	\$ 1.010	CLP 874.432	7	0	7	0,00
	03.2023	3.300	HUF 1.327.567	169	0	169	0,04
	03.2023	15.390	KRW 19.462.194	101	0	101	0,02
	03.2023	9.427	PEN 36.306	36	0	36	0,01
	03.2023	3.600	THB 123.190	0	(19)	(19)	0,00
SOG	01.2023	736	BRL 3.883	0	(1)	(1)	0,00
	01.2023	169	SGD 229	2	0	2	0,00
	02.2023	CAD 734	\$ 542	0	0	0	0,00
SSB	03.2023	\$ 4.991	CLP 4.324.364	38	0	38	0,01
TOR	01.2023	CAD 2.400	\$ 1.750	0	(21)	(21)	0,00
	01.2023	CZK 1.002	44	0	0	0	0,00
	01.2023	¥ 2.344.000	16.044	0	(1.767)	(1.767)	(0,40)
	01.2023	\$ 88	CZK 2.036	2	0	2	0,00
	02.2023	CAD 6.200	\$ 4.624	65	(18)	47	0,01
	02.2023	\$ 13	CAD 18	0	0	0	0,00
	02.2023	61	ZAR 1.054	0	0	0	0,00
	03.2023	ILS 3.296	\$ 940	2	0	2	0,00
UAG	01.2023	3.019	881	25	0	25	0,01
	01.2023	\$ 174	CZK 4.001	3	0	3	0,00
	01.2023	7	HKD 56	0	0	0	0,00
	02.2023	€ 3.241	\$ 3.469	0	0	0	0,00
	02.2023	¥ 1.590.000	11.313	0	(813)	(813)	(0,19)
	02.2023	\$ 23	SEK 240	0	0	0	0,00
	02.2023	13	ZAR 231	0	0	0	0,00
	03.2023	ILS 6.936	\$ 1.980	7	0	7	0,00
	03.2023	\$ 2.300	CZK 52.642	17	0	17	0,00
				\$ 3.412	\$ (8.662)	\$ (5.250)	(1,20)

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Investor EUR (Hedged) thesaurierend und E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Netto- vermögens
BOA	01.2023	\$ 2.869	€ 2.721	\$ 36	\$ 0	\$ 36	0,01
BPS	01.2023	206	193	0	0	0	0,00
CBK	01.2023	€ 2.544	\$ 2.703	0	(12)	(12)	0,00
	01.2023	\$ 48.028	€ 46.237	1.340	0	1.340	0,31
MBC	01.2023	€ 1.992	\$ 2.111	0	(15)	(15)	(0,01)
	01.2023	\$ 53.062	€ 50.589	952	0	952	0,22
RYL	01.2023	€ 10	\$ 11	0	0	0	0,00
SCX	01.2023	\$ 45.082	€ 43.312	1.163	0	1.163	0,27
				\$ 3.491	\$ (27)	\$ 3.464	0,80

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend und Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Netto- vermögens
BRC	01.2023	£ 5	\$ 6	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	01.2023	\$ 12.683	£ 10.517	0	(30)	(30)	(0,01)
CBK	01.2023	12.684	10.517	0	(30)	(30)	(0,01)
SCX	01.2023	£ 263	\$ 316	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 12.677	£ 10.518	2	(25)	(23)	0,00
				\$ 2	\$ (85)	\$ (83)	(0,02)
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						\$ (1.834)	(0,42)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖGENS
EINLAGENZERTIFIKATE			
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd. 4,780 % fällig am 28.02.2023	\$ 600	\$ 600	0,14
Summe Einlagenzertifikate		\$ 600	0,14
Summe Anlagen		\$ 404.071	92,69
Sonstige Aktiva und Passiva		\$ 31.853	7,31
Nettovermögen		\$ 435.924	100,00

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

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

- (a) Nullkuponwertpapier.
 (b) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.
 (c) Mit dem Fonds verbunden.
 (d) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2021: 0):

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeits- datum	Kauf- datum	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
Deutsche Bank AG	0,898 %	28.05.2024	31.03.2022	\$ 970	\$ 936	0,21

Barmittel in Höhe von 21.987 USD (31. Dezember 2021: 8.489 USD) wurden zum 31. Dezember 2022 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Wertpapier mit einem Gesamtmarktwert von 0 USD (31. Dezember 2021: 281 USD) und Barmittel in Höhe von 6.601 USD (31. Dezember 2021: 260 EUR) wurden gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. zum 31. Dezember 2022 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 335.879	\$ 0	\$ 335.879
Investmentfonds	10.879	30.814	0	41.693
Pensionsgeschäfte	0	27.452	0	27.452
Finanzderivate ⁽³⁾	467	(2.020)	0	(1.553)
Einlagen bei Kreditinstituten	0	600	0	600
Summen	\$ 11.346	\$ 392.725	\$ 0	\$ 404.071

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

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 87.130	\$ 0	\$ 87.130
Investmentfonds	4.572	0	0	4.572
Pensionsgeschäfte	0	800	0	800
Finanzderivate ⁽³⁾	315	4.571	0	4.886
Summen	\$ 4.887	\$ 92.501	\$ 0	\$ 97.388

⁽¹⁾ Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

⁽²⁾ Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

⁽³⁾ Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung des Marktwerts der außerbörslich gehandelten Finanzderivate und (erhaltenen)/verpfändeten Sicherheiten nach Kontrahenten zum 31. Dezember 2022 und 31. Dezember 2021:

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2022			Zum 31. Dez. 2021		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Nettoengagement ⁽¹⁾
BOA	\$ (475)	\$ 490	\$ 15	\$ 272	\$ (280)	\$ (8)
BPS	(159)	380	221	(424)	260	(164)
BRC	(2.750)	2.340	(410)	(60)	0	(60)
CBK	1.779	(2.180)	(401)	(159)	0	(159)
CKL	22	0	22	(24)	0	(24)
CLY	157	0	157	k. A.	k. A.	k. A.
DUB	k. A.	k. A.	k. A.	1	0	1

Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund (Forts.) 31. Dezember 2022

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2022			Zum 31. Dez. 2021		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Nettoengagement ⁽¹⁾
FBF	\$ k. A.	\$ k. A.	\$ k. A.	\$ 17	\$ 0	\$ 17
GLM	(251)	330	79	(377)	281	(96)
GST	(299)	261	(38)	k. A.	k. A.	k. A.
HUS	267	(260)	7	(51)	0	(51)
IND	(8)	0	(8)	399	(290)	109
JPM	153	(390)	(237)	112	(180)	(68)
MBC	931	(880)	51	k. A.	k. A.	k. A.
MEI	(165)	450	285	94	0	94
MYC	204	0	204	37	0	37
MYI	(99)	120	21	(9)	0	(9)
RBC	(69)	50	(19)	58	0	58
RYL	(21)	0	(21)	2	0	2
SCX	1.408	(1.310)	98	91	0	91
SOG	1	0	1	1	0	1
SSB	38	0	38	k. A.	k. A.	k. A.
TOR	(1.737)	1.620	(117)	(110)	0	(110)
UAG	(761)	560	(201)	(70)	0	(70)

⁽¹⁾ Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2022:

	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	28,54	14,64
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	48,50	70,97
Investmentfonds	9,56	4,49
Pensionsgeschäfte	6,30	0,79
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,13	0,30
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,06)	4,69
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,42)	(0,20)
Einlagenzertifikate	0,14	k. A.

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2022 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
Unternehmensanleihen und Wechsel	39,15	10,28
Kommunalanleihen und Wechsel	0,23	0,49
US-Regierungsbehörden	1,39	2,50
Non-Agency-MBS	0,45	1,97
Forderungsbesicherte Wertpapiere	1,06	2,47
Staatsemissionen	0,53	0,49
Kurzfristige Instrumente	34,23	67,41
Investmentfonds	9,56	4,49
Pensionsgeschäfte	6,30	0,79
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,13	0,30
Futures		
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	k. A.	(0,05)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,09	0,01
Zinsswaps	(0,15)	4,73
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Devisenoptionen	k. A.	0,00
Zinsswaps	0,04	0,13
Total Return Swaps auf Indizes	(0,04)	0,09
Devisenterminkontrakte	(1,20)	(0,55)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,78	0,13
Einlagenzertifikate	0,14	k. A.
Sonstige Aktiva und Passiva	7,31	4,32
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- NETTO-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ GENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE			
ÖSTERREICH			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Erste Group Bank AG 6,500 % fällig am 15.04.2024 (d)(f)	€ 200	£ 174	0,05
BELGIEN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Sofina S.A. 1,000 % fällig am 23.09.2028	400	277	0,07
KANADA			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Canadian Imperial Bank of Commerce 4,403 % fällig am 15.12.2025	£ 750	758	0,20
KAIMANINSELN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Trafford Centre Finance Ltd. 4,750 % fällig am 28.04.2029	500	470	0,12
DÄNEMARK			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Orsted A/S 2,500 % fällig am 16.05.2033 5,125 % fällig am 13.09.2034	1.500 1.400	1.187 1.382	0,30 0,36
TDC Net A/S 5,056 % fällig am 31.05.2028	€ 700	612	0,16
Summe Dänemark		3.181	0,82
FRANKREICH			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
AXA S.A. 5,453 % fällig am 04.03.2026 (d)	£ 850	830	0,21
Banque Federative du Credit Mutuel S.A. 4,875 % fällig am 25.09.2025	1.200	1.189	0,31
BNP Paribas S.A. 1,250 % fällig am 13.07.2031 2,000 % fällig am 13.09.2036 2,875 % fällig am 24.02.2029 4,625 % fällig am 25.02.2031 (d)(f) 7,750 % fällig am 16.08.2029 (d)(f)	500 800 1.700 \$ 900 700	355 530 1.448 580 576	0,09 0,14 0,37 0,15 0,15
Credit Agricole S.A. 5,750 % fällig am 29.11.2027 7,500 % fällig am 23.06.2026 (d)(f)	£ 1.400 750	1.395 730	0,36 0,19
Electricite de France S.A. 5,125 % fällig am 22.09.2050 5,500 % fällig am 27.03.2037 5,500 % fällig am 17.10.2041 6,125 % fällig am 02.06.2034	1.050 2.000 1.000 400	922 1.898 935 403	0,24 0,49 0,24 0,10
JCDecaux SE 1,625 % fällig am 07.02.2030	€ 200	142	0,04
LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE 1,125 % fällig am 11.02.2027	£ 1.400	1.224	0,31
Societe Generale S.A. 7,375 % fällig am 04.10.2023 (d)(f) 7,875 % fällig am 18.12.2023 (d)(f)	\$ 200 400	159 330	0,04 0,08
Summe Frankreich		13.646	3,51
DEUTSCHLAND			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Commerzbank AG 8,625 % fällig am 28.02.2033	£ 900	905	0,23
Deutsche Bahn Finance GmbH 1,875 % fällig am 13.02.2026	500	464	0,12
Deutsche Bank AG 1,375 % fällig am 17.02.2032 1,875 % fällig am 22.12.2028	€ 900 £ 2.900	583 2.310	0,15 0,59
DVI Deutsche Vermögens- & Immobilienverwaltungs GmbH 2,500 % fällig am 25.01.2027	€ 600	399	0,10
Hamburg Commercial Bank AG 6,250 % fällig am 18.11.2024	1.100	989	0,25

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- NETTO-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ GENS
IHO Verwaltungen GmbH (3,750 % bar oder 3,750 % fällig am 15.09.2026 (a))	€ 200	£ 155	0,04
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0,875 % fällig am 15.09.2026 1,125 % fällig am 04.07.2025 5,750 % fällig am 07.06.2032	£ 900 700 400	795 648 449	0,20 0,17 0,12
Schaeffler AG 2,750 % fällig am 12.10.2025	€ 400	339	0,09
Summe		8.036	2,06
STAATSEMISSIONEN			
State of Saxony-Anhalt 1,125 % fällig am 16.12.2024	£ 600	574	0,15
Summe Deutschland		8.610	2,21
IRLAND			
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE			
Toro European CLO DAC 2,239 % fällig am 12.01.2032	€ 3.600	3.077	0,79
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Bank of Ireland Group PLC 6,750 % fällig am 01.03.2033	100	88	0,02
GE Capital UK Funding Unlimited Co. 5,875 % fällig am 18.01.2033	£ 1.500	1.527	0,39
Perrigo Finance Unlimited Co. 4,400 % fällig am 15.06.2030	\$ 200	142	0,04
Summe Irland		1.757	0,45
Summe Irland		4.834	1,24
ITALIEN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Aeroporto di Roma SpA 5,441 % fällig am 20.02.2023	£ 550	549	0,14
Intesa Sanpaolo SpA 5,148 % fällig am 10.06.2030	600	490	0,13
Nexi SpA 1,625 % fällig am 30.04.2026 2,125 % fällig am 30.04.2029	€ 160 300	130 217	0,03 0,06
UniCredit SpA 7,830 % fällig am 04.12.2023	\$ 1.000	840	0,21
Summe Italien		2.226	0,57
JAPAN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
East Japan Railway Co. 1,162 % fällig am 15.09.2028	£ 1.500	1.211	0,31
JERSEY, KANALINSELN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
AA Bond Co. Ltd. 4,875 % fällig am 31.07.2043	2.500	2.370	0,61
Gatwick Funding Ltd. 2,500 % fällig am 15.04.2032	600	481	0,12
Heathrow Funding Ltd. 2,750 % fällig am 13.10.2031 2,750 % fällig am 09.08.2051 4,625 % fällig am 31.10.2046	1.000 1.100 1.100	828 651 906	0,21 0,17 0,23
HSBC Bank Capital Funding Sterling LP 5,844 % fällig am 05.11.2031 (d)	1.400	1.433	0,37
Summe Jersey, Kanalinseln		6.669	1,71
LUXEMBURG			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Aroundtown S.A. 3,625 % fällig am 10.04.2031	800	487	0,12
Bevco Lux SARL 1,000 % fällig am 16.01.2030	€ 1.300	869	0,22
CK Hutchison Group Telecom Finance S.A. 2,000 % fällig am 17.10.2027	£ 450	383	0,10
CPI Property Group S.A. 2,750 % fällig am 22.01.2028	1.150	770	0,20

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- NETTO-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ GENS
Logicor Financing SARL 2,750 % fällig am 15.01.2030	£ 1.800	£ 1.373	0,35
Prologis International Funding S.A. 2,750 % fällig am 22.02.2032	900	723	0,19
Summe Luxemburg		4.605	1,18
NIEDERLANDE			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
ABN AMRO Bank NV 4,375 % fällig am 22.09.2025 (d)(f)	€ 1.000	820	0,21
Cooperatieve Rabobank UA 1,250 % fällig am 14.01.2025 1,875 % fällig am 12.07.2028	£ 300 800	277 679	0,07 0,18
3,100 % fällig am 29.06.2028 (d)(f) 4,375 % fällig am 29.06.2027 (d)(f) 4,625 % fällig am 23.05.2029 5,250 % fällig am 14.09.2027	€ 400 800 £ 1.500 600	275 634 1.371 580	0,07 0,16 0,35 0,15
CTP NV 0,875 % fällig am 20.01.2026	€ 700	506	0,13
E.ON International Finance BV 4,750 % fällig am 31.01.2034 5,875 % fällig am 30.10.2037 6,125 % fällig am 06.07.2039 6,250 % fällig am 03.06.2030 6,375 % fällig am 07.06.2032	£ 2.000 1.100 700 250 600	1.845 1.106 720 261 636	0,47 0,28 0,19 0,07 0,16
Enel Finance International NV 2,875 % fällig am 11.04.2029 5,000 % fällig am 15.06.2032 5,750 % fällig am 14.09.2040 7,500 % fällig am 14.10.2032	1.300 \$ 1.000 £ 1.400 \$ 200	1.115 751 1.365 176	0,29 0,19 0,35 0,05
Holcim Sterling Finance Netherlands BV 2,250 % fällig am 04.04.2034	£ 1.300	893	0,23
ING Groep NV 1,125 % fällig am 07.12.2028	1.500	1.203	0,31
JAB Holdings BV 2,250 % fällig am 19.12.2039	€ 600	364	0,09
JDE Peet's NV 0,500 % fällig am 16.01.2029	600	426	0,11
NE Property BV 3,375 % fällig am 14.07.2027	800	616	0,16
NN Group NV 4,500 % fällig am 15.01.2026 (d) 5,250 % fällig am 01.03.2043	300 200	260 165	0,07 0,04
Sagax Euro MTN NL BV 0,750 % fällig am 26.01.2028	400	267	0,07
Toyota Motor Finance Netherlands BV 4,625 % fällig am 08.06.2026	£ 700	693	0,18
Universal Music Group NV 3,750 % fällig am 30.06.2032	€ 200	169	0,04
Volkswagen Financial Services NV 0,875 % fällig am 20.02.2025 1,125 % fällig am 18.09.2023 2,125 % fällig am 18.01.2028	£ 400 200 2.700	362 195 2.244	0,09 0,05 0,58
Summe Niederlande		20.974	5,39
STAATSEMISSIONEN			
Nederlandse Waterschapsbank NV 5,375 % fällig am 07.06.2032	1.000	1.081	0,28
Summe Niederlande		22.055	5,67
NORWEGEN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
DNB Bank ASA 2,625 % fällig am 10.06.2026	700	660	0,17
Equinor ASA 4,250 % fällig am 10.04.2041	1.100	979	0,25
Summe Norwegen		1.639	0,42
SINGAPUR			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Temasek Financial Ltd. 5,125 % fällig am 26.07.2040	770	784	0,20

Aufstellung der Wertpapieranlagen des UK Corporate Bond Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
SPANIEN				SPANIEN				SPANIEN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Aberis Infraestructuras S.A. 3,375 % fällig am 27.11.2026	£ 700	£ 635	0,16	8,407 % fällig am 14.11.2032	£ 600	620	0,16	LCR Finance PLC 4,500 % fällig am 07.12.2038	1.400	1.402	0,36
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. 5,875 % fällig am 24.09.2023 (d)(f)	€ 400	342	0,09	Berkeley Group PLC 2,500 % fällig am 11.08.2031	1.200	805	0,21	Legal & General Group PLC 5,375 % fällig am 27.10.2045	1.200	1.170	0,30
Banco Santander S.A. 1,500 % fällig am 14.04.2026	£ 700	611	0,16	Beyond Housing Ltd. 2,125 % fällig am 17.05.2051	500	277	0,07	5,625 % fällig am 24.03.2031 (d)(f)	850	734	0,19
4,375 % fällig am 14.01.2026 (d)(f)	€ 600	454	0,12	BG Energy Capital PLC 5,000 % fällig am 04.11.2036	300	291	0,07	Lloyds Banking Group PLC 2,000 % fällig am 12.04.2028	1.200	1.021	0,26
CaixaBank S.A. 1,500 % fällig am 03.12.2026	£ 1.300	1.136	0,29	Blend Funding PLC 3,459 % fällig am 21.09.2049	800	598	0,15	3,574 % fällig am 07.11.2028	\$ 800	599	0,15
3,500 % fällig am 06.04.2028	900	800	0,21	British Land Co. PLC 2,375 % fällig am 14.09.2029	2.000	1.579	0,41	4,947 % fällig am 27.06.2025 (d)(f)	€ 400	341	0,09
5,875 % fällig am 09.10.2027 (d)(f)	€ 400	326	0,08	British Telecommunications PLC 3,125 % fällig am 21.11.2031	800	668	0,17	London & Quadrant Housing Trust 2,000 % fällig am 20.10.2038	£ 1.250	779	0,20
Summe Spanien		4.304	1,11	Cadent Finance PLC 2,625 % fällig am 22.09.2038	950	646	0,17	London Power Networks PLC 5,125 % fällig am 31.03.2023	150	150	0,04
				2,750 % fällig am 22.09.2046	700	432	0,11	M&G PLC 5,625 % fällig am 20.10.2051	400	365	0,09
				Chanel Ceres PLC 0,500 % fällig am 31.07.2026	€ 600	480	0,12	Manchester Airport Group Funding PLC 2,875 % fällig am 31.03.2039	235	164	0,04
				Clarion Funding PLC 1,875 % fällig am 22.01.2035	£ 1.500	1.021	0,26	2,875 % fällig am 30.09.2044	900	577	0,15
				1,875 % fällig am 07.09.2051	1.400	680	0,17	4,750 % fällig am 31.03.2034	400	367	0,09
				3,125 % fällig am 19.04.2048	300	202	0,05	Marks & Spencer PLC 3,750 % fällig am 19.05.2026	500	437	0,11
				Compass Group PLC 4,375 % fällig am 08.09.2032	1.100	1.057	0,27	Metropolitan Housing Trust Ltd. 1,875 % fällig am 28.07.2036	1.800	1.184	0,30
				Derwent London PLC 1,875 % fällig am 17.11.2031	900	636	0,16	Mitchells & Butlers Finance PLC 5,219 % fällig am 15.12.2030	\$ 1.258	970	0,25
				Direct Line Insurance Group PLC 4,000 % fällig am 05.06.2032	800	629	0,16	5,965 % fällig am 15.12.2025	£ 79	78	0,02
				Eastern Power Networks PLC 2,125 % fällig am 25.11.2033	819	611	0,16	6,013 % fällig am 15.12.2030	432	404	0,10
				EMH Treasury PLC 4,500 % fällig am 29.01.2044	300	268	0,07	Morhomes PLC 3,400 % fällig am 19.02.2040	1.100	855	0,22
				ENW Finance PLC 1,415 % fällig am 30.07.2030	400	305	0,08	Motability Operations Group PLC 2,125 % fällig am 18.01.2042	1.800	1.189	0,31
				Ferguson Finance PLC 3,250 % fällig am 02.06.2030	\$ 200	141	0,04	3,625 % fällig am 10.03.2036	1.250	1.100	0,28
				GlaxoSmithKline Capital PLC 1,625 % fällig am 12.05.2035	£ 2.100	1.476	0,38	5,625 % fällig am 29.11.2030	100	106	0,03
				Grainger PLC 3,000 % fällig am 03.07.2030	1.085	816	0,21	National Grid Electricity Distribution East Midlands PLC 1,750 % fällig am 09.09.2031	1.600	300	0,08
				Greene King Finance PLC 3,593 % fällig am 15.03.2035	369	307	0,08	6,250 % fällig am 10.12.2040	300	317	0,08
				4,064 % fällig am 15.03.2035	210	178	0,05	National Grid Electricity Distribution South Wales PLC 5,750 % fällig am 23.03.2040	850	852	0,22
				5,106 % fällig am 15.03.2034	552	487	0,12	National Grid Electricity Distribution West Midlands PLC 5,750 % fällig am 16.04.2032	1.600	1.620	0,42
				5,318 % fällig am 15.09.2031	1.415	1.315	0,34	National Grid Electricity Transmission PLC 1,125 % fällig am 07.07.2028	1.400	1.116	0,29
				GSK Consumer Healthcare Capital UK PLC 2,875 % fällig am 29.10.2028	1.197	1.073	0,28	2,750 % fällig am 06.02.2035	900	675	0,17
				3,375 % fällig am 29.03.2038	1.100	874	0,22	National Grid Gas PLC 1,375 % fällig am 07.02.2031	800	585	0,15
				HSBC Holdings PLC 1,750 % fällig am 24.07.2027	1.000	861	0,22	Nationwide Building Society 5,875 % fällig am 20.12.2024 (d)(f)	900	852	0,22
				2,625 % fällig am 16.08.2028	1.400	1.190	0,31	6,178 % fällig am 07.12.2027	1.200	1.204	0,31
				3,000 % fällig am 22.07.2028	1.100	959	0,25	NatWest Group PLC 2,057 % fällig am 09.11.2028	1.800	1.503	0,39
				3,000 % fällig am 29.05.2030	1.700	1.414	0,36	2,875 % fällig am 19.09.2026	500	459	0,12
				4,000 % fällig am 09.03.2026 (d)(f)	\$ 200	144	0,04	3,125 % fällig am 28.03.2027	500	456	0,12
				4,600 % fällig am 17.12.2030 (d)(f)	500	324	0,08	3,619 % fällig am 29.03.2029	600	525	0,13
				5,875 % fällig am 28.09.2026 (d)(f)	£ 900	805	0,21	5,076 % fällig am 27.01.2030	\$ 400	314	0,08
				6,000 % fällig am 29.09.2023 (d)(f)	€ 200	176	0,05	5,125 % fällig am 12.05.2027 (d)(f)	£ 1.100	927	0,24
				6,000 % fällig am 22.05.2027 (d)(f)	\$ 600	459	0,12	7,416 % fällig am 06.06.2033	600	605	0,16
				6,000 % fällig am 29.03.2040	£ 978	896	0,23	NatWest Markets PLC 6,375 % fällig am 08.11.2027	1.300	1.332	0,34
				Hyde Housing Association Ltd. 5,125 % fällig am 23.07.2040	800	783	0,20	Network Rail Infrastructure Finance PLC 4,750 % fällig am 29.11.2035	1.800	1.839	0,47
				Informa PLC 3,125 % fällig am 05.07.2026	1.345	1.216	0,31	NIE Finance PLC 5,875 % fällig am 01.12.2032	1.100	1.135	0,29
				InterContinental Hotels Group PLC 2,125 % fällig am 24.08.2026	1.000	871	0,22	Northern Gas Networks Finance PLC 4,875 % fällig am 15.11.2035	250	231	0,06
				3,375 % fällig am 08.10.2028	400	346	0,09	5,625 % fällig am 23.03.2040	50	48	0,01
				John Lewis PLC 4,250 % fällig am 18.12.2034	1.344	818	0,21	Northern Powergrid Yorkshire PLC 4,375 % fällig am 05.07.2032	300	282	0,07
				6,125 % fällig am 21.01.2025	400	385	0,10	5,125 % fällig am 04.05.2035	200	195	0,05
				Karbon Homes Ltd. 3,375 % fällig am 15.11.2047	400	301	0,08	Northumbrian Water Finance PLC 5,625 % fällig am 29.04.2033	750	755	0,19
				Land Securities Capital Markets PLC 2,399 % fällig am 08.02.2031	£ 1.251	£ 1.083	0,28	6,375 % fällig am 28.10.2034	950	1.012	0,26
								Notting Hill Genesis 2,000 % fällig am 03.06.2036	700	467	0,12
								2,875 % fällig am 31.01.2029	900	785	0,20
								3,250 % fällig am 12.10.2048	1.000	683	0,18

Aufstellung der Wertpapieranlagen des UK Corporate Bond Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	% DES		BESCHREIBUNG	PARI (000S)	% DES		BESCHREIBUNG	PARI (000S)	% DES	
		MARKT-WERT (000S)	NETTO-VERMÖGENS			MARKT-WERT (000S)	NETTO-VERMÖGENS			MARKT-WERT (000S)	NETTO-VERMÖGENS
3,882 % fällig am 24.07.2038	\$ 200	139	0,04	T-Mobile USA, Inc.	\$ 400	302	0,08	US-REGIERUNGSBEHÖRDEN			
4,203 % fällig am 23.07.2029	400	310	0,08	3,875 % fällig am 15.04.2030	100	83	0,02	Fannie Mae	\$ 4	3	0,00
Liberty Mutual Group, Inc.				5,200 % fällig am 15.01.2033				2,560 % fällig am 01.08.2036	4	3	0,00
4,625 % fällig am 02.12.2030	€ 500	424	0,11	Time Warner Cable LLC	€ 1.100	887	0,23	2,889 % fällig am 01.07.2044	4	3	0,00
MassMutual Global Funding				5,250 % fällig am 15.07.2042						6	0,00
1,375 % fällig am 15.12.2026	€ 700	614	0,16	Verizon Communications, Inc.				Summe USA		45.465	11,68
McDonald's Corp.				1,875 % fällig am 19.09.2030	500	398	0,10	KURZFRISTIGE INSTRUMENTE			
2,950 % fällig am 15.03.2034	500	413	0,11	1,875 % fällig am 03.11.2038	700	445	0,11	U.K. TREASURY BILLS			
Metropolitan Life Global Funding				2,500 % fällig am 08.04.2031	1.400	1.152	0,30	3,360 % fällig am 13.03.2023	€ 1.500	1.491	0,38
0,625 % fällig am 08.12.2027	400	327	0,08	3,125 % fällig am 02.11.2035	200	160	0,04	(b)(c)			
1,625 % fällig am 21.09.2029	400	328	0,08	3,375 % fällig am 27.10.2036	1.200	977	0,25	Summe kurzfristige Instrumente		1.491	0,38
3,500 % fällig am 30.09.2026	740	705	0,18	4,750 % fällig am 17.02.2034	550	526	0,14	Summe Übertragbare Wertpapiere	€	372.745	95,78
Morgan Stanley				Wells Fargo & Co.				INVESTMENTFONDS			
5,789 % fällig am 18.11.2033	900	903	0,23	2,125 % fällig am 24.09.2031	1.800	1.379	0,35	BÖRSENGEHADELTE FONDS			
MPT Operating Partnership LP				2,500 % fällig am 02.05.2029	1.750	1.456	0,37	PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short	2.500	214	0,06
2,500 % fällig am 24.03.2026	1.400	1.115	0,29	3,500 % fällig am 12.09.2029	700	618	0,16	Maturity UCITS ETF (e)			
2,550 % fällig am 05.12.2023	200	190	0,05	Welltower, Inc.				PIMCO ETFs plc - PIMCO Sterling	51.000	5.156	1,32
3,692 % fällig am 05.06.2028	400	294	0,08	4,800 % fällig am 20.11.2028	500	464	0,12	Short Maturity UCITS ETF (e)			
Nestle Holdings, Inc.								Summe Investmentfonds	€	5.370	1,38
2,500 % fällig am 04.04.2032	1.500	1.265	0,33	NON-AGENCY-MBS							
Netflix, Inc.				Deutsche ALT-A Securities, Inc. Mortgage Loan Trust							
3,875 % fällig am 15.11.2029	€ 600	499	0,13	4,889 % fällig am 25.04.2035	\$ 95	74	0,02				
New York Life Global Funding				Sequoia Mortgage Trust							
1,250 % fällig am 17.12.2026	€ 500	436	0,11	3,051 % fällig am 20.07.2037 ^	7	4	0,00				
4,350 % fällig am 16.09.2025	1.600	1.585	0,41	Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust							
Oracle Corp.				3,780 % fällig am 25.02.2034	1	1	0,00				
6,150 % fällig am 09.11.2029 (g)	\$ 1.100	951	0,24	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust							
6,250 % fällig am 09.11.2032 (g)	400	349	0,09	3,248 % fällig am 25.11.2042	13	10	0,00				
Pfizer, Inc.											
2,735 % fällig am 15.06.2043	€ 1.000	731	0,19								
Realty Income Corp.											
1,750 % fällig am 13.07.2033	1.100	760	0,20								

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft ⁽¹⁾	% des Netto- vermögens
FICC	1,900 %	30.12.2022	03.01.2023	\$ 213	U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 29.06.2023	£ (181)	£ 177	£ 177	0,05
Summe Pensionsgeschäfte						£ (181)	£ 177	£ 177	0,05

⁽¹⁾ Umfasst aufgelaufene Zinsen.

AN EINEM GEREGLTEN MARKT GEHADELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*, außer Anzahl der Kontrakte)

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Netto- vermögens
Euro-Bobl March Futures	Short	03.2023	27	£ 91	0,03
Euro-Bund 10-Year Bond March Futures	Short	03.2023	61	464	0,12
Japan Government 10-Year Bond March Futures	Short	03.2023	5	82	0,02
U.S. Treasury 5-Year Note March Futures	Short	03.2023	96	4	0,00
U.S. Treasury 10-Year Note March Futures	Long	03.2023	119	(26)	(0,01)
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond March Futures	Short	03.2023	14	(4)	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond March Futures	Short	03.2023	2	1	0,00
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				£ 612	0,16

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Rolls-Royce PLC	1,000 %	20.06.2024	€ 1.700	£ (21)	(0,01)

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.IG-39 5-Year Index	1,000 %	20.12.2027	\$ 28.700	£ 264	0,07
iTraxx Europe Main 37 5-Year Index	1,000	20.06.2027	€ 4.350	11	0,00
iTraxx Europe Main 38 5-Year Index	1,000	20.12.2027	13.300	124	0,03
				£ 399	0,10

ZINSSWAPS

Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung ⁽³⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	0,500 %	21.09.2024	£ 59.600	£ (170)	(0,04)
Erhalt ⁽³⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	2,000	15.03.2023	1.100	30	0,01
Zahlung ⁽³⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	2,250	15.03.2028	18.000	31	0,01
Zahlung	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	2,728	16.12.2025	44.800	(365)	(0,09)
Zahlung	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	4,000	08.11.2027	20.800	85	0,02
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,000	15.12.2026	\$ 3.100	(279)	(0,07)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,250	17.06.2030	9.200	1.448	0,37
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,500	18.12.2029	9.300	1.018	0,26
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	2,000	12.02.2045	2.100	(451)	(0,12)
Erhalt ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	1,500	15.03.2025	€ 10.300	196	0,05
Erhalt ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	1,500	15.03.2028	400	15	0,00
Zahlung ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	1,750	15.03.2033	3.500	(48)	(0,01)
					£ 1.510	0,39
					£ 1.888	0,48

Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate

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

⁽²⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert.

⁽³⁾ Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

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

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

VERKAUFSOPTIONEN

CREDIT DEFAULT SWAPPTIONS AUF KREDITINDIZES

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/-verkauf	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
GST	Put – OTC iTraxx Europe 37 5-Year Index	Verkauf	3,000 %	15.03.2023	1.900	£ (3)	£ 0	0,00

ZINSSWAPPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
GLM	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,547 %	07.03.2023	1.600	£ (29)	£ (3)	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,547	07.03.2023	1.600	(29)	(84)	(0,03)
							£ (58)	£ (87)	(0,03)

⁽¹⁾ Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

DEWISENTERMININKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	02.2023	€ 133	£ 117	£ 0	£ (1)	£ (1)	0,00
	02.2023	\$ 15.253	12.926	261	0	261	0,07
JPM	01.2023	8	CNY 54	0	0	0	0,00
	03.2023	14	97	0	0	0	0,00
MBC	02.2023	€ 2.345	£ 2.048	0	(36)	(36)	(0,01)
	02.2023	£ 317	€ 361	4	0	4	0,00
	02.2023	425	\$ 508	0	(3)	(3)	0,00
	02.2023	¥ 13.900	£ 85	0	(3)	(3)	0,00
	02.2023	\$ 3.071	2.579	32	(3)	29	0,01
MYI	02.2023	€ 353	306	0	(8)	(8)	0,00
SSB	02.2023	19.078	16.744	0	(213)	(213)	(0,06)

Aufstellung der Wertpapieranlagen des UK Corporate Bond Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
UAG	02.2023	£ 83	\$ 100	£ 0	£ 0	£ 0	0,00
				£ 297	£ (267)	£ 30	0,01
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						£ (57)	(0,02)
Summe Anlagen						£ 380.735	97,83
Sonstige Aktiva und Passiva						£ 8.438	2,17
Nettovermögen						£ 389.173	100,00

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

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

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.

(b) Nullkuponwertpapier.

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

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

(e) Mit dem Fonds verbunden.

(f) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(g) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2021: 0,04 %):

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeits- datum	Kauf- datum	Kosten	Markt- wert	% des Nettover- mögens
Oracle Corp.	6,150 %	09.11.2029	07.11.2022	£ 969	£ 951	0,24
Oracle Corp.	6,250	09.11.2032	07.11.2022	348	349	0,09
				£ 1.307	£ 1.300	0,33

Wertpapier mit einem Gesamtmarktwert von 0 GBP (31. Dezember 2021: 514 GBP) wurden gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen zum 31. Dezember 2022 als Sicherheiten verpfändet.

Barmittel in Höhe von 7.199 GBP (31. Dezember 2021: 9.505 GBP) wurden zum 31. Dezember 2022 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten			Marktwert
	notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	
Übertragbare Wertpapiere	£ 0	£ 372.745	£ 0	£ 372.745
Investmentfonds	0	5.370	0	5.370
Pensionsgeschäfte	0	177	0	177
Finanzderivate ⁽³⁾	637	1.806	0	2.443
Summen	£ 637	£ 380.098	£ 0	£ 380.735

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

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten			Marktwert
	notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	
Übertragbare Wertpapiere	£ 0	£ 571.865	£ 0	£ 571.865
Investmentfonds	208	0	0	208
Pensionsgeschäfte	0	526	0	526
Finanzderivate ⁽³⁾	160	(1.074)	0	(914)
Summen	£ 368	£ 571.317	£ 0	£ 571.685

⁽¹⁾ Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

⁽²⁾ Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

⁽³⁾ Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung des Marktwerts der außerbörslich gehandelten Finanzderivate und (erhaltenen)/verpfändeten Sicherheiten nach Kontrahenten zum 31. Dezember 2022 und 31. Dezember 2021:

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2022			Zum 31. Dez. 2021		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾
BOA	£ 260	£ (330)	£ (70)	£ (80)	£ 0	£ (80)
BRC	k. A.	k. A.	k. A.	(14)	0	(14)
CBK	k. A.	k. A.	k. A.	391	0	391
DUB	k. A.	k. A.	k. A.	9	0	9
GLM	(87)	0	(87)	(52)	0	(52)
HUS	k. A.	k. A.	k. A.	21	0	21
JPM	k. A.	k. A.	k. A.	177	(189)	(12)
MBC	(9)	0	(9)	k. A.	k. A.	k. A.
MYC	k. A.	k. A.	k. A.	(3)	0	(3)
MYI	(8)	0	(8)	(7)	0	(7)
RBC	k. A.	k. A.	k. A.	(14)	0	(14)
SCX	k. A.	k. A.	k. A.	(27)	0	(27)
SSB	(213)	0	(213)	k. A.	k. A.	k. A.
UAG	k. A.	k. A.	k. A.	345	0	345

⁽¹⁾ Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2022:

	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	94,43	93,80
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	1,35	2,74
Sonstige übertragbare Wertpapiere	k. A.	0,02
Investmentfonds	1,38	0,04
Pensionsgeschäfte	0,05	0,09
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,16	0,02
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,48	(0,30)
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,02)	0,13
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	k. A.	(0,09)

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2022 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
Australien	k. A.	0,09
Österreich	0,05	0,18
Belgien	0,07	0,75
Brasilien	k. A.	0,27
Kanada	0,20	0,37
Kaimaninseln	0,12	0,31
Dänemark	0,82	0,43
Finnland	k. A.	0,41
Frankreich	3,51	4,09
Deutschland	2,21	1,95
Guernsey, Kanalinseln	k. A.	0,27
Indien	k. A.	0,04
Irland	1,24	1,73
Insel Man	k. A.	0,13
Italien	0,57	2,26
Japan	0,31	0,49
Jersey, Kanalinseln	1,71	2,52
Luxemburg	1,18	2,59
Mauritius	k. A.	0,39
Niederlande	5,67	5,25
Norwegen	0,42	0,13
Singapur	0,20	0,41
Slowenien	k. A.	0,13
Südkorea	k. A.	0,06
Spanien	1,11	1,56
Supranational	3,11	2,95
Schweden	0,44	0,42
Schweiz	0,89	2,09
Großbritannien	59,89	52,85
USA	11,68	11,42
Kurzfristige Instrumente	0,38	0,02
Investmentfonds	1,38	0,04
Pensionsgeschäfte	0,05	0,09
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,16	0,02
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf	(0,01)	(0,01)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,10	0,01
Zinsswaps	0,39	(0,30)

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaptions auf Kreditindizes	0,00	0,00
Zinsswapoptionen	(0,03)	k. A.
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf	k. A.	0,03
Devisenterminkontrakte	0,01	0,10
Sonstige Aktiva und Passiva	2,17	3,46
Nettovermögen	100,00	100,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des UK Long Term Corporate Bond Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Eli Lilly & Co. 1,625 % fällig am 14.09.2043	£ 500	£ 303	0,09	Mondelez International, Inc. 3,875 % fällig am 06.03.2045	£ 100	£ 76	0,02	3,375 % fällig am 27.10.2036	2.800	2.279	0,70
Entergy Corp. 3,750 % fällig am 15.06.2050	\$ 57	35	0,01	Morgan Stanley 5,789 % fällig am 18.11.2033	800	802	0,25	Walmart, Inc. 5,250 % fällig am 28.09.2035	200	212	0,07
Fiserv, Inc. 3,000 % fällig am 01.07.2031	£ 650	542	0,17	MPT Operating Partnership LP 3,375 % fällig am 24.04.2030	1.600	1.049	0,32	5,625 % fällig am 27.03.2034	200	219	0,07
Ford Motor Credit Co. LLC 2,748 % fällig am 14.06.2024	700	663	0,20	3,692 % fällig am 05.06.2028	1.400	1.028	0,32	Wells Fargo & Co. 2,125 % fällig am 24.09.2031	400	306	0,09
4,535 % fällig am 06.03.2025	900	858	0,26	National Fuel Gas Co. 2,950 % fällig am 01.03.2031	\$ 159	104	0,03	4,625 % fällig am 02.11.2035	1.729	1.592	0,49
Goldman Sachs Group, Inc. 3,615 % fällig am 15.03.2028	\$ 65	50	0,02	Nestle Holdings, Inc. 2,500 % fällig am 04.04.2032	£ 1.000	844	0,26	4,875 % fällig am 29.11.2035	1.500	1.369	0,42
3,625 % fällig am 29.10.2029	£ 1.900	1.697	0,52	Netfix, Inc. 3,625 % fällig am 15.06.2030	€ 600	491	0,15				
4,411 % fällig am 23.04.2039	\$ 800	577	0,18	Northern States Power Co. 2,900 % fällig am 01.03.2050	\$ 300	172	0,05				
7,250 % fällig am 10.04.2028	£ 300	323	0,10	Oracle Corp. 6,900 % fällig am 09.11.2052 (f)	1.900	1.699	0,52				
Home Depot, Inc. 3,500 % fällig am 15.09.2056	\$ 58	36	0,01	Pfizer, Inc. 2,735 % fällig am 15.06.2043	£ 2.600	1.902	0,59				
JPMorgan Chase & Co. 1,895 % fällig am 28.04.2033	£ 800	602	0,19	Realty Income Corp. 1,750 % fällig am 13.07.2033	1.100	760	0,23				
3,882 % fällig am 24.07.2038	\$ 200	139	0,04	2,500 % fällig am 14.01.2042	500	316	0,10				
5,600 % fällig am 15.07.2041	300	250	0,08	T-Mobile USA, Inc. 5,200 % fällig am 15.01.2033	\$ 400	331	0,10				
McDonald's Corp. 2,950 % fällig am 15.03.2034	£ 400	331	0,10	Time Warner Cable LLC 5,250 % fällig am 15.07.2042	£ 2.536	2.047	0,63				
3,750 % fällig am 31.05.2038	500	427	0,13	United Airlines Pass-Through Trust 5,875 % fällig am 15.04.2029	\$ 869	714	0,22				
5,875 % fällig am 23.04.2032	100	107	0,03	Verizon Communications, Inc. 1,875 % fällig am 03.11.2038	£ 2.700	1.716	0,53				
Merck & Co., Inc. 2,900 % fällig am 10.12.2061	\$ 600	320	0,10	3,125 % fällig am 02.11.2035	£ 600	£ 479	0,15				
Microsoft Corp. 2,525 % fällig am 01.06.2050	100	55	0,02								
2,675 % fällig am 01.06.2060	600	319	0,10								
MidAmerican Energy Co. 4,250 % fällig am 15.07.2049	64	45	0,01								

NON-AGENCY-MBS

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Deutsche ALT-A Securities, Inc. Mortgage Loan Trust 4,889 % fällig am 25.04.2035	\$ 151	117	0,04
GSR Mortgage Loan Trust 3,955 % fällig am 25.09.2035	1	1	0,00
Mellon Residential Funding Corp. Mortgage Pass-Through Trust 4,758 % fällig am 15.12.2030	3	3	0,00
Sequoia Mortgage Trust 3,051 % fällig am 20.07.2037 ^	8	5	0,00
Summe USA		45.000	13,85

KURZFRISTIGE INSTRUMENTE

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
UK TREASURY BILLS 3,511 % fällig am 08.05.2023 (b)(c)	£ 11.900	11.751	3,62
Summe kurzfristige Instrumente		11.751	3,62
Summe Übertragbare Wertpapiere	£	309.110	95,11

PENSIONS-GESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft ⁽¹⁾	% des Netto- vermögens
FICC	1,900 %	30.12.2022	03.01.2023	\$ 323	U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 29.06.2023	£ (274)	£ 269	£ 269	0,08
Summe Pensionsgeschäfte						£ (274)	£ 269	£ 269	0,08

⁽¹⁾ Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Euro-Bobl March Futures	Long	03.2023	9	£ (34)	(0,01)
Euro-Bund 10-Year Bond March Futures	Short	03.2023	72	521	0,16
Euro-Buxl 30-Year Bond March Futures	Short	03.2023	1	23	0,01
Japan Government 10-Year Bond March Futures	Short	03.2023	4	65	0,02
U.S. Treasury 2-Year Note March Futures	Short	03.2023	19	(4)	0,00
U.S. Treasury 10-Year Note March Futures	Short	03.2023	43	9	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond March Futures	Long	03.2023	11	7	0,00
United Kingdom Long Gilt March Futures	Long	03.2023	406	(2.342)	(0,72)
				£ (1.755)	(0,54)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				£ (1.755)	(0,54)

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Netto- vermögens
British Telecommunications PLC	1,000 %	20.06.2028	€ 300	£ (8)	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20.12.2028	600	(15)	(0,01)
Rolls-Royce PLC	1,000	20.12.2024	2.600	195	0,06
				£ 172	0,05

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.IG-38 5-Year Index	1,000 %	20.06.2027	\$ 1.750	£ 6	0,00
CDX.IG-39 5-Year Index	1,000	20.12.2027	20.800	119	0,04
iTraxx Europe Main 37 5-Year Index	1,000	20.06.2027	€ 4.150	34	0,01
iTraxx Europe Main 38 5-Year Index	1,000	20.12.2027	19.600	297	0,09
				£ 456	0,14

ZINSSWAPS

Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	0,500 %	21.09.2024	£ 2.100	£ 36	0,01
Zahlung ⁽³⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	2,000	15.03.2033	23.100	885	0,27
Zahlung ⁽³⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	2,000	15.03.2053	35.500	(660)	(0,20)
Erhalt ⁽³⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	2,250	15.03.2028	10.700	42	0,01
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,000	15.12.2026	\$ 2.300	(207)	(0,06)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2027	300	(6)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,000	16.12.2030	3.700	572	0,18
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,250	16.12.2050	100	31	0,01
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,500	18.12.2029	6.400	1.118	0,34
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,625	16.01.2050	100	36	0,01
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,750	21.06.2047	1.300	461	0,14
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,750	18.12.2049	400	147	0,05
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,000	12.02.2045	6.600	2.305	0,71
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,250	15.09.2036	€ 1.300	332	0,10
Erhalt ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	1,500	15.03.2025	4.300	82	0,02
Erhalt ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	1,500	15.03.2028	4.000	153	0,05
Erhalt ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	1,500	15.03.2053	1.900	31	0,01
Zahlung ⁽³⁾	6-Month EUR-EURIBOR	1,750	15.03.2033	3.500	(48)	(0,01)
					£ 5.310	1,64
					£ 5.938	1,83

Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate

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

⁽²⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definieren.

⁽³⁾ Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

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

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

VERKAUFSoPTIONEN

CREDIT DEFAULT SWAPTIONEN AUF KREDITINDIZES

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/-verkauf	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
GST	Put – OTC iTraxx Europe 37 5-Year Index	Verkauf	3,000 %	15.03.2023	1.300	£ (2)	£ 0	0,00

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
GLM	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,547 %	07.03.2023	1.400	£ (25)	£ (3)	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,547	07.03.2023	1.400	(25)	(73)	(0,02)
							£ (50)	£ (76)	(0,02)

⁽¹⁾ Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽²⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
JPM	Hochtief AG	5,000 %	20.12.2026	€ 500	£ 86	£ (38)	£ 48	0,01

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

Aufstellung der Wertpapieranlagen des UK Long Term Corporate Bond Fund (Forts.)

⁽²⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert.

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	02.2023	€ 150	£ 133	£ 0	£ (1)	£ (1)	0,00
	02.2023	\$ 24.011	20.349	409	0	409	0,12
BRC	02.2023	£ 174	€ 197	1	0	1	0,00
MBC	02.2023	€ 1.377	£ 1.205	0	(18)	(18)	(0,01)
	02.2023	£ 417	€ 472	3	0	3	0,00
	02.2023	960	\$ 1.144	1	(11)	(10)	0,00
	02.2023	¥ 10.400	£ 64	0	(2)	(2)	0,00
	02.2023	\$ 2.912	2.455	36	0	36	0,01
MYI	02.2023	£ 295	€ 341	8	0	8	0,00
	02.2023	413	\$ 502	4	0	4	0,00
	02.2023	\$ 621	£ 505	0	(10)	(10)	0,00
SCX	02.2023	436	358	0	(4)	(4)	0,00
SSB	02.2023	€ 21.531	18.897	0	(239)	(239)	(0,07)
UAG	02.2023	528	458	0	(12)	(12)	0,00
				£ 462	£ (297)	£ 165	0,05
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						£ 137	0,04
Summe Anlagen						£ 313.699	96,52
Sonstige Aktiva und Passiva						£ 11.321	3,48
Nettovermögen						£ 325.020	100,00

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

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

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Wertpapier mit Sachwertauschüttung.

(b) Nullkuponwertpapier.

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

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

(e) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(f) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2021: 0):

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeitsdatum	Kaufdatum	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
Oracle Corp.	6,900 %	09.11.2052	07.11.2022	£ 1.656	£ 1.699	0,52

Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von 0 GBP (31. Dezember 2021: 514 GBP) wurden gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen zum 31. Dezember 2022 als Sicherheiten verpfändet.

Barmittel in Höhe von 0 GBP (21. Dezember 2021: 58 GBP) wurden gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen zum 31. Dezember 2022 als Sicherheiten erhalten.

Barmittel in Höhe von 10.123 GBP (31. Dezember 2021: 12.076 GBP) wurden zum 31. Dezember 2022 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	£ 0	£ 309.110	£ 0	£ 309.110
Pensionsgeschäfte	0	269	0	269
Finanzderivate ⁽³⁾	(1.767)	6.087	0	4.320
Summen	£ (1.767)	£ 315.466	£ 0	£ 313.699

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

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	£ 0	£ 403.042	£ 0	£ 403.042
Pensionsgeschäfte	0	442	0	442
Finanzderivate ⁽³⁾	175	2.439	0	2.614
Summen	£ 175	£ 405.923	£ 0	£ 406.098

- (1) Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.
 (2) Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.
 (3) Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung des Marktwerts der außerbörslich gehandelten Finanzderivate und (erhaltenen)/verpfändeten Sicherheiten nach Kontrahenten zum 31. Dezember 2022 und 31. Dezember 2021:

Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Zum 31. Dez. 2022			Zum 31. Dez. 2021		
		Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾	
BOA	£ 408	£ (510)	£ (102)	£ (2)	£ 0	£ (2)	
BRC	1	0	1	(8)	0	(8)	
CBK	k. A.	k. A.	k. A.	257	0	257	
DUB	k. A.	k. A.	k. A.	(3)	0	(3)	
GLM	(76)	0	(76)	2	0	2	
HUS	k. A.	k. A.	k. A.	(7)	0	(7)	
JPM	48	0	48	80	(90)	(10)	
MBC	9	0	9	k. A.	k. A.	k. A.	
MYC	k. A.	k. A.	k. A.	(2)	0	(2)	
MYI	2	0	2	9	0	9	
RBC	k. A.	k. A.	k. A.	(14)	0	(14)	
SCX	(4)	0	(4)	(21)	0	(21)	
SSB	(239)	0	(239)	k. A.	k. A.	k. A.	
UAG	(12)	0	(12)	318	0	318	

(1) Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2022:

	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	93,60	91,80
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	1,51	2,87
Pensionsgeschäfte	0,08	0,10
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,54)	0,03
Zentral abgerechnete Finanzderivate	1,83	0,44
Freiverkehrfinanzderivate	0,04	0,14
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	k. A.	(0,12)

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2022 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
Australien	k. A.	0,28
Österreich	k. A.	0,02
Belgien	0,19	0,69
Bermuda	k. A.	0,21
Brasilien	k. A.	0,11
Karmaninseln	k. A.	0,47
Dänemark	1,23	0,08
Finnland	k. A.	0,14
Frankreich	5,11	5,34
Deutschland	2,80	2,11
Guernsey, Kanalinseln	k. A.	0,04
Hongkong	k. A.	0,03
Indien	0,05	0,04
Irland	2,32	1,70
Italien	0,78	1,61
Japan	0,09	0,03
Jersey, Kanalinseln	2,73	3,61
Luxemburg	1,21	1,80
Mauritius	k. A.	0,16
Mexiko	0,13	0,18
Niederlande	5,45	6,16
Norwegen	0,27	0,10
Singapur	0,33	0,45
Spanien	0,22	0,54
Supranational	1,18	1,04
Schweden	0,16	0,14
Schweiz	1,21	1,23
Großbritannien	52,18	52,21
USA	13,85	14,15
Kurzfristige Instrumente	3,62	k. A.
Pensionsgeschäfte	0,08	0,10
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,54)	0,03
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf	0,05	0,05

Aufstellung der Wertpapieranlagen des UK Long Term Corporate Bond Fund (Forts.) 31. Dezember 2022

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,14	0,00
Zinsswaps	1,64	0,39
Freiverkehrsfinanzderivate		
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaptions auf Kreditindizes	0,00	0,00
Zinsswapoptionen	(0,02)	k. A.
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf	0,01	0,02
Devisenterminkontrakte	0,05	0,12
Sonstige Aktiva und Passiva	3,48	4,62
Nettovermögen	100,00	100,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des US High Yield Bond Fund

31. Dezember 2022

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE				KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETTUNGEN				INDUSTRIEWERTE			
Heartland Dental LLC 8,134 % fällig am 30.04.2025	\$ 6.351	\$ 5.885	0,30	3,875 % fällig am 01.03.2031	\$ 2.000	\$ 1.531	0,08	Athenahealth Group, Inc. 6,500 % fällig am 15.02.2030	\$ 10.000	\$ 7.388	0,37
Intelsat Jackson Holdings S.A. 7,445 % fällig am 01.02.2029	2.927	2.832	0,14	4,000 % fällig am 15.10.2033	2.000	1.497	0,08	Atlantia SpA 1,875 % fällig am 12.02.2028	€ 8.750	7.786	0,39
Serta Simmons Bedding LLC 7,743 % - 7,827 % fällig am 08.11.2023	3.110	221	0,01	SBA Communications Corp. 3,125 % fällig am 01.02.2029	10.000	8.333	0,42	Avantor Funding, Inc. 4,625 % fällig am 15.07.2028	\$ 6.000	5.464	0,28
Team Health Holdings, Inc. 7,134 % fällig am 06.02.2024	5.811	4.997	0,25	Voyager Aviation Holdings LLC 8,500 % fällig am 09.05.2026	1.805	1.433	0,07	Axalta Coating Systems LLC 3,375 % fällig am 15.02.2029	5.000	4.132	0,21
		13.935	0,70			131.996	6,65	B.C. Ltd. 9,000 % fällig am 30.01.2028	2.150	2.104	0,11
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSELBANKEN UND FINANZEN				INDUSTRIEWERTE				INDUSTRIEWERTE			
Alliant Holdings Intermediate LLC 4,250 % fällig am 15.10.2027	5.000	4.486	0,23	24 Hour Fitness Worldwide, Inc. 8,000 % fällig am 01.06.2022 ^	9.500	25	0,00	B.C. Unlimited Liability Co. 3,500 % fällig am 15.02.2029	2.250	1.933	0,10
Allied Universal Holdco LLC 4,625 % fällig am 01.06.2028	3.000	2.483	0,13	Academy Ltd. 6,000 % fällig am 15.11.2027	4.000	3.835	0,19	3,875 % fällig am 15.01.2028	2.000	1.794	0,09
Armor Holdco, Inc. 8,500 % fällig am 15.11.2029	7.500	5.643	0,28	AdaptHealth LLC 6,125 % fällig am 01.08.2028	3.000	2.762	0,14	4,000 % fällig am 15.10.2030	4.000	3.248	0,16
Curo Group Holdings Corp. 7,500 % fällig am 01.08.2028	4.000	1.871	0,09	Adient Global Holdings Ltd. 4,875 % fällig am 15.08.2026	3.000	2.797	0,14	4,375 % fällig am 15.01.2028	2.000	1.794	0,09
Ford Motor Credit Co. LLC 2,900 % fällig am 16.02.2028	5.000	4.136	0,21	ADT Security Corp. 4,875 % fällig am 15.07.2032	4.000	3.406	0,17	Ball Corp. 2,875 % fällig am 15.08.2030	5.000	4.001	0,20
3,375 % fällig am 13.11.2025	5.000	4.529	0,23	Advantage Sales & Marketing, Inc. 6,500 % fällig am 15.11.2028	5.000	3.820	0,19	Bath & Body Works, Inc. 6,625 % fällig am 01.10.2030	2.000	1.880	0,09
3,664 % fällig am 08.09.2024	3.000	2.863	0,14	Ahead DB Holdings LLC 6,625 % fällig am 01.05.2028	10.000	8.050	0,41	6,875 % fällig am 01.11.2035	3.000	2.672	0,13
4,000 % fällig am 13.11.2030	7.500	6.171	0,31	Ahlstrom-Munksjo Holding Oy 4,875 % fällig am 04.02.2028	4.000	3.256	0,16	9,375 % fällig am 01.07.2025	1.438	1.538	0,08
4,125 % fällig am 17.08.2027	5.000	4.487	0,23	Air Canada 3,875 % fällig am 15.08.2026	2.500	2.219	0,11	Bausch Health Cos., Inc. 4,875 % fällig am 01.06.2028	2.000	1.276	0,06
4,134 % fällig am 04.08.2025	5.000	4.691	0,24	4,625 % fällig am 15.08.2029	CAD 2.750	1.779	0,09	5,500 % fällig am 01.11.2025	3.500	2.981	0,15
4,542 % fällig am 01.08.2026	2.000	1.846	0,09	Albertsons Cos., Inc. 3,500 % fällig am 15.03.2029	\$ 2.000	1.682	0,08	5,750 % fällig am 15.08.2027	1.000	682	0,03
5,113 % fällig am 03.05.2029	3.000	2.723	0,14	4,625 % fällig am 15.01.2027	1.500	1.397	0,07	11,000 % fällig am 30.09.2028	2.750	2.158	0,11
5,125 % fällig am 16.06.2025	2.500	2.409	0,12	5,875 % fällig am 15.02.2028	1.500	1.429	0,07	14,000 % fällig am 15.10.2030	760	455	0,02
Fortress Transportation & Infrastructure Investors LLC 5,500 % fällig am 01.05.2028	2.000	1.709	0,09	Albion Financing SARL 6,125 % fällig am 15.10.2026	4.250	3.796	0,19	BCPE Empire Holdings, Inc. 7,625 % fällig am 01.05.2027	14.000	12.572	0,63
6,500 % fällig am 01.10.2025	5.353	5.042	0,25	Allison Transmission, Inc. 3,750 % fällig am 30.01.2031	5.000	4.119	0,21	BCPE Ulysses Intermediate, Inc. (7,750 % bar oder 8,500 % PIK) 7,750 % fällig am 01.04.2027 (a)	5.000	3.096	0,16
Getty Images, Inc. 9,750 % fällig am 01.03.2027	8.250	8.156	0,41	Altice Financing S.A. 5,000 % fällig am 15.01.2028	4.000	3.229	0,16	Bellis Acquisition Co. PLC 3,250 % fällig am 16.02.2026	€ 3.000	2.950	0,15
Greystar Real Estate Partners LLC 5,750 % fällig am 01.12.2025	2.000	1.958	0,10	Altice France Holding S.A. 6,000 % fällig am 15.02.2028	5.000	2.962	0,15	Bellis Finco PLC 4,000 % fällig am 16.02.2027	1.400	1.246	0,06
HAT Holdings LLC 3,750 % fällig am 15.09.2030	2.000	1.473	0,07	10,500 % fällig am 15.05.2027	3.000	2.294	0,12	Black Knight InfoServ LLC 3,625 % fällig am 15.09.2028	\$ 3.000	2.610	0,13
Howard Hughes Corp. 4,125 % fällig am 01.02.2029	1.000	839	0,04	Altice France S.A. 5,125 % fällig am 15.07.2029	4.000	3.006	0,15	Block, Inc. 3,500 % fällig am 01.06.2031	5.000	3.996	0,20
4,375 % fällig am 01.02.2031	2.750	2.229	0,11	5,500 % fällig am 15.01.2028	3.750	2.945	0,15	Bombardier, Inc. 6,000 % fällig am 15.02.2028	3.000	2.778	0,14
5,375 % fällig am 01.08.2028	2.500	2.256	0,11	5,500 % fällig am 15.10.2029	2.000	1.529	0,08	7,125 % fällig am 15.06.2026	5.000	4.860	0,24
Intesa Sanpaolo SpA 5,710 % fällig am 15.01.2026	1.000	962	0,05	AMC Networks, Inc. 4,250 % fällig am 15.02.2029	5.000	3.123	0,16	7,500 % fällig am 15.03.2025	1.977	1.962	0,10
7,700 % fällig am 17.09.2025 (e)(g)	4.000	3.639	0,18	American Airlines Pass-Through Trust 3,150 % fällig am 15.08.2033	1.725	1.432	0,07	7,875 % fällig am 15.04.2027	6.000	5.832	0,29
Midcap Financial Issuer Trust 5,625 % fällig am 15.01.2030	2.000	1.622	0,08	3,375 % fällig am 01.11.2028	2.190	1.831	0,09	Boxer Parent Co., Inc. 6,500 % fällig am 02.10.2025	€ 2.000	2.041	0,10
6,500 % fällig am 01.05.2028	2.000	1.723	0,09	3,650 % fällig am 15.08.2030	734	655	0,03	Boyne USA, Inc. 4,750 % fällig am 15.05.2029	\$ 2.500	2.216	0,11
MPT Operating Partnership LP 3,500 % fällig am 15.03.2031	2.000	1.375	0,07	American Airlines, Inc. 5,500 % fällig am 20.04.2026	5.000	4.817	0,24	Buckeye Partners LP 4,125 % fällig am 01.03.2025	2.000	1.908	0,10
Nationstar Mortgage Holdings, Inc. 5,125 % fällig am 15.12.2030	5.000	3.869	0,20	5,750 % fällig am 20.04.2029	9.250	8.471	0,43	4,500 % fällig am 01.03.2028	2.000	1.761	0,09
NCL Finance Ltd. 6,125 % fällig am 15.03.2028	2.000	1.479	0,07	Antero Resources Corp. 5,375 % fällig am 01.03.2030	1.500	1.393	0,07	Builders FirstSource, Inc. 5,000 % fällig am 01.03.2030	5.000	4.439	0,22
OneMain Finance Corp. 3,500 % fällig am 15.01.2027	4.000	3.317	0,17	Apache Corp. 4,875 % fällig am 15.11.2027	4.000	3.651	0,18	CAB SELAS 3,375 % fällig am 01.02.2028	€ 5.000	4.305	0,22
4,000 % fällig am 15.09.2030	3.000	2.242	0,11	API Group DE, Inc. 4,750 % fällig am 15.10.2029	4.000	3.488	0,18	Cablevision Lightpath LLC 5,625 % fällig am 15.09.2028	\$ 4.000	2.979	0,15
5,375 % fällig am 15.11.2029	3.000	2.459	0,12	Arches Buyer, Inc. 4,250 % fällig am 01.06.2028	3.500	2.742	0,14	Caesars Entertainment, Inc. 4,625 % fällig am 15.10.2029	9.000	7.340	0,37
6,625 % fällig am 15.01.2028	1.500	1.384	0,07	6,125 % fällig am 01.12.2028	4.000	3.215	0,16	8,125 % fällig am 01.07.2027	2.000	1.969	0,10
6,875 % fällig am 15.03.2025	1.000	963	0,05	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC 3,250 % fällig am 01.09.2028	2.000	1.701	0,09	Callon Petroleum Co. 7,500 % fällig am 15.06.2030	2.500	2.291	0,12
7,125 % fällig am 15.03.2026	3.000	2.859	0,14	4,000 % fällig am 01.09.2029	2.000	1.589	0,08	Cargo Aircraft Management, Inc. 4,750 % fällig am 01.02.2028	1.000	909	0,05
Park Intermediate Holdings LLC 4,875 % fällig am 15.05.2029	1.000	848	0,04	Ascend Resources Utica Holdings LLC 5,875 % fällig am 30.06.2029	2.000	1.786	0,09	Carnival Corp. 4,000 % fällig am 01.08.2028	5.000	4.087	0,21
5,875 % fällig am 01.10.2028	1.500	1.362	0,07	8,250 % fällig am 31.12.2028	1.000	982	0,05	5,750 % fällig am 01.03.2027	4.000	2.863	0,14
PennyMac Financial Services, Inc. 5,375 % fällig am 15.10.2025	1.000	903	0,05	ASP Unifrax Holdings, Inc. 5,250 % fällig am 30.09.2028	2.000	1.612	0,08	6,000 % fällig am 01.05.2029	2.500	1.671	0,08
5,750 % fällig am 15.09.2031	2.000	1.589	0,08	7,500 % fällig am 30.09.2029	2.000	1.272	0,06	7,625 % fällig am 01.03.2026	4.000	3.177	0,16
Rocket Mortgage LLC 3,625 % fällig am 01.03.2029	1.000	794	0,04	At Home Group, Inc. 4,875 % fällig am 15.07.2028	1.500	1.059	0,05	Carnival PLC 1,000 % fällig am 28.10.2029	€ 7.500	3.342	0,17
				7,125 % fällig am 15.07.2029	1.750	1.017	0,05	Carvana Co. 4,875 % fällig am 01.09.2029	\$ 2.000	773	0,04
								5,500 % fällig am 15.04.2027	2.000	795	0,04
								Catalent Pharma Solutions, Inc. 2,375 % fällig am 01.03.2028	€ 2.000	1.749	0,09

BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖ- GENS
Voyager Aviation Holdings LLC (b)	833	\$ 0	0,00	KURZFRISTIGE INSTRUMENTE			
		3.650	0,18	U.S. TREASURY BILLS			
		4.228	0,21	4,444 % fällig am 21.03.2023 (c)(d)	\$ 65.000	64.413	3,25
				Summe kurzfristige Instrumente		64.413	3,25
BEZUGSRECHTE				Summe Übertragbare Wertpapiere	\$ 1.895.465	95,50	
Intelsat Jackson Holdings S.A. – Exp. 05.12.2025	31.850	227	0,01	AKTIEN			
OPTIONSSCHEINE				INVESTMENTFONDS			
DB Investors, Inc. - Exp. 28.06.2069 (h)	113	0	0,00	ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN			
VORZUGSWERTPAPIERE				PIMCO Funds: Global Investors Series plc – PIMCO Asia High Yield Bond Fund (f)	661.211	6.037	0,30
Voyager Aviation Holdings LLC 9,500 %	5.000	1.342	0,07	PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (f)	3.327.832	33.125	1,67
				Summe Investmentfonds	\$ 39.162	1,97	

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit- zins	Abrechnungs- datum	Fälligkeits- datum	Kapital- betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions- geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions- geschäft ⁽¹⁾	% des Netto- vermögens
FICC	1,900 %	30.12.2022	03.01.2023	\$ 9.269	U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 29.06.2023	\$ (9.454)	\$ 9.269	\$ 9.270	0,47
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (9.454)	\$ 9.269	\$ 9.270	0,47

⁽¹⁾ Umfasst aufgelaufene Zinsen.

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits- datum	Nenn- betrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Netto- vermögens
CDX.HY-38 5-Year Index	5,000 %	20.06.2027	\$ 64.350	\$ 2.014	0,10
CDX.HY-39 5-Year Index	5,000	20.12.2027	50.000	1.208	0,06
				\$ 3.222	0,16
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate				\$ 3.222	0,16

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

⁽²⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definieren.

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

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2023	\$ 1.004	£ 817	\$ 0	\$ (21)	\$ (21)	0,00
BRC	01.2023	10.956	€ 10.263	2	0	2	0,00
JPM	01.2023	£ 6.600	\$ 7.969	29	0	29	0,00
MBC	01.2023	€ 54.835	£ 57.471	0	(1.077)	(1.077)	(0,05)
	01.2023	\$ 1.012	£ 827	0	(17)	(17)	0,00
	02.2023	CAD 2.315	\$ 1.747	38	0	38	0,00
MYI	01.2023	€ 10	£ 10	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 22	€ 21	0	0	0	0,00
	01.2023	20	£ 16	0	0	0	0,00
				\$ 69	\$ (1.115)	\$ (1.046)	(0,05)

Aufstellung der Wertpapieranlagen des US High Yield Bond Fund (Forts.)

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilsklasse Institutional CHF (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2023	\$ 468	CHF 442	\$ 11	\$ 0	\$ 11	0,00
CBK	01.2023	793	749	17	0	17	0,00
MYI	01.2023	CHF 426	\$ 457	0	(4)	(4)	0,00
RBC	01.2023	498	538	0	(1)	(1)	0,00
SCX	01.2023	267	289	0	0	0	0,00
				\$ 28	\$ (5)	\$ 23	0,00

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Investor EUR (Hedged) thesaurierend und E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2023	\$ 379	€ 359	\$ 5	\$ 0	\$ 5	0,00
BPS	01.2023	€ 78	\$ 83	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 40	€ 38	0	0	0	0,00
CBK	01.2023	€ 13.638	\$ 14.509	0	(53)	(53)	0,00
	01.2023	\$ 121.526	€ 117.217	3.628	0	3.628	0,18
JPM	01.2023	€ 8.100	\$ 8.423	0	(225)	(225)	(0,01)
MBC	01.2023	3.365	3.556	0	(36)	(36)	0,00
	01.2023	\$ 129.870	€ 123.916	2.436	0	2.436	0,12
SCX	01.2023	123.535	118.686	3.187	0	3.187	0,16
				\$ 9.256	\$ (314)	\$ 8.942	0,45

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend und Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2023	£ 651	\$ 800	\$ 17	\$ 0	\$ 17	0,00
	01.2023	\$ 237	£ 193	0	(5)	(5)	0,00
BRC	01.2023	£ 16	\$ 20	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 20	£ 17	0	0	0	0,00
JPM	01.2023	16.960	14.045	0	(62)	(62)	0,00
MBC	01.2023	£ 2	\$ 2	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 16.828	£ 14.034	70	(13)	57	0,00
MYI	01.2023	20	16	0	0	0	0,00
TOR	01.2023	16.842	14.008	11	0	11	0,00
UAG	01.2023	£ 152	\$ 189	5	0	5	0,00
	01.2023	\$ 24	£ 20	0	(1)	(1)	0,00
				\$ 103	\$ (81)	\$ 22	0,00

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilsklasse Institutional SGD (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2023	\$ 80	SGD 110	\$ 2	\$ 0	\$ 2	0,00
BRC	01.2023	SGD 34	\$ 25	0	(1)	(1)	0,00
	01.2023	\$ 3	SGD 4	0	0	0	0,00
GLM	01.2023	SGD 6	\$ 5	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 86	SGD 117	2	0	2	0,00
MBC	01.2023	SGD 308	\$ 229	0	(1)	(1)	0,00
	01.2023	\$ 86	SGD 117	2	0	2	0,00
				\$ 6	\$ (2)	\$ 4	0,00

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ 7.945 0,40

Summe Anlagen

\$ 1.955.063 98,50

Sonstige Aktiva und Passiva

\$ 29.859 1,50

Nettovermögen

\$ 1.984.922 100,00

ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend*):

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.

(b) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.

(c) Nullkuponwertpapier.

- (d) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.
- (e) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.
- (f) Mit dem Fonds verbunden.
- (g) Bedingt wandelbares Wertpapier.
- (h) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2021: 0,84 %):

Emittentenbeschreibung	Kaufdatum	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens	
DB Investors, Inc.	18.02.2015	\$ 0	\$ 0	0,00	
DB Investors, Inc. - Exp. 28.06.2069	18.02.2015	0	0	0,00	
Diamond Foreign Asset Co, (9,000 % Cash or 9,000 % PIK) 9,000 % fällig am 22.04.2027	12.05.2021	115	109	0,01	
Intelsat Emergence S.A.	11.02.2014	-02.03.2022	15.552	3.650	0,18
Occidental Petroleum Corp, 5,500 % fällig am 01.12.2025	08.12.2020	4.000	3.992	0,20	
		\$ 19.667	\$ 7.751	0,39	

Barmittel in Höhe von 10.449 USD (31. Dezember 2021: 12.192 USD) wurden zum 31. Dezember 2022 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 413	\$ 1.889.527	\$ 5.525	\$ 1.895.465
Investmentfonds	39.162	0	0	39.162
Pensionsgeschäfte	0	9.269	0	9.269
Finanzderivate ⁽³⁾	0	11.167	0	11.167
Summen	\$ 39.575	\$ 1.909.963	\$ 5.525	\$ 1.955.063

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2021 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 13.770	\$ 3.560.207	\$ 33.943	\$ 3.607.920
Investmentfonds	255.818	0	0	255.818
Pensionsgeschäfte	0	1.473	0	1.473
Finanzderivate ⁽³⁾	0	8.133	0	8.133
Summen	\$ 269.588	\$ 3.569.813	\$ 33.943	\$ 3.873.344

⁽¹⁾ Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

⁽²⁾ Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

⁽³⁾ Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung des Marktwerts der außerbörslich gehandelten Finanzderivate und (erhaltenen)/verpfändeten Sicherheiten nach Kontrahenten zum 31. Dezember 2022 und 31. Dezember 2021:

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2022			Zum 31. Dez. 2021		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾
BOA	\$ 9	\$ 0	\$ 9	\$ 51	\$ 0	\$ 51
BPS	k. A.	k. A.	k. A.	363	(300)	63
BRC	1	0	1	898	(970)	(72)
CBK	3.592	(3.540)	52	(24)	0	(24)
GLM	2	0	2	9	(20)	(11)
HUS	k. A.	k. A.	k. A.	(14)	0	(14)
JPM	(258)	0	(258)	17	0	17
MBC	1.402	(1.320)	82	k. A.	k. A.	k. A.
MYI	(4)	0	(4)	6	(10)	(4)
RBC	(1)	0	(1)	2.151	(1.720)	431
SCX	3.187	(3.050)	137	1.979	(1.310)	669
TOR	11	(20)	(9)	2.370	(1.490)	880
UAG	4	0	4	315	0	315

⁽¹⁾ Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2022:

	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	39,23	33,54
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	56,03	57,25
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,24	1,15
Investmentfonds	1,97	6,52
Pensionsgeschäfte	0,47	0,04
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,16	0,00
Freiverkehrsfinanzderivate	0,40	0,21

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2022 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
Kreditbeteiligungen und -abtretungen	0,70	1,19
Unternehmensanleihen und Wechsel	79,60	88,62
US-Schatzobligationen	11,62	k. A.
Non-Agency-MBS	0,04	0,03
Forderungsbesicherte Wertpapiere	0,00	0,00
Stammaktien	0,21	0,80
Bezugsrechte	0,01	k. A.
Optionsscheine	0,00	0,00
Vorzugswertpapiere	0,07	0,16
Kurzfristige Instrumente	3,25	1,14
Investmentfonds	1,97	6,52
Pensionsgeschäfte	0,47	0,04
Zentral abgerechnetes Finanzderivat		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,16	0,00
Freiverkehrsfinanzderivate		
Total Return Swaps auf Indizes	k. A.	0,03
Devisenterminkontrakte	(0,05)	(0,03)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,45	0,21
Sonstige Aktiva und Passiva	1,50	1,29
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE											
KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNGEN											
Charter Communications Operating LLC 6,140 % fällig am 01.02.2027	\$ 89	\$ 87	0,02	BGC Partners, Inc. 4,375 % fällig am 15.12.2025	\$ 1.100	\$ 1.032	0,27	Goldman Sachs Group, Inc. 2,383 % fällig am 21.07.2032	1.500	1.167	0,30
CommScope, Inc. 7,634 % fällig am 06.04.2026	387	366	0,09	Block Financial LLC 3,875 % fällig am 15.08.2030	1.500	1.316	0,34	2,615 % fällig am 22.04.2032	\$ 1.000	800	0,21
Elanco Animal Health, Inc. 5,870 % fällig am 01.08.2027	1.543	1.485	0,38	BNP Paribas S.A. 7,750 % fällig am 16.08.2029 (d)(f)	700	693	0,18	3,691 % fällig am 05.06.2028	655	610	0,16
Level 3 Financing, Inc. 6,134 % fällig am 01.03.2027	33	31	0,01	Brookfield Finance, Inc. 3,500 % fällig am 30.03.2051	400	255	0,07	Goodman U.S. Finance Three LLC 3,700 % fällig am 15.03.2028	1.100	994	0,26
MH Sub LLC 8,134 % fällig am 13.09.2024	190	184	0,05	3,900 % fällig am 25.01.2028	1.400	1.286	0,33	Great-West Lifeco Finance LP 4,581 % fällig am 17.05.2048	300	248	0,06
Qatar National Bank QPSC 5,557 % fällig am 06.11.2023	400	399	0,10	Carlyle Finance Subsidiary LLC 3,500 % fällig am 19.09.2029	1.900	1.611	0,41	Hanover Insurance Group, Inc. 4,500 % fällig am 15.04.2026	800	784	0,20
RegionalCare Hospital Partners Holdings, Inc. 8,165 % fällig am 16.11.2025	2.006	1.896	0,49	Citigroup, Inc. 2,976 % fällig am 05.11.2030	1.600	1.349	0,35	Highwoods Realty LP 4,125 % fällig am 15.03.2028	500	453	0,12
Tibco Software, Inc. 9,180 % fällig am 30.03.2029	300	269	0,07	3,785 % fällig am 17.03.2033 (g)	200	172	0,04	4,200 % fällig am 15.04.2029	200	175	0,05
USI, Inc. 7,980 % fällig am 02.12.2026	194	193	0,05	4,075 % fällig am 23.04.2029	400	369	0,09	Host Hotels & Resorts LP 3,500 % fällig am 15.09.2030	1.300	1.076	0,28
		4.910	1,26	6,270 % fällig am 17.11.2033 (g)	2.000	2.070	0,53	4,000 % fällig am 15.06.2025	1.233	1.186	0,31
				Citizens Bank N.A. 4,575 % fällig am 09.08.2028	1.000	967	0,25	HSBC Capital Funding Dollar LP 10,176 % fällig am 30.06.2030 (d)	400	481	0,12
				Commonwealth Bank of Australia 3,784 % fällig am 14.03.2032 (f)	400	331	0,09	HSBC Holdings PLC 2,099 % fällig am 04.06.2026	900	820	0,21
				Cooperative Rabobank UA 4,655 % fällig am 15.04.2028	400	385	0,10	2,357 % fällig am 18.08.2031	1.600	1.226	0,32
				Corebridge Financial, Inc. 3,850 % fällig am 05.04.2029	900	822	0,21	4,292 % fällig am 12.09.2026	1.000	958	0,25
				Corporate Office Properties LP 2,250 % fällig am 15.03.2026	300	263	0,07	4,583 % fällig am 19.06.2029	400	369	0,09
				2,750 % fällig am 15.04.2031	1.400	1.051	0,27	5,402 % fällig am 11.08.2033	900	836	0,22
				Credit Suisse Group AG 2,593 % fällig am 11.09.2025	400	354	0,09	6,500 % fällig am 15.09.2037	100	97	0,02
				4,282 % fällig am 09.01.2028	1.250	1.038	0,27	6,800 % fällig am 01.06.2038	220	219	0,06
				6,537 % fällig am 12.08.2033	2.750	2.420	0,62	Hudson Pacific Properties LP 4,650 % fällig am 01.04.2029	100	86	0,02
				Crown Castle, Inc. 2,100 % fällig am 01.04.2031	500	395	0,10	Invitation Homes Operating Partnership LP 2,300 % fällig am 15.11.2028	1.300	1.077	0,28
				3,100 % fällig am 15.11.2029	900	786	0,20	JAB Holdings BV 2,200 % fällig am 23.11.2030	1.600	1.203	0,31
				4,300 % fällig am 15.02.2029	600	568	0,15	JPMorgan Chase & Co. 2,182 % fällig am 01.06.2028	700	613	0,16
				CubeSmart LP 3,125 % fällig am 01.09.2026	600	552	0,14	2,545 % fällig am 08.11.2032	900	714	0,18
				Deutsche Bank AG 2,222 % fällig am 18.09.2024	1.000	966	0,25	2,580 % fällig am 22.04.2032	5.100	4.099	1,04
				3,035 % fällig am 28.05.2032 (g)	400	304	0,08	3,509 % fällig am 23.01.2029	1.105	1.005	0,26
				3,950 % fällig am 27.02.2023	1.600	1.595	0,41	3,782 % fällig am 01.02.2028	40	37	0,01
				5,966 % fällig am 27.02.2023	600	600	0,15	4,000 % fällig am 01.04.2025 (d)	2.900	2.482	0,64
				Doric Nimrod Air Alpha Pass-Through Trust 5,250 % fällig am 30.05.2025	114	113	0,03	4,851 % fällig am 25.07.2028	1.000	976	0,25
				EPR Properties 4,500 % fällig am 01.06.2027	450	394	0,10	Kilroy Realty LP 3,050 % fällig am 15.02.2030	1.800	1.444	0,37
				4,750 % fällig am 15.12.2026	100	90	0,02	KKR Group Finance Co. LLC 3,625 % fällig am 25.02.2050	1.100	759	0,20
				4,950 % fällig am 15.04.2028	400	342	0,09	Lazard Group LLC 3,625 % fällig am 01.03.2027	100	92	0,02
				ERP Operating LP 3,250 % fällig am 01.08.2027	100	92	0,02	4,500 % fällig am 19.09.2028	200	186	0,05
				Extra Space Storage LP 2,350 % fällig am 15.03.2032	400	304	0,08	Legg Mason, Inc. 5,625 % fällig am 15.01.2044	200	196	0,05
				Fairfax Financial Holdings Ltd. 2,750 % fällig am 29.03.2028	€ 200	187	0,05	Life Storage LP 3,875 % fällig am 15.12.2027	800	742	0,19
				4,625 % fällig am 29.04.2030	\$ 1.400	1.273	0,33	Lloyds Bank PLC 0,000 % fällig am 02.04.2032	200	122	0,03
				4,850 % fällig am 17.04.2028	300	284	0,07	Lloyds Banking Group PLC 4,375 % fällig am 22.03.2028	800	761	0,20
				Federal Realty Investment Trust 3,500 % fällig am 01.06.2030	400	343	0,09	4,716 % fällig am 11.08.2026	900	881	0,23
				Fifth Third Bancorp 4,772 % fällig am 28.07.2030	800	765	0,20	4,976 % fällig am 11.08.2033	900	829	0,21
				First American Financial Corp. 4,300 % fällig am 01.02.2023	200	200	0,05	Mid-America Apartments LP 1,100 % fällig am 15.09.2026	1.200	1.039	0,27
				Fortress Transportation & Infrastructure Investors LLC 6,500 % fällig am 01.10.2025	259	244	0,06	4,200 % fällig am 15.06.2028	400	380	0,10
				Freedom Mortgage Corp. 8,125 % fällig am 15.11.2024	900	829	0,21	Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc. 2,309 % fällig am 20.07.2032	2.000	1.544	0,40
				GAIF Bond Issuer Pty. Ltd. 3,400 % fällig am 30.09.2026	500	460	0,12	5,133 % fällig am 20.07.2033	900	862	0,22
				Global Atlantic Fin Co. 3,125 % fällig am 15.06.2031	200	147	0,04	Mizuho Financial Group, Inc. 3,153 % fällig am 16.07.2030	1.873	1.607	0,41
				4,400 % fällig am 15.10.2029	800	671	0,17	5,345 % fällig am 08.09.2024	1.600	1.590	0,41
				GLP Capital LP 3,350 % fällig am 01.09.2024	700	672	0,17	Morgan Stanley 4,889 % fällig am 20.07.2033	1.400	1.319	0,34
				4,000 % fällig am 15.01.2031	300	258	0,07	Morgan Stanley Domestic Holdings, Inc. 4,500 % fällig am 20.06.2028	200	195	0,05
				5,750 % fällig am 01.06.2028	700	689	0,18	MPT Operating Partnership LP 4,625 % fällig am 01.08.2029	500	382	0,10
								Muthoot Finance Ltd. 4,400 % fällig am 02.09.2023	1.400	1.379	0,35
								Nationstar Mortgage Holdings, Inc. 5,500 % fällig am 15.08.2028	1.188	971	0,25
								Nationwide Building Society 4,000 % fällig am 14.09.2026	300	273	0,07

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Marriott International, Inc. 3,500 % fällig am 15.10.2032	\$ 200	\$ 167	0,04	Transurban Finance Co. Pty. Ltd. 2,450 % fällig am 16.03.2031	150	118	0,03	India Green Energy Holdings 5,375 % fällig am 29.04.2024	250	241	0,06
Marvell Technology, Inc. 4,200 % fällig am 22.06.2023	390	388	0,10	Trimble, Inc. 4,150 % fällig am 15.06.2023	\$ 100	\$ 99	0,03	Interstate Power & Light Co. 3,600 % fällig am 01.04.2029	\$ 1.400	\$ 1.283	0,33
Melco Resorts Finance Ltd. 4,875 % fällig am 06.06.2025	1.300	1.196	0,31	U.S. Airways Pass-Through Trust 5,900 % fällig am 01.04.2026	214	207	0,05	Ipalco Enterprises, Inc. 3,700 % fällig am 01.09.2024	1.500	1.454	0,37
5,250 % fällig am 26.04.2026	600	529	0,14	United Airlines Pass-Through Trust 2,700 % fällig am 01.11.2033	354	287	0,07	Jersey Central Power & Light Co. 4,300 % fällig am 15.01.2026	1.100	1.064	0,27
MGM China Holdings Ltd. 5,250 % fällig am 18.06.2025	900	847	0,22	2,875 % fällig am 07.04.2030	396	337	0,09	Mississippi Power Co. 3,950 % fällig am 30.03.2028	500	470	0,12
5,375 % fällig am 15.05.2024	200	193	0,05	3,100 % fällig am 07.04.2030	221	179	0,05	NiSource, Inc. 3,600 % fällig am 01.05.2030	300	268	0,07
Micron Technology, Inc. 4,663 % fällig am 15.02.2030	950	864	0,22	3,700 % fällig am 01.09.2031	485	406	0,10	ONEOK, Inc. 4,350 % fällig am 15.03.2029	200	185	0,05
Mitchells & Butlers Finance PLC 6,013 % fällig am 15.12.2030	£ 432	486	0,12	4,000 % fällig am 11.10.2027	608	560	0,14	4,550 % fällig am 15.07.2028	200	189	0,05
Moody's Corp. 3,250 % fällig am 20.05.2050	\$ 900	626	0,16	4,150 % fällig am 25.02.2033	77	65	0,02	6,100 % fällig am 15.11.2032	500	502	0,13
Motorola Solutions, Inc. 2,300 % fällig am 15.11.2030	300	235	0,06	Verisk Analytics, Inc. 4,125 % fällig am 15.03.2029	200	188	0,05	Pacific Gas & Electric Co. 2,100 % fällig am 01.08.2027	2.300	1.968	0,51
Netflix, Inc. 4,875 % fällig am 15.06.2030	400	374	0,10	VMware, Inc. 4,650 % fällig am 15.05.2027	350	339	0,09	3,000 % fällig am 15.06.2028	900	780	0,20
Newcrest Finance Pty. Ltd. 5,750 % fällig am 15.11.2041	200	183	0,05	4,700 % fällig am 15.05.2030	900	839	0,22	3,150 % fällig am 01.01.2026	100	93	0,02
Norfolk Southern Corp. 4,100 % fällig am 15.05.2049	45	37	0,01	Warnermedia Holdings, Inc. 4,279 % fällig am 15.03.2032	800	661	0,17	3,750 % fällig am 01.07.2028	300	267	0,07
NVR, Inc. 3,000 % fällig am 15.05.2030	300	253	0,06	5,050 % fällig am 15.03.2042	1.500	1.153	0,30	4,250 % fällig am 15.03.2046 ^	1.100	769	0,20
NXP BV 4,875 % fällig am 01.03.2024	1.100	1.092	0,28	Waste Connections, Inc. 4,200 % fällig am 15.01.2033	900	839	0,22	4,300 % fällig am 15.03.2045 ^	100	71	0,02
ONEOK Partners LP 5,000 % fällig am 15.09.2023	200	200	0,05	Weibo Corp. 3,375 % fällig am 08.07.2030	700	545	0,14	PECO Energy Co. 3,000 % fällig am 15.09.2049	100	69	0,02
Oracle Corp. 4,000 % fällig am 15.07.2046	600	440	0,11	Weir Group PLC 2,200 % fällig am 13.05.2026	1.300	1.154	0,30	Progress Energy, Inc. 7,750 % fällig am 01.03.2031	204	232	0,06
4,000 % fällig am 15.11.2047	600	441	0,11	Woodside Finance Ltd. 3,650 % fällig am 05.03.2025	1.100	1.057	0,27	Rio Oil Finance Trust 8,200 % fällig am 06.04.2028	213	216	0,06
6,250 % fällig am 09.11.2032 (g)	1.000	1.050	0,27	Xiaomi Best Time International Ltd. 2,875 % fällig am 14.07.2031	400	290	0,07	Southern California Edison Co. 2,850 % fällig am 01.08.2029	800	697	0,18
Pacific National Finance Pty. Ltd. 4,750 % fällig am 22.03.2028	1.700	1.510	0,39	Zimmer Biomet Holdings, Inc. 4,250 % fällig am 15.08.2035	228	190	0,05	3,900 % fällig am 01.12.2041	108	82	0,02
Penske Truck Leasing Co. LP 4,450 % fällig am 29.01.2026	100	96	0,02			92.868	23,90	4,200 % fällig am 01.03.2029	200	191	0,05
Petroleos Mexicanos 7,690 % fällig am 23.01.2050	100	69	0,02	VERSORGUNGSUNTERNEHMEN				6,650 % fällig am 01.04.2029	2.035	2.104	0,54
Philip Morris International, Inc. 5,750 % fällig am 17.11.2032	200	205	0,05	AEP Texas, Inc. 6,650 % fällig am 15.02.2033	300	312	0,08	Southern Co. Gas Capital Corp. 3,250 % fällig am 15.06.2026	2.700	2.517	0,65
Phosagro OAO Via Phosagro Bond Funding DAC 3,050 % fällig am 23.01.2025 ^	400	268	0,07	Ameren Illinois Co. 3,250 % fällig am 15.03.2050	400	288	0,07	Southwest Gas Corp. 5,800 % fällig am 01.12.2027	1.000	1.014	0,26
Sabine Pass Liquefaction LLC 5,000 % fällig am 15.03.2027	300	295	0,08	Appalachian Power Co. 7,000 % fällig am 01.04.2038	900	1.008	0,26	Sprint LLC 7,875 % fällig am 15.09.2023	400	406	0,10
Sands China Ltd. 2,800 % fällig am 08.03.2027	300	257	0,07	CenterPoint Energy, Inc. 4,250 % fällig am 01.11.2028	90	85	0,02	Systems Energy Resources, Inc. 2,140 % fällig am 09.12.2025	800	732	0,19
3,350 % fällig am 08.03.2029	1.000	818	0,21	Clearway Energy Operating LLC 3,750 % fällig am 15.02.2031	200	166	0,04	Targa Resources Partners LP 5,500 % fällig am 01.03.2030	300	283	0,07
3,750 % fällig am 08.08.2031	400	315	0,08	Cleveland Electric Illuminating Co. 3,500 % fällig am 01.04.2028	1.561	1.425	0,37	Transcanada Trust 5,300 % fällig am 15.03.2077	50	42	0,01
Santos Finance Ltd. 5,250 % fällig am 13.03.2029	1.600	1.470	0,38	Consolidated Edison Co. of New York, Inc. 5,300 % fällig am 01.03.2035	900	887	0,23			27.173	6,99
Spirit AeroSystems, Inc. 9,375 % fällig am 30.11.2029	200	211	0,05	Dominion Energy, Inc. 5,375 % fällig am 15.11.2032	100	99	0,03	Summe Unternehmensanleihen und Wechsel		262.879	67,65
Spirit Airlines Pass-Through Trust 3,650 % fällig am 15.08.2031	452	367	0,09	DTE Energy Co. 2,950 % fällig am 01.03.2030	600	511	0,13	US-REGIERUNGSBEHÖRDEN			
4,100 % fällig am 01.10.2029	122	109	0,03	Duke Energy Carolinas LLC 6,000 % fällig am 15.01.2038	50	53	0,01	Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,000 % fällig am 01.02.2053	3.300	2.899	0,75
Syngenta Finance NV 4,441 % fällig am 24.04.2023	1.650	1.643	0,42	Edison International 6,950 % fällig am 15.11.2029	100	105	0,03	3,500 % fällig am 01.02.2053	4.640	4.219	1,09
T-Mobile USA, Inc. 2,550 % fällig am 15.02.2031	4.300	3.523	0,91	EDP Finance BV 6,300 % fällig am 11.10.2027	900	927	0,24	4,000 % fällig am 01.02.2053	13.400	12.572	3,23
2,875 % fällig am 15.02.2031	365	302	0,08	Enel Finance America LLC 7,100 % fällig am 14.10.2027	600	621	0,16	5,000 % fällig am 01.02.2053	100	99	0,02
Targa Resources Corp. 5,200 % fällig am 01.07.2027	700	687	0,18	Entergy Corp. 1,900 % fällig am 15.06.2028	200	169	0,04			19.789	5,09
TD SYNEX Corp. 1,750 % fällig am 09.08.2026	2.300	1.958	0,50	Entergy Mississippi LLC 2,850 % fällig am 01.06.2028	700	623	0,16	US-SCHATZOBBLIGATIONEN			
Tencent Music Entertainment Group 2,000 % fällig am 03.09.2030	400	303	0,08	Exelon Corp. 4,050 % fällig am 15.04.2030	800	745	0,19	U.S. Treasury Bonds 2,500 % fällig am 15.02.2045	7.300	5.503	1,42
Tennessee Gas Pipeline Co. LLC 7,000 % fällig am 15.10.2028	900	963	0,25	FirstEnergy Transmission LLC 4,350 % fällig am 15.01.2025	500	488	0,13	2,875 % fällig am 15.05.2052	2.600	2.084	0,54
Time Warner Cable LLC 5,875 % fällig am 15.11.2040	1.400	1.225	0,32	Greenko Solar Mauritius Ltd. 5,550 % fällig am 29.01.2025	500	472	0,12	3,250 % fällig am 15.05.2042	2.764	2.425	0,62
Transcontinental Gas Pipe Line Co. LLC 4,000 % fällig am 15.03.2028	900	846	0,22					3,375 % fällig am 15.08.2042	2.800	2.503	0,65
								4,000 % fällig am 15.11.2042 (h)	13.700	13.417	3,45
								U.S. Treasury Notes 2,750 % fällig am 15.08.2032	1.900	1.730	0,45
								2,875 % fällig am 15.05.2032	6.301	5.809	1,49
										33.471	8,62
								NON-AGENCY-MBS			
								Barclays Commercial Mortgage Securities Trust 5,318 % fällig am 15.10.2037	835	803	0,21
								Countrywide Alternative Loan Trust 3,398 % fällig am 25.08.2035 ^	36	30	0,01
								Countrywide Home Loan Reperforming REMIC Trust 4,540 % fällig am 25.11.2034	173	164	0,04
										997	0,26

Aufstellung der Wertpapieranlagen des US Investment Grade Corporate Bond Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
FÖRDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				STAMMAKTIE				National Grid Holdings Ltd.			
ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust 5,319 % fällig am 25.02.2036 ^	\$ 210	\$ 198	0,05	FINANZWERTE				4,810 % fällig am 24.01.2023	\$ 900	\$ 897	0,23
Citigroup Mortgage Loan Trust 4,589 % fällig am 25.01.2037	1.133	533	0,14	Stearns Holdings LLC 'B' (a)	14.062	\$ 0	0,00	Quanta Services, Inc. 5,100 % fällig am 13.01.2023	500	499	0,13
Ellington Loan Acquisition Trust 5,489 % fällig am 25.05.2037	209	201	0,05	OPTIONSSCHEINE				VW Credit, Inc. 4,750 % fällig am 24.01.2023	500	499	0,13
Long Beach Mortgage Loan Trust 5,364 % fällig am 25.07.2034	961	945	0,24	Guaranteed Rate, Inc. – Exp. 31.12.2060	68	0	0,00	Walgreens Boots Alliance, Inc. 4,900 % fällig am 11.01.2023	1.300	1.298	0,34
New Century Home Equity Loan Trust 5,094 % fällig am 25.02.2036	182	151	0,04	VORZUGSWERTPAPIERE						12.420	3,20
		2.028	0,52	Wells Fargo & Co. 4,250 % fällig am 15.09.2026 (d)	40.800	672	0,17	HUNGARY TREASURY BILLS			
STAATSEMISSIONEN				KURZFRISTIGE INSTRUMENTE				18,250 % fällig am 03.01.2023 (b)(c) HUF 381.000 1.015 0,26			
Emirate of Abu Dhabi Government International Bond 3,125 % fällig am 16.04.2030	600	558	0,14	COMMERCIAL PAPER				Summe kurzfristige Instrumente		13.435	3,46
Export-Import Bank of India 3,250 % fällig am 15.01.2030	400	348	0,09	Constellation Brands, Inc. 5,000 % fällig am 11.01.2023	\$ 750	749	0,19	Summe Übertragbare Wertpapiere	\$ 346.399	89,15	
Italy Government International Bond 6,875 % fällig am 27.09.2023	600	604	0,16	Duke Energy Corp. 4,620 % fällig am 17.01.2023	2.000	1.996	0,51	AKTIEN			
Peru Government International Bond 8,200 % fällig am 12.08.2026 PEN	7.800	2.142	0,55	Electricite de France S.A. 5,000 % fällig am 20.01.2023	1.000	997	0,26	INVESTMENTFONDS			
Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia 2,800 % fällig am 23.06.2030	\$ 300	263	0,07	Entergy Corp. 4,700 % fällig am 12.01.2023	3.400	3.394	0,87	ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN			
Romania Government International Bond 3,750 % fällig am 07.02.2034	€ 400	320	0,08	Fiserv, Inc. 4,820 % fällig am 01.02.2023	1.600	1.593	0,41	PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (e)	3.883.596	38.657	9,95
South Africa Government International Bond 10,500 % fällig am 21.12.2026 ZAR	62.900	3.908	1,01	McCormick & Co., Inc. 4,750 % fällig am 27.01.2023	500	498	0,13	Summe Investmentfonds	\$ 38.657	9,95	
Ukraine Government International Bond 7,750 % fällig am 01.09.2024 ^	\$ 300	75	0,02								
		8.218	2,12								

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft ⁽¹⁾	% des Netto- vermögens
BOS	4,190 %	30.12.2022	03.01.2023	\$ 12.800	U.S. Treasury Bonds 2,875 % fällig am 15.05.2049	\$ (13.133)	\$ 12.800	\$ 12.806	3,30
FICC	1,900	30.12.2022	03.01.2023	2.583	U.S. Treasury Notes 0,125 % fällig am 15.05.2023	(2.635)	2.583	2.583	0,66
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (15.768)	\$ 15.383	\$ 15.389	3,96

⁽¹⁾ Umfasst aufgelaufene Zinsen.

AN EINEM GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*, außer Anzahl der Kontrakte)

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Netto- vermögens
3-Month SOFR December Futures	Long	03.2024	27	\$ 13	0,00
3-Month SOFR March Futures	Long	06.2023	35	0	0,00
Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 146,000 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond February 2023 Futures ⁽¹⁾	Short	01.2023	5	4	0,00
Euro-Bobl March Futures	Long	03.2023	27	(124)	(0,03)
Euro-Bund 10-Year Bond March Futures	Short	03.2023	80	731	0,19
Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 138,500 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond February 2023 Futures ⁽¹⁾	Short	01.2023	5	(25)	(0,01)
U.S. Treasury 30-Year Bond March Futures	Long	03.2023	383	29	0,01
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond March Futures	Long	03.2023	79	62	0,02
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ 690	0,18

⁽¹⁾ Future-Style-Option.

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Airbus Finance BV	1,000 %	20.12.2025	€ 200	\$ (2)	0,00
American International Group, Inc.	1,000	20.12.2026	\$ 500	(7)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2023	2.200	1	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.12.2023	1.400	(15)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2024	1.100	2	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.12.2026	900	(14)	0,00
Barclays Bank PLC	1,000	20.12.2023	€ 1.500	3	0,00
Boeing Co.	1,000	20.06.2023	\$ 500	(1)	0,00
Boeing Co.	1,000	20.12.2025	200	2	0,00
Boeing Co.	1,000	20.12.2026	500	(2)	0,00
Boeing Co.	1,000	20.06.2027	2.900	120	0,03
BP Capital Markets PLC	1,000	20.12.2025	€ 700	(7)	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20.12.2024	400	(4)	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20.12.2025	200	(2)	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20.12.2027	300	(4)	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20.06.2028	1.100	(31)	(0,01)
Devon Energy Corp.	1,000	20.12.2026	\$ 800	4	0,00
DISH DBS Corp.	5,000	20.06.2023	200	(14)	0,00
Enbridge, Inc.	1,000	20.12.2026	900	(4)	0,00
Exelon Generation Co. LLC	1,000	20.12.2024	1.600	3	0,00
Expedia Group, Inc.	1,000	20.12.2026	300	(5)	0,00
Ford Motor Co.	5,000	20.12.2024	1.300	(92)	(0,02)
General Electric Co.	1,000	20.12.2023	500	8	0,00
General Electric Co.	1,000	20.06.2024	300	7	0,00
General Electric Co.	1,000	20.06.2026	1.200	(4)	0,00
General Electric Co.	1,000	20.12.2026	200	(1)	0,00
General Motors Co.	5,000	20.12.2026	1.900	(172)	(0,05)
Hess Corp.	1,000	20.12.2026	1.200	2	0,00
MetLife, Inc.	1,000	20.12.2023	200	(3)	0,00
MetLife, Inc.	1,000	20.12.2024	1.400	(18)	(0,01)
National Rural Utilities Cooperative Finance Corp.	1,000	20.12.2026	200	0	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20.12.2024	€ 2.300	273	0,06
Southwest Airlines Co.	1,000	20.12.2026	\$ 550	3	0,00
Telefonica Emisiones S.A.	1,000	20.06.2028	€ 800	(15)	0,00
Tesco PLC	1,000	20.12.2024	1.000	(17)	(0,01)
Tesco PLC	1,000	20.12.2027	2.400	(42)	(0,01)
Tesco PLC	1,000	20.06.2028	500	(13)	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.06.2026	\$ 1.200	(26)	(0,01)
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.12.2026	1.800	(42)	(0,01)
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.12.2027	1.400	13	0,00
Vodafone Group PLC	1,000	20.06.2023	€ 100	(2)	0,00
Vodafone Group PLC	1,000	20.06.2024	200	(4)	0,00
Volkswagen International Finance NV	1,000	20.06.2028	1.600	(54)	(0,01)
				\$ (176)	(0,05)

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.IG-39 5-Year Index	1,000 %	20.12.2027	\$ 48.800	\$ (117)	(0,03)

ZINSSWAPS

Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	1,101 %	21.02.2052	€ 200	\$ (101)	(0,03)
Zahlung	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	1,175	28.02.2052	500	(243)	(0,06)
Erhalt ⁽³⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	2,000	15.03.2033	3.200	(76)	(0,02)
Erhalt ⁽³⁾	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	2,250	15.03.2028	700	25	0,01
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,300	20.03.2028	¥ 231.200	81	0,02
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,000	15.06.2027	\$ 24.500	722	0,19
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,665	04.01.2027	BRL 16.400	(81)	(0,02)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,980	04.01.2027	19.200	40	0,01
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,270	04.11.2023	\$ 25.600	(472)	(0,12)
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	7,195	25.04.2027	ZAR 22.300	41	0,01
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	7,300	28.04.2027	3.900	6	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,550	10.08.2024	€ 1.600	(69)	(0,02)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,000	13.05.2027	3.300	(292)	(0,08)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,000	18.05.2027	1.500	(132)	(0,03)
Zahlung	6-Month HUF-BBR	1,000	19.09.2023	HUF 115.000	(41)	(0,01)
Zahlung	6-Month HUF-BBR	1,250	19.09.2023	352.100	(133)	(0,03)
Zahlung	28-Day MXN-TIE	6,015	03.06.2026	MXN 93.700	(431)	(0,11)
					\$ (1.156)	(0,29)
					\$ (1.449)	(0,37)

Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate

Aufstellung der Wertpapieranlagen des US Investment Grade Corporate Bond Fund (Forts.)

- (1) Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definieren, dann zahlt der Teilfonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.
- (2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definieren.
- (3) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft. Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 2, Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge, in den Erläuterungen zum Abschluss.

DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend*, außer Anzahl der Kontrakte)

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

OPTIONSKAUF

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
BPS	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,000 %	15.03.2023	2.310	\$ 263	\$ 1.252	0,32
JPM	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,000	15.03.2023	1.540	170	834	0,22
							\$ 433	\$ 2.086	0,54

VERKAUFSoPTIONEN

CREDIT DEFAULT SWAPPTIONS AUF KREDITINDIZES

Kontrahent	Beschreibung	Schutzkauf/-verkauf	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
GST	Put – OTC iTraxx Europe 37 5-Year Index	Verkauf	3,000 %	15.03.2023	700	\$ (2)	\$ 0	0,00

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Call – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,870 %	23.01.2023	200	\$ (1)	\$ (1)	0,00
	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,320	23.01.2023	200	(1)	(3)	0,00
BPS	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,900	17.01.2023	400	(2)	0	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,400	17.01.2023	400	(2)	(7)	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,175	15.03.2023	6.930	(257)	(2.130)	(0,56)
	Call – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,610	17.01.2023	200	(2)	0	0,00
	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,110	17.01.2023	200	(2)	(6)	0,00
GLM	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,000	12.01.2023	500	(3)	0	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,550	12.01.2023	500	(3)	(4)	0,00
	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,547	07.03.2023	900	(20)	(2)	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	2,547	07.03.2023	900	(20)	(57)	(0,02)
	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	2,067	09.06.2023	1.200	(14)	(3)	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	3,140	09.06.2023	1.200	(16)	(39)	(0,01)
	Call – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,740	19.01.2023	200	(2)	0	0,00
	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,180	19.01.2023	200	(2)	(4)	0,00
JPM	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,175	15.03.2023	4.620	(167)	(1.420)	(0,37)
MYC	Call – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,070	23.01.2023	400	(2)	0	0,00
	Put – OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,520	23.01.2023	400	(2)	(5)	0,00
	Call – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,600	17.01.2023	200	(1)	0	0,00
	Put – OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,050	17.01.2023	200	(1)	(7)	0,00
							\$ (520)	\$ (3.688)	(0,96)

OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag ⁽¹⁾	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.01.2053	\$ 101,891	05.01.2023	300	\$ (1)	\$ 0	0,00
JPM	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.03.2053	97,156	06.03.2023	900	(8)	(14)	(0,01)
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fällig am 01.03.2053	98,766	06.03.2023	200	(2)	(3)	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fällig am 01.03.2053	100,766	06.03.2023	200	(1)	(1)	0,00
SAL	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.01.2053	101,859	05.01.2023	400	(1)	0	0,00
	Put – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.02.2053	99,750	06.02.2023	400	(3)	(2)	0,00
	Call – OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.02.2053	101,750	06.02.2023	400	(2)	(1)	0,00
					\$ (18)	\$ (21)	(0,01)

(1) Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Kontrahent	Referenzinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag ⁽²⁾	Gezahlte/erhaltene Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Brazil Government International Bond	1,000 %	20.06.2026	\$ 100	\$ (4)	\$ 1	\$ (3)	0,00
BRC	Alibaba Group Holding Ltd.	1,000	20.12.2024	400	5	(3)	2	0,00
	Italy Government International Bond	1,000	20.06.2025	2.100	(51)	61	10	0,01
	NextEra Energy Capital Holdings, Inc.	1,000	20.12.2025	500	11	(4)	7	0,00

Kontrahent	Referenzinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽²⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
DUB	Pertamina Persero PT	1,000 %	20.12.2024	\$ 400	\$ (2)	\$ 6	\$ 4	0,00
FBF	Saudi Arabia Government International Bond	1,000	20.06.2025	300	0	4	4	0,00
GLM	Italy Government International Bond	1,000	20.06.2025	700	(11)	19	8	0,00
GST	Italy Government International Bond	1,000	20.06.2025	2.300	(26)	63	37	0,01
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2024	200	(2)	3	1	0,00
	Saudi Arabia Government International Bond	1,000	20.06.2025	300	0	4	4	0,00
JPM	Saudi Arabia Government International Bond	1,000	20.06.2025	400	0	6	6	0,00
MYC	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2027	1.000	(62)	11	(51)	(0,01)
	Brookfield Asset Management, Inc.	1,000	20.06.2025	300	0	(4)	(4)	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2024	100	(1)	2	1	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2026	200	1	(1)	0	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2027	400	(14)	9	(5)	0,00
					\$ (156)	\$ 177	\$ 21	0,01

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF⁽¹⁾

Kontrahent	Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽²⁾	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BPS	CDX.HY-31 5-Year Index 25-35 %	5,000 %	20.12.2023	\$ 100	\$ 12	\$ (8)	\$ 4	0,00
CBK	CDX.HY-31 5-Year Index 25-35 %	5,000	20.12.2023	100	10	(6)	4	0,00
GST	CDX.HY-31 5-Year Index 25-35 %	5,000	20.12.2023	400	48	(30)	18	0,01
JPM	CDX.HY-31 5-Year Index 25-35 %	5,000	20.12.2023	300	33	(20)	13	0,00
					\$ 103	\$ (64)	\$ 39	0,01

⁽¹⁾ Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definieren, dann zahlt der Teilfonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

⁽²⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definieren.

DEVISENTERMIKONTRÄKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte Wertabnahme	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens	
BOA	01.2023	AUD	115	\$ 78	\$ 0	\$ 0	0,00	
	01.2023	DKK	8.400	1.175	0	(32)	(0,01)	
	01.2023	£	977	1.191	15	0	0,00	
	01.2023	\$	212	€ 200	1	0	0,00	
	01.2023	ZAR	18.945	\$ 1.067	0	(45)	(0,01)	
	02.2023	\$	185	IDR 2.912.102	3	0	3	0,00
	02.2023	ZAR	337	NOK 3.340	3	0	3	0,00
	02.2023	ZAR	2.423	\$ 135	0	(7)	(7)	0,00
	03.2023	\$	132	IDR 2.071.812	2	0	2	0,00
	03.2023	ZAR	10.172	\$ 576	0	(18)	(18)	(0,01)
BPS	01.2023	HUF	85.162	222	0	(5)	(5)	0,00
	01.2023	\$	206	€ 193	1	0	1	0,00
	01.2023	ZAR	190	ZAR 3.304	4	0	4	0,00
	01.2023	ZAR	9.717	\$ 555	0	(15)	(15)	0,00
	02.2023	\$	70	IDR 1.093.522	1	0	1	0,00
	03.2023		69	INR 5.696	0	0	0	0,00
	03.2023		2.311	MXN 46.575	46	0	46	0,01
	01.2023		212	€ 201	2	0	2	0,00
	02.2023		510	NOK 5.094	8	0	8	0,00
	01.2023		579	BRL 3.040	0	(3)	(3)	0,00
CBK	01.2023		951	PEN 3.819	48	0	48	0,01
	02.2023	PEN	6.834	\$ 1.714	0	(73)	(73)	(0,02)
	03.2023	MXN	2.380	121	1	0	1	0,00
	03.2023	PEN	8.086	2.093	0	(14)	(14)	0,00
	04.2023		16.317	4.079	0	(164)	(164)	(0,03)
	05.2023	MXN	14.695	727	0	(10)	(10)	0,00
	09.2023	ZAR	10.952	620	0	(11)	(11)	0,00
	01.2023	HUF	296.031	752	0	(36)	(36)	(0,01)
	01.2023		11.316	25	0	(5)	(5)	0,00
	01.2023	BRL	3.040	570	0	(5)	(5)	0,00
GLM	01.2023	COP	4.152.103	856	1	0	1	0,00
	01.2023	ZAR	2.476	138	0	(7)	(7)	0,00
	03.2023	\$	1.430	CLP 1.302.772	85	0	85	0,02
	03.2023		845	COP 4.152.103	0	0	0	0,00
	03.2023		2	MXN 34	0	0	0	0,00
	04.2023		560	BRL 3.040	5	0	5	0,00
	05.2023		4.022	PEN 16.005	131	0	131	0,03
	05.2023	ZAR	202	\$ 12	0	0	0	0,00
	02.2023	MXN	36.253	1.768	0	(76)	(76)	(0,02)
	02.2023	\$	120	IDR 1.888.776	2	0	2	0,00
JPM	02.2023	ZAR	5.444	\$ 303	0	(16)	(16)	0,00
	03.2023	\$	147	MXN 2.925	1	0	1	0,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des US Investment Grade Corporate Bond Fund (Forts.)

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
MYI	01.2023	€ 1.351	\$ 1.441	\$ 0	\$ (1)	\$ (1)	0,00
	01.2023	£ 123	148	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 863	AUD 1.285	9	0	9	0,00
	01.2023	156	£ 129	0	0	0	0,00
	01.2023	ZAR 5.436	\$ 303	0	(16)	(16)	0,00
SCX	03.2023	\$ 185	IDR 2.906.138	3	0	3	0,00
	01.2023	€ 4.370	\$ 4.548	0	(117)	(117)	(0,03)
	01.2023	\$ 95	AUD 141	1	0	1	0,00
SSB	01.2023	740	PEN 2.858	9	0	9	0,00
	02.2023	126	IDR 1.987.412	2	0	2	0,00
	01.2023	PEN 2.858	\$ 741	0	(9)	(9)	0,00
SSB	01.2023	\$ 810	COP 4.152.103	45	0	45	0,01
	01.2023	740	PEN 2.858	9	0	9	0,00
				\$ 438	\$ (685)	\$ (247)	(0,06)

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilsklasse Institutional EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2023	€ 1.361	\$ 1.431	\$ 0	\$ (22)	\$ (22)	(0,01)
	01.2023	\$ 1.744	€ 1.650	18	0	18	0,00
BPS	01.2023	10	9	0	0	0	0,00
BRC	01.2023	€ 3.527	\$ 3.760	0	(6)	(6)	0,00
	01.2023	\$ 41	€ 39	0	0	0	0,00
CBK	01.2023	€ 14	\$ 15	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 40.912	€ 39.451	1.210	0	1.210	0,31
JPM	01.2023	34.896	33.558	935	0	935	0,24
MYI	01.2023	15	14	0	0	0	0,00
RYL	01.2023	14.955	14.282	294	0	294	0,08
SCX	01.2023	42.056	40.370	1.048	0	1.048	0,27
				\$ 3.505	\$ (28)	\$ 3.477	0,89

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilsklasse Institutional GBP (Hedged) ausschüttend II die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs- monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2023	£ 447	\$ 543	\$ 6	\$ 0	\$ 6	0,01
	01.2023	\$ 6.248	£ 5.173	0	(25)	(25)	(0,01)
BPS	01.2023	325	269	0	(1)	(1)	0,00
BRC	01.2023	£ 23	\$ 29	1	0	1	0,00
	01.2023	\$ 874	£ 715	0	(14)	(14)	0,00
GLM	01.2023	£ 7	\$ 8	0	0	0	0,00
JPM	01.2023	\$ 5.331	£ 4.414	0	(21)	(21)	(0,01)
MYI	01.2023	£ 24	\$ 29	0	0	0	0,00
SCX	01.2023	\$ 4.388	£ 3.677	36	0	36	0,01
				\$ 43	\$ (61)	\$ (18)	0,00

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ 1.649 0,42

LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT- WERT (000S)	% DES NETTO- VERMÖGENS
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN			
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.01.2053	\$ 2.500	\$ (2.035)	(0,52)
Summe Leerverkaufte Wertpapiere		\$ (2.035)	(0,52)
Summe Anlagen		\$ 399.294	102,77
Sonstige Aktiva und Passiva		\$ (10.772)	(2,77)
Nettovermögen		\$ 388.522	100,00

ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend*):

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.

(b) Nullkuponwertpapier.

- (c) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.
 (d) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.
 (e) Mit dem Fonds verbunden.
 (f) Bedingt wandelbares Wertpapier.
 (g) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2021: 0,72 %):

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeitsdatum	Kaufdatum	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
Citigroup, Inc.	3,785 %	17.03.2033	10.03.2022	\$ 200	\$ 172	0,04
Citigroup, Inc.	6,270	17.11.2033	09.11.2022	2.000	2.070	0,53
Deutsche Bank AG	3,035	28.05.2032	21.06.2021	405	304	0,08
Oracle Corp.	6,250	09.11.2032	07.11.2022	998	1.050	0,27
				\$ 3.603	\$ 3.596	0,92

- (h) Wertpapier mit einem Gesamtmarktwert von 12.732 USD (31. Dezember 2021: 26.228 USD) wurde gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte zum 31. Dezember 2022 als Sicherheit für verzögert gelieferte Wertpapiere oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte verpfändet oder geliefert.

Barmittel in Höhe von 11.785 USD (31. Dezember 2021: 15.901 USD) wurden zum 31. Dezember 2022 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 830 USD (31. Dezember 2021: 830 USD) wurden gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. zum 31. Dezember 2022 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 672	\$ 345.328	\$ 399	\$ 346.399
Investmentfonds	38.657	0	0	38.657
Pensionsgeschäfte	0	15.383	0	15.383
Finanzderivate ⁽³⁾	587	303	0	890
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(2.035)	0	(2.035)
Summen	\$ 39.916	\$ 358.979	\$ 399	\$ 399.294

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2021 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 1.017	\$ 880.499	\$ 10	\$ 881.526
Investmentfonds	6.571	0	0	6.571
Pensionsgeschäfte	0	686	0	686
Finanzderivate ⁽³⁾	258	7.482	0	7.740
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(3.780)	0	(3.780)
Summen	\$ 7.846	\$ 884.887	\$ 10	\$ 892.743

⁽¹⁾ Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

⁽²⁾ Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

⁽³⁾ Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Ausstehende Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zum 31. Dezember 2022:

Kontrahent	Kreditzins	Abrechnungsdatum	Fälligkeitsdatum	Kreditbetrag	Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte ⁽¹⁾	% des Nettovermögens
BPG	(1,500) %	30.12.2022	03.01.2023	\$ (12.886)	\$ (12.884)	(3,32)
	(1,350)	29.12.2022	30.12.2022	(12.824)	(12.823)	(3,30)
	(1,000)	28.12.2022	29.12.2022	(12.948)	(12.948)	(3,33)
Summe Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte					\$ (38.655)	(9,95)

⁽¹⁾ In dem für Rückkaufgeschäfte zahlbaren Betrag ist 1 USD für einen aufgeschobenen Kursrückgang enthalten.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung des Marktwerts der außerbörslich gehandelten Finanzderivate und (erhaltenen)/verpfändeten Sicherheiten nach Kontrahenten zum 31. Dezember 2022 und 31. Dezember 2021:

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2022			Zum 31. Dez. 2021		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Nettoengagement ⁽¹⁾	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Nettoengagement ⁽¹⁾
BOA	\$ (108)	\$ 0	\$ (108)	\$ (75)	\$ 140	\$ 65
BPS	(856)	740	(116)	3.392	(2.720)	672

Aufstellung der Wertpapieranlagen des US Investment Grade Corporate Bond Fund (Forts.) 31. Dezember 2022

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2022			Zum 31. Dez. 2021		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement ⁽¹⁾	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement ⁽¹⁾
BRC	\$ 14	\$ 0	\$ 14	\$ 800	\$ (610)	\$ 190
CBK	988	(750)	238	134	0	134
CLY	(36)	0	(36)	k. A.	k. A.	k. A.
DUB	(1)	0	(1)	39	0	39
FBF	8	0	8	12	0	12
GLM	138	0	138	(743)	600	(143)
GST	23	0	23	91	0	91
JPM	240	(170)	70	1.961	(1.390)	571
MYC	(71)	90	19	(10)	90	80
MYI	(5)	(10)	(15)	25	0	25
RYL	294	0	294	1	0	1
SAL	(3)	0	(3)	(13)	0	(13)
SCX	979	(930)	49	3.500	(2.840)	660
SSB	45	0	45	40	0	40

⁽¹⁾ Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Nettobeträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2022:

	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	59,33	71,45
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	29,34	27,82
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,48	1,12
Investmentfonds	9,95	0,75
Pensionsgeschäfte	3,96	0,08
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,18	0,03
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,37)	(0,19)
Freiverkehrsfinaanzderivate	0,42	1,04
Leerverkaufte Wertpapiere	(0,52)	(0,43)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	(9,95)	(3,02)

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2022 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
Kreditbeteiligungen und -abtretungen	1,26	1,85
Unternehmensanleihen und Wechsel	67,65	85,36
US-Regierungsbehörden	5,09	1,41
US-Schatzobligationen	8,62	9,92
Non-Agency-MBS	0,26	0,03
Forderungsbesicherte Wertpapiere	0,52	0,27
Staatsemissionen	2,12	1,37
Stammaktien	0,00	0,00
Optionsscheine	0,00	0,00
Vorzugswertpapiere	0,17	0,12
Kurzfristige Instrumente	3,46	0,06
Investmentfonds	9,95	0,75
Pensionsgeschäfte	3,96	0,08
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,18	0,03
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf	(0,05)	0,07
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	(0,03)	0,03
Zinsswaps	(0,29)	(0,29)
Freiverkehrsfinaanzderivate		
Optionskauf		
Zinsswapoptionen	0,54	0,09
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaptions auf Kreditindizes	0,00	0,00
Zinsswapoptionen	(0,96)	(0,17)
Optionen auf Wertpapiere	(0,01)	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf	0,01	0,01
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,01	0,01
Devisenterminkontrakte	(0,06)	(0,07)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,89	1,17
Leerverkaufte Wertpapiere	(0,52)	(0,43)
Sonstige Aktiva und Passiva	(2,77)	(1,67)
Nettovermögen	100,00	100,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des US Short-Term Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNGEN			
Delos Finance SARL 6,480 % fällig am 06.10.2023	\$ 210	\$ 210	0,01
Summe Luxemburg		2.197	0,10
NIEDERLANDE			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
CNH Industrial NV 4,500 % fällig am 15.08.2023	4.612	4.584	0,20
Enel Finance International NV 2,650 % fällig am 10.09.2024	3.890	3.724	0,16
4,250 % fällig am 15.06.2025	4.310	4.177	0,18
6,800 % fällig am 14.10.2025	3.600	3.700	0,16
Iberdrola International BV 5,810 % fällig am 15.03.2025	1.100	1.116	0,05
ING Groep NV 4,100 % fällig am 02.10.2023	2.700	2.679	0,12
5,334 % fällig am 01.04.2027	5.000	4.828	0,21
5,963 % fällig am 28.03.2026	13.100	13.047	0,56
JDE Peet's NV 0,800 % fällig am 24.09.2024	9.955	9.099	0,39
LeasePlan Corp. NV 2,875 % fällig am 24.10.2024	3.100	2.911	0,13
Stellantis NV 5,250 % fällig am 15.04.2023	18.537	18.554	0,80
Vonovia Finance BV 5,000 % fällig am 02.10.2023	1.596	1.575	0,07
Summe Niederlande		69.994	3,03
NORWEGEN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
DNB Bank ASA 2,968 % fällig am 28.03.2025	1.000	965	0,04
SAUDI-ARABIEN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Saudi Arabian Oil Co. 1,250 % fällig am 24.11.2023	600	578	0,02
1,625 % fällig am 24.11.2025	2.200	2.010	0,09
Summe Saudi-Arabien		2.588	0,11
SINGAPUR			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
BOC Aviation Ltd. 5,849 % fällig am 26.09.2023	1.700	1.698	0,07
SÜDKOREA			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Korea Southern Power Co. Ltd. 4,056 % fällig am 30.10.2024	AUD 5.300	3.586	0,16
SK Broadband Co. Ltd. 3,875 % fällig am 13.08.2023	\$ 1.500	1.488	0,06
SK Hynix, Inc. 1,000 % fällig am 19.01.2024	8.704	8.272	0,36
SK Telecom Co. Ltd. 3,750 % fällig am 16.04.2023	3.305	3.292	0,14
Woori Bank 5,310 % fällig am 01.02.2023	1.200	1.200	0,05
		17.838	0,77
STAATSEMISSIONEN			
Export-Import Bank of Korea 5,558 % fällig am 27.04.2023	1.029	1.032	0,05
Korea Development Bank 0,500 % fällig am 27.10.2023	500	483	0,02
		1.515	0,07
Summe Südkorea		19.353	0,84
SPANIEN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. 0,875 % fällig am 18.09.2023	6.800	6.587	0,28
Banco Santander S.A. 3,848 % fällig am 12.04.2023	\$ 2.400	2.387	0,10
4,612 % fällig am 19.01.2023	AUD 1.200	814	0,04
Summe Spanien		9.788	0,42

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
SUPRANATIONAL			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Internationale Bank für Wiederaufbau und Entwicklung 0,650 % fällig am 10.02.2026	\$ 10.000	8.950	0,39
0,850 % fällig am 10.02.2027	18.800	16.382	0,71
Summe Supranational		25.332	1,10
SCHWEIZ			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Credit Suisse AG 4,260 % fällig am 26.05.2023	AUD 3.900	2.626	0,11
4,441 % fällig am 02.02.2024	\$ 2.000	1.914	0,08
Credit Suisse Group AG 2,193 % fällig am 05.06.2026	2.500	2.137	0,09
3,800 % fällig am 09.06.2023	4.100	3.993	0,17
4,207 % fällig am 12.06.2024	600	585	0,03
4,372 % fällig am 08.03.2024	AUD 1.000	668	0,03
5,975 % fällig am 12.06.2024	\$ 1.000	947	0,04
UBS AG 3,956 % fällig am 30.07.2025	AUD 7.225	4.891	0,21
UBS Group AG 5,706 % fällig am 12.05.2026	\$ 15.000	15.123	0,66
Summe Schweiz		32.884	1,42
VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
First Abu Dhabi Bank PJSC 1,375 % fällig am 19.02.2023	£ 900	1.077	0,05
4,145 % fällig am 18.02.2025	AUD 1.040	700	0,03
Summe Vereinigte Arabische Emirate		1.777	0,08
GROSSBRITANNIEN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Barclays PLC 3,650 % fällig am 16.03.2025	\$ 2.500	2.404	0,10
5,396 % fällig am 26.06.2024	AUD 2.750	1.877	0,08
6,024 % fällig am 16.05.2024	\$ 17.950	17.951	0,78
British Telecommunications PLC 4,500 % fällig am 04.12.2023	1.175	1.165	0,05
HSBC Holdings PLC 4,150 % fällig am 16.02.2024	AUD 6.000	4.065	0,18
5,696 % fällig am 10.03.2026	\$ 3.500	3.457	0,15
5,965 % fällig am 11.03.2025	15.500	15.370	0,66
6,115 % fällig am 12.09.2026	2.820	2.777	0,12
Imperial Brands Finance PLC 3,125 % fällig am 26.07.2024	11.300	10.809	0,47
Lloyds Banking Group PLC 4,507 % fällig am 20.03.2023	AUD 3.300	2.238	0,10
4,518 % fällig am 07.03.2025	2.360	1.581	0,07
Nationwide Building Society 3,766 % fällig am 08.03.2024	\$ 2.500	2.486	0,11
4,363 % fällig am 01.08.2024	3.635	3.588	0,16
NatWest Markets PLC 5,773 % fällig am 22.03.2025	8.900	8.824	0,38
Santander UK Group Holdings PLC 1,089 % fällig am 15.03.2025	16.700	15.611	0,68
3,373 % fällig am 05.01.2024	1.000	1.000	0,04
4,796 % fällig am 15.11.2024	1.000	984	0,04
Standard Chartered PLC 5,123 % fällig am 23.11.2025	9.100	8.845	0,38
6,063 % fällig am 30.03.2026	12.000	11.809	0,51
		116.841	5,06
NON-AGENCY-MBS			
Avon Finance PLC 4,331 % fällig am 20.09.2048	£ 10.756	12.694	0,55
Canada Square Funding PLC 4,205 % fällig am 17.06.2058	6.388	7.396	0,32
Eurohome UK Mortgages PLC 3,946 % fällig am 15.06.2044	343	393	0,02
Finsbury Square PLC 4,419 % fällig am 16.12.2069	£ 3.618	\$ 4.351	0,19
Great Hall Mortgages PLC 3,695 % fällig am 18.06.2038	28	33	0,00
Precise Mortgage Funding PLC 4,186 % fällig am 12.03.2055	512	615	0,03
4,265 % fällig am 16.10.2056	1.840	2.183	0,09

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Residential Mortgage Securities PLC 4,681 % fällig am 20.06.2070	132	158	0,01
RMAC PLC 4,206 % fällig am 12.06.2046	786	941	0,04
4,476 % fällig am 12.06.2046	2.856	3.422	0,15
Stratton Mortgage Funding PLC 3,826 % fällig am 20.07.2060	16.883	20.136	0,87
4,287 % fällig am 12.03.2052	4.427	5.304	0,23
4,292 % fällig am 25.09.2051	5.991	7.114	0,31
Towd Point Mortgage Funding PLC 3,826 % fällig am 20.07.2045	5.172	6.155	0,26
4,071 % fällig am 20.10.2051	755	903	0,04
Tudor Rose Mortgages 4,031 % fällig am 20.06.2048	4.874	5.782	0,25
		77.580	3,36
Summe Großbritannien		194.421	8,42
USA			
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE			
American Tower Trust 3,070 % fällig am 15.03.2048	\$ 2.000	1.989	0,09
Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust 5,046 % fällig am 25.03.2034	20	21	0,00
5,514 % fällig am 25.03.2035	391	385	0,02
CIT Mortgage Loan Trust 5,739 % fällig am 25.10.2037	1.588	1.580	0,07
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust 4,944 % fällig am 25.06.2036	151	150	0,01
5,889 % fällig am 25.10.2034	781	772	0,03
EFS Volunteer LLC 5,208 % fällig am 25.10.2035	178	177	0,01
EquiFirst Mortgage Loan Trust 7,389 % fällig am 25.10.2034	582	549	0,02
Finance America Mortgage Loan Trust 5,214 % fällig am 25.08.2034	798	738	0,03
First NLC Trust 4,459 % fällig am 25.08.2037	236	112	0,00
Fremont Home Loan Trust 5,124 % fällig am 25.10.2035	284	274	0,01
Home Equity Asset Trust 5,334 % fällig am 25.06.2034	645	628	0,03
Long Beach Mortgage Loan Trust 5,364 % fällig am 25.04.2035	1.224	1.207	0,05
MASTR Asset-Backed Securities Trust 5,089 % fällig am 25.09.2034	910	774	0,03
Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust 5,439 % fällig am 25.09.2033	664	655	0,03
Navient Private Education Loan Trust 2,650 % fällig am 15.12.2028	570	564	0,02
5,768 % fällig am 16.07.2040	3.022	2.981	0,13
5,918 % fällig am 15.10.2031	7.200	7.128	0,31
Nelnet Student Loan Trust 4,989 % fällig am 27.02.2051	1.142	1.129	0,05
NovaStar Mortgage Funding Trust 5,049 % fällig am 25.01.2036	954	936	0,04
RAAC Trust 6,489 % fällig am 25.05.2044	1.336	1.276	0,06
SBA Tower Trust 3,869 % fällig am 15.10.2049	3.000	2.869	0,12
SLC Student Loan Trust 4,666 % fällig am 15.05.2029	1.208	1.168	0,05
SLM Private Credit Student Loan Trust 5,099 % fällig am 15.06.2039	4.844	4.598	0,20
SLM Student Loan Trust 4,958 % fällig am 25.10.2029	1.839	1.823	0,08
5,039 % fällig am 27.12.2038	1.170	1.122	0,05
5,258 % fällig am 25.07.2023	809	801	0,03
5,858 % fällig am 25.04.2023	820	815	0,04

Aufstellung der Wertpapieranlagen des US Short-Term Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Merrill Lynch Mortgage Investors Trust				4,939 % fällig am 25.12.2049	10	10	0,00	4,692 % fällig am 20.11.2066	814	805	0,04
3,011 % fällig am 25.03.2033	\$ 194	\$185	0,01	5,059 % fällig am 25.03.2038	\$ 59	\$58	0,00	4,853 % fällig am 20.10.2037	148	148	0,01
6,709 % fällig am 25.03.2033	258	238	0,01	1,115 % fällig am 25.12.2037	43	42	0,00	5,232 % fällig am 20.05.2071	5.438	5.590	0,24
Mill City Mortgage Loan Trust				5,089 % fällig am 25.01.2041	68	67	0,00	5,238 % fällig am 20.06.2071	\$ 5.748	\$5.898	0,26
2,750 % fällig am 25.07.2059	389	383	0,02	5,389 % fällig am 25.05.2037	197	200	0,01	5,326 % fällig am 20.06.2071	7.051	7.219	0,31
New Residential Mortgage Loan Trust				Federal Home Loan Bank				Uniform Mortgage-Backed Security			
3,500 % fällig am 25.12.2057	412	391	0,02	0,900 % fällig am 26.02.2027	26.500	22.943	0,99	4,000 % fällig am 01.09.2049	3.803	3.613	0,16
4,500 % fällig am 25.05.2058	197	185	0,01	1,115 % fällig am 26.02.2027	31.500	27.524	1,19				
Sequoia Mortgage Trust				5,400 % fällig am 21.11.2024	35.000	35.017	1,52				
5,033 % fällig am 20.10.2034	513	456	0,02	Freddie Mac							
Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust				0,000 % fällig am 15.01.2038							
3,887 % fällig am 25.03.2034	10	9	0,00	(a)	699	26	0,00				
Structured Asset Mortgage Investments Trust				2,500 % fällig am 25.10.2048	789	703	0,03				
4,999 % fällig am 19.10.2034	321	300	0,01	3,000 % fällig am 25.09.2045	2.211	2.049	0,09	U.S. Treasury Notes	63.700	62.436	2,70
Towd Point Mortgage Trust				3,258 % fällig am 15.10.2040	7.520	7.322	0,32	3,500 % fällig am 15.09.2025			
3,750 % fällig am 25.05.2058	8.993	8.518	0,37	3,358 % fällig am 15.01.2038	17.507	17.520	0,76	Summe USA		986.679	42,70
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust				3,448 % fällig am 25.07.2044	4	4	0,00				
3,813 % fällig am 25.10.2035	251	229	0,01	3,729 % fällig am 15.08.2038	261	262	0,01				
4,849 % fällig am 25.04.2045	1	1	0,00	4,000 % fällig am 01.08.2048	1.527	1.459	0,06				
4,929 % fällig am 25.12.2045	32	29	0,00	4,618 % fällig am 15.05.2037	48	47	0,00				
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust				4,718 % fällig am 15.02.2034 - 15.08.2056	7.249	6.939	0,30				
4,218 % fällig am 15.07.2046	800	793	0,03	4,728 % fällig am 15.06.2037	560	549	0,02				
Wells Fargo-RBS Commercial Mortgage Trust				4,768 % fällig am 15.10.2036 - 15.06.2042	46	46	0,00				
3,337 % fällig am 15.06.2046	14.400		0,62	4,789 % fällig am 25.07.2050	9.795	9.461	0,41				
		88.977	3,85	4,798 % fällig am 15.10.2040	73	72	0,00				
				4,818 % fällig am 15.11.2050	78	76	0,00				
				4,838 % fällig am 15.05.2036 - 15.12.2041	173	169	0,01				
				5,400 % fällig am 23.12.2024	20.000	19.999	0,87				
				Ginnie Mae							
				0,706 % fällig am 20.12.2068	1.054	1.021	0,04				
				1,750 % fällig am 20.11.2029	2	2	0,00				
				1,968 % fällig am 20.04.2067	3.514	3.476	0,15				
				2,500 % fällig am 20.01.2049 - 20.06.2051	14.536	12.182	0,53				
				2,625 % fällig am 20.08.2024 - 20.03.2030	26	27	0,00				
				2,863 % fällig am 20.01.2066	436	429	0,02				
				3,000 % fällig am 20.06.2051 - 20.07.2051	50.093	43.147	1,87				
				3,896 % fällig am 20.12.2065	871	856	0,04				
				4,302 % fällig am 20.02.2067	747	741	0,03				
				4,398 % fällig am 20.09.2066	1.470	1.501	0,07				
				4,592 % fällig am 20.08.2067	2.028	2.009	0,09				

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft ⁽¹⁾	% des Netto-vernögens
FICC	1,900 %	30.12.2022	03.01.2023	\$ 2.672	U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 08.06.2023	\$ (2.725)	\$ 2.672	\$ 2.672	0,12
	4,280	30.12.2022	03.01.2023	151.800	U.S. Treasury Notes 0,250 % fällig am 31.10.2025	(154.836)	151.800	151.872	6,57
Summe Pensionsgeschäfte						\$ (157.561)	\$ 154.472	\$ 154.544	6,69

⁽¹⁾ Umfasst aufgelaufene Zinsen.

AN EINEM GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*, außer Anzahl der Kontrakte)

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovernögens
3-Month SOFR June Futures	Long	09.2023	2.250	\$ (74)	0,00
3-Month SOFR June Futures	Short	09.2024	854	479	0,02
U.S. Treasury 2-Year Note March Futures	Short	03.2023	2.026	71	0,00
U.S. Treasury 5-Year Note March Futures	Short	03.2023	2.401	394	0,02
U.S. Treasury 10-Year Note March Futures	Short	03.2023	61	18	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond March Futures	Short	03.2023	176	55	0,00
				\$ 943	0,04
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				\$ 943	0,04

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF⁽¹⁾

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag ⁽²⁾	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.IG-37 5-Year Index	(1,000) %	20.12.2026	\$ 65.700	\$ 771	0,04
CDX.IG-39 5-Year Index	(1,000)	20.12.2027	444.300	(694)	(0,03)
				\$ 77	0,01

ZINSSWAPS - BASISWAPS

Zahlung variabler Zinssatzindex	Erhalt variabler Zinssatzindex	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
3-Month USD-LIBOR	1-Month USD-LIBOR + 0,098 %	13.01.2023	\$ 39.800	\$ 23	0,00
3-Month USD-LIBOR	1-Month USD-LIBOR + 0,098 %	13.01.2023	52.000	29	0,00
				\$ 52	0,00
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate				\$ 129	0,01

⁽¹⁾ Agiert der Teilfonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definieren, dann erhält der Teilfonds entweder (i) vom Sicherungsgeber einen Betrag in Höhe des Nennwerts des Swaps und liefert die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er erhält einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

⁽²⁾ Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definieren.

DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend*, außer Anzahl der Kontrakte)

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	01.2023	\$ 13.226	¥ 1.950.000	\$ 1.566	\$ 0	\$ 1.566	0,07
BOA	01.2023	¥ 3.740.000	\$ 26.156	0	(2.213)	(2.213)	(0,10)
	02.2023	\$ 6.387	AUD 9.382	7	(21)	(14)	0,00
BPS	03.2023	ILS 12.700	\$ 3.741	131	0	131	0,01
BRC	01.2023	\$ 2.332	£ 1.922	0	(19)	(19)	0,00
CBK	02.2023	AUD 94.089	\$ 62.987	0	(930)	(930)	(0,04)
DUB	03.2023	MXN 13.925	701	0	(4)	(4)	0,00
JPM	01.2023	£ 72.058	87.012	320	0	320	0,01
	02.2023	\$ 702	MXN 14.389	30	0	30	0,00
MBC	01.2023	€ 86.187	\$ 90.330	0	(1.693)	(1.693)	(0,07)
	02.2023	\$ 2.028	AUD 3.014	19	0	19	0,00
MYI	01.2023	€ 2.359	\$ 2.506	0	(11)	(11)	0,00
	01.2023	\$ 7	€ 6	0	0	0	0,00
RBC	03.2023	MXN 58	\$ 3	0	0	0	0,00
SCX	01.2023	\$ 1.404	£ 1.134	0	(40)	(40)	0,00
	01.2023	13.060	¥ 1.790.263	519	0	519	0,02
UAG	01.2023	3.566	£ 2.880	0	(101)	(101)	(0,01)
				\$ 2.592	\$ (5.032)	\$ (2.440)	(0,11)

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 31. Dezember 2022 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend und E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	01.2023	€ 45	\$ 49	\$ 0	\$ 0	\$ 0	0,00
	01.2023	\$ 6.481	€ 6.133	68	0	68	0,00
BRC	01.2023	344	325	2	0	2	0,00
CBK	01.2023	€ 5.912	\$ 6.288	0	(24)	(24)	0,00
	01.2023	\$ 87.518	€ 84.254	2.441	0	2.441	0,11
MBC	01.2023	€ 6	\$ 7	0	0	0	0,00
	01.2023	\$ 81.212	€ 77.487	1.521	0	1.521	0,07
MYI	01.2023	2.391	2.247	9	0	9	0,00
SCX	01.2023	85.361	81.925	2.111	0	2.111	0,09
				\$ 6.152	\$ (24)	\$ 6.128	0,27
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						\$ 3.688	0,16
Summe Anlagen						\$ 2.276.961	98,56
Sonstige Aktiva und Passiva						\$ 33.154	1,44
Nettovermögen						\$ 2.310.115	100,00

Aufstellung der Wertpapieranlagen des US Short-Term Fund (Forts.)

ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend*):

* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

- (a) Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.
 (b) Nullkuponwertpapier.
 (c) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.
 (d) Mit dem Fonds verbunden.
 (e) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2021: 0,10 %):

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeits- datum	Kauf- datum	Kosten	Markt- wert	% des Nettovermögens
Citigroup, Inc.	5,850 %	17.03.2026	10.03.2022	\$ 3.400	\$ 3.410	0,15
Deutsche Bank AG	0,898	28.05.2024	25.05.2021 - 31.03.2022	4.056	3.836	0,17
				\$ 7.456	\$ 7.246	0,32

Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von 0 USD (31. Dezember 2021: 215.008 USD) wurden gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen zum 31. Dezember 2022 als Sicherheiten verpfändet.

Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von 0 USD (31. Dezember 2021: 237.156 USD) wurden gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte zum 31. Dezember 2022 als Sicherheiten für verzögert gelieferte Wertpapiere oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte verpfändet oder geliefert.

Barmittel in Höhe von 16.350 USD (31. Dezember 2021: 15.635 USD) wurden zum 31. Dezember 2022 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von 0 USD (31. Dezember 2021: 281 USD) und Barmittel in Höhe von 1.780 USD (31. Dezember 2021: 3.950 USD) wurden gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. zum 31. Dezember 2022 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert⁽¹⁾

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 1.891.711	\$ 0	\$ 1.891.711
Investmentfonds	62	225.956	0	226.018
Pensionsgeschäfte	0	154.472	0	154.472
Finanzderivate ⁽³⁾	0	4.760	0	4.760
Summen	\$ 62	\$ 2.276.899	\$ 0	\$ 2.276.961

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2021 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie ⁽²⁾	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	\$ 0	\$ 2.807.383	\$ 0	\$ 2.807.383
Investmentfonds	269.578	0	0	269.578
Pensionsgeschäfte	0	1.571	0	1.571
Finanzderivate ⁽³⁾	(7.684)	(3.708)	0	(11.392)
Summen	\$ 261.894	\$ 2.805.246	\$ 0	\$ 3.067.140

⁽¹⁾ Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

⁽²⁾ Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

⁽³⁾ Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung des Marktwerts der außerbörslich gehandelten Finanzderivate und (erhaltenen)/verpfändeten Sicherheiten nach Kontrahenten zum 31. Dezember 2022 und 31. Dezember 2021:

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2022			Zum 31. Dez. 2021		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto- engagement ⁽¹⁾	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Nettoengagement ⁽¹⁾
AZD	\$ 1.566	\$ (1.460)	\$ 106	\$ k. A.	k. A.	\$ k. A.
BOA	(2.159)	1.770	(389)	(145)	0	(145)
BPS	131	0	131	(135)	0	(135)
BRC	(17)	0	(17)	133	0	133
CBK	1.487	(1.350)	137	(244)	281	37
DUB	(4)	0	(4)	(25)	0	(25)
GLM	k. A.	k. A.	k. A.	(719)	770	51
GSC	k. A.	k. A.	k. A.	(3)	0	(3)
HUS	k. A.	k. A.	k. A.	172	0	172
JPM	350	(290)	60	892	(780)	112
MBC	(153)	0	(153)	k. A.	k. A.	k. A.

Kontrahent	Zum 31. Dez. 2022			Zum 31. Dez. 2021		
	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Nettoengagement ⁽¹⁾	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Nettoengagement ⁽¹⁾
MYI	\$ (2)	\$ 10	\$ 8	\$ (197)	\$ (60)	\$ (257)
RBC	k. A.	k. A.	k. A.	726	(460)	266
SCX	2.590	(2.250)	340	(3.904)	3.180	(724)
TOR	k. A.	k. A.	k. A.	805	(630)	175
UAG	(101)	0	(101)	k. A.	k. A.	k. A.

⁽¹⁾ Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Nettobeträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 16, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 31. Dezember 2022:

	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	43,64	50,83
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	38,19	55,09
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,05	0,01
Investmentfonds	9,78	10,17
Pensionsgeschäfte	6,69	0,06
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,04	(0,33)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,01	0,00
Freiverkehrsfinanzderivate	0,16	(0,10)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	k. A.	(8,12)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	k. A.	(8,97)

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 31. Dezember 2022 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	31. Dez. 2022 (%)	31. Dez. 2021 (%)
Australien	1,66	0,22
Belgien	0,39	0,12
Bermuda	0,39	0,35
Kaimaninseln	3,83	3,47
Dänemark	0,66	1,14
Finnland	0,38	0,23
Frankreich	2,56	0,36
Deutschland	1,17	0,39
Indien	k. A.	0,82
Irland	5,43	4,63
Israel	0,35	0,38
Italien	0,22	k. A.
Japan	5,03	5,23
Luxemburg	0,10	0,08
Multinational	k. A.	0,04
Niederlande	3,03	1,12
Norwegen	0,04	k. A.
Saudi-Arabien	0,11	0,10
Singapur	0,07	0,51
Südkorea	0,84	0,82
Spanien	0,42	0,03
Supranational	1,10	1,06
Schweiz	1,42	0,47
Vereinigte Arabische Emirate	0,08	0,66
Großbritannien	8,42	10,25
USA	42,70	72,26
Kurzfristige Instrumente	1,48	1,19
Investmentfonds	9,78	10,17
Pensionsgeschäfte	6,69	0,06
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,04	(0,33)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	0,01	0,00
Zinsswaps – Basisswaps	0,00	0,00
Freiverkehrsfinanzderivate		
Verkaufsoptionen		
Optionen auf Wertpapiere	k. A.	0,00
Devisenterminkontrakte	(0,11)	(0,19)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,27	0,09
Sonstige Aktiva und Passiva	1,44	(15,73)
Nettovermögen	100,00	100,00

1. ALLGEMEINE INFORMATIONEN

Die einzelnen in diesem Bericht beschriebenen Fonds (nachfolgend jeweils als ein „Fonds“ und gemeinsam als die „Fonds“ bezeichnet) sind Teilfonds der PIMCO Funds: Global Investors Series plc (die „Gesellschaft“), einer offenen Investmentgesellschaft des Umbrella-Typs mit variablem Kapital und mit gesonderter Haftung zwischen den Fonds und mit beschränkter Haftung, die gemäß dem Companies Act von 2014 unter der Register-Nr. 276928 in Irland eingetragen und von der Zentralbank von Irland (die „Zentralbank“) nach den Rechtsvorschriften der Europäischen Gemeinschaften von 2011 (Organismen für die gemeinsame Anlage in übertragbaren Wertpapieren („OGAW“)) (Verordnung Nr. 352 von 2011) in der jeweils geltenden Fassung (die „OGAW-Richtlinien“) genehmigt wurde. Bei der Gesellschaft handelt es sich um eine Umbrella-Gesellschaft, die aus verschiedenen Fonds besteht, die jeweils eine oder mehrere Anteilklassen umfassen. Nach dem Ermessen des Verwaltungsrats (der „Verwaltungsrat“ oder die „Verwaltungsratsmitglieder“) dürfen für einen Fonds mehrere Anteilklassen („Klassen“) ausgegeben werden. Für jeden einzelnen Fonds wird ein gesondertes Vermögenswertportfolio geführt, welches in Übereinstimmung mit den Anlagezielen und der Anlagepolitik, die auf diesen Fonds zutreffen, angelegt wird. Der Verwaltungsrat darf mit vorheriger schriftlicher Zustimmung der Zentralbank zu gegebener Zeit zusätzliche Fonds auflegen. Der Verwaltungsrat darf gemäß den Anforderungen der Zentralbank zu gegebener Zeit zusätzliche Klassen auflegen. Die Gesellschaft wurde am 10. Dezember 1997 gegründet.

PIMCO Global Advisors (Ireland) Limited (die „Verwaltungsgesellschaft“) ist die Verwaltungsgesellschaft der Gesellschaft.

Wie im Prospekt der Gesellschaft vorgesehen, wurden Pacific Investment Management Company LLC, PIMCO Europe Ltd und PIMCO Europe GmbH (jeweils eine „Anlageberatungsgesellschaft“) als Anlageberatungsgesellschaften für verschiedene Fonds der Gesellschaft bestellt. PIMCO Asia Limited und PIMCO Asia Pte Ltd (jeweils eine „Anlageberatungsgesellschaft“) haben von der Zentralbank die Genehmigung erhalten, als Anlageberatungsgesellschaft für irische Fonds zu agieren.

Gemäß dem Prospekt der Gesellschaft kann jede Anlageberatungsgesellschaft die diskretionäre Anlageverwaltung der Fonds vorbehaltlich aller gesetzlichen und aufsichtsrechtlichen Anforderungen einer oder mehreren Unter-Anlageberatungsgesellschaften übertragen. Wenn für einen bestimmten Fonds eine Anlageberatungsgesellschaft bestellt wurde, hat die Anlageberatungsgesellschaft die jeweils übrigen Anlageberatungsgesellschaften, PIMCO Asia Limited und PIMCO Asia Pte Ltd., als Unter-Anlageberatungsgesellschaft bezüglich des bzw. der jeweiligen Fonds bestellt. Die Gebühren der einzelnen entsprechend bestellten Unter-Anlageberatungsgesellschaften sind von der Verwaltungsgesellschaft oder von den Anlageberatungsgesellschaften im Namen der Anlageberatungsgesellschaft aus der Verwaltungsgebühr zu begleichen.

Der Sitz der Gesellschaft befindet sich in 78 Sir John Rogerson's Quay, Dublin 2, D02 HD32, Irland.

2. WESENTLICHE BILANZIERUNGS- UND BEWERTUNGSGRUNDSÄTZE

Es folgt eine Zusammenfassung der wesentlichen Bilanzierungs- und Bewertungsmethoden und der Schätzungstechniken, die von der Gesellschaft angewandt und beim Aufstellen dieses Abschlusses verwendet werden:

(a) Erstellungsgrundlage

Der Abschluss wird gemäß dem vom Financial Reporting Council herausgegebenen Financial Reporting Standard 102 („FRS 102“), „The Financial Reporting Standard applicable in the United Kingdom and Republic of Ireland“, dem Companies Act von 2014 und den OGAW-Richtlinien erstellt. Die Abschlüsse werden für alle Fonds nach dem Grundsatz der Unternehmensfortführung erstellt.

Die in der Aufstellung der ausgewiesenen Gesamtgewinne und -verluste sowie in einer Überleitung der Eigenkapitalveränderungen aufzuführenden Angaben sind nach Meinung des Verwaltungsrats in der Betriebsergebnisrechnung sowie im Ausweis der Nettovermögensänderungen enthalten.

Die Gesellschaft hat von der für offene Investmentfonds, die einen erheblichen Anteil ihres Vermögens in äußerst liquiden und zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen halten, verfügbaren Ausnahmeregelung gemäß Section 7 von FRS 102 Gebrauch gemacht und legt daher keine Kapitalflussrechnung vor.

Der Abschluss wird nach dem Anschaffungskostenprinzip unter Zugrundelegung der Neubewertung der ergebniswirksam zum Marktwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten aufgestellt.

Die Gesellschaft führt für jeden Fonds gesonderte Konten. Anteile werden von der Gesellschaft ausgegeben und dem Fonds zugewiesen, den der Anteilinhaber auswählt. Der Erlös aus der Ausgabe und der daraus entstehende Ertrag werden jeder Fondsklasse im Verhältnis zu der gesamten Bewertung jeder Klasse gutgeschrieben. Bei der Rücknahme haben Anteilinhaber nur Anspruch auf ihren Teil des am Fonds gehaltenen Nettovermögens, für den Anteile an sie ausgegeben wurden.

Die Gesellschaft verwendet den US-Dollar als Präsentationswährung. Die Abschlüsse der einzelnen Fonds werden in der jeweiligen Funktionswährung erstellt. Die Gesellschaftssummen der Fonds, die durch das irische Gesellschaftsrecht vorgeschrieben werden, lauten auf US-Dollar, da diese Währung das vorherrschende wirtschaftliche Umfeld der Gesellschaft darstellt. Falls nicht anders angegeben, sind alle Beträge in US-Dollar ausgewiesen. Die Abschlüsse der einzelnen Fonds werden in US-Dollar umgerechnet und zur Erstellung des Abschlusses der Gesellschaft zusammengefasst.

Die Vermögensaufstellung der Fonds wird mithilfe von Wechselkursen zum Ende des Geschäftsjahres umgerechnet und die Ertrags- und Aufwandsrechnung der Fonds sowie die Aufstellung der Veränderung des Nettovermögens werden zum durchschnittlichen Wechselkurs (als Annäherung an die tatsächlichen Kurse) des Geschäftsjahres umgerechnet, um diese in den Abschluss der Fonds einzubeziehen.

Der Währungsgewinn oder -verlust aus der Umrechnung des Nettovermögens der Gesellschaft zu Beginn des Geschäftsjahres und die durchschnittliche Wechselkursdifferenz aus der Umrechnung der Betriebsergebnisrechnung und des Ausweises der Nettovermögensänderungen der Gesellschaft sind im Ausweis der Nettovermögensänderungen der Gesellschaft ausgewiesen. Diese Umrechnungsanpassung hat keinen Einfluss auf das den einzelnen Fonds zugeordnete Nettovermögen.

Alle Beträge wurden, sofern nicht anders angegeben, auf die nächsten Tausend gerundet. Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter tausend liegt. In der Aufstellung der Wertpapieranlagen bestimmter Fonds finden sich gegebenenfalls übertragbare Wertpapiere, die sowohl einen Nennwert als auch einen beizulegenden Zeitwert von null aufweisen, wenn der tatsächliche Nennwert und beizulegende Zeitwert auf das nächste Tausend gerundet werden.

(b) Ermittlung des Nettoinventarwerts

Der Nettoinventarwert (der „NIW“) jedes Fonds und/oder jeder Anteilkategorie wird, wie im aktuell gültigen Prospekt der Gesellschaft bzw. in der jeweiligen Ergänzung offengelegt, mit dem Schluss des regulären Handels an jedem Handelstag berechnet.

Die Gesellschaft hat beschlossen, die auf den Ansatz und die Bewertung bezogenen Bestimmungen von International Accounting Standard („IAS“) 39 Finanzinstrumente: Ansatz und Bewertung sowie die Angabe- und Darstellungspflichten gemäß FRS 102 für die Bilanzierung ihrer Finanzinstrumente anzuwenden. Gemäß IAS 39 wurden Wertpapiere der Fonds sowie andere Vermögenswerte zum mittleren oder zuletzt gehandelten Kurs am 31. Dezember 2022 bewertet, um das Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber (das „Nettovermögen“) zu bestimmen.

(c) Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge

Wertpapiertransaktionen werden zum Handelstag zum Zwecke der Finanzberichterstattung ausgewiesen. Wertpapiere, die auf der Basis des Emissionstermins oder der verzögerten Lieferung gekauft oder verkauft werden, können im Anschluss an einen standardmäßigen Abrechnungszeitraum für das Wertpapier nach dem Handelstag abgerechnet werden. Realisierte Gewinne und Verluste aus Wertpapierverkäufen werden auf der Basis der ermittelten Kosten erfasst. Dividendeneinkünfte werden zum Ex-Dividende-Datum erfasst; ausgenommen hiervon sind bestimmte Dividenden von ausländischen Wertpapieren, bei denen das Ex-Dividende-Datum möglicherweise bereits verstrichen ist. Diese werden erfasst, sobald der Fonds Informationen über das Ex-Dividende-Datum erhält. Um Disagios und Prämienabschreibungen bereinigte Zinseinkünfte werden auf Rechnungsabgrenzungsbasis erfasst und mithilfe von Effektivzinsmethoden berechnet. Davon ausgenommen sind Wertpapiere mit einem in der Zukunft liegenden Effektivdatum: Hier werden die Zinseinkünfte ab dem Effektivdatum auf Rechnungsabgrenzungsbasis erfasst. Für wandelbare Wertpapiere werden Aufschläge, die dem Wandlungsrecht zuzuordnen sind, nicht abgeschrieben. Gegebenenfalls anfallende Rückzahlungsgewinne (-verluste) auf hypothekenähnliche und sonstige forderungsbesicherte Wertpapiere werden in der Betriebsergebnisrechnung als Bestandteile des Zinsertrags ausgewiesen.

Wenn die Eintreibung der Zinsen bzw. eines Teils der Zinsen auf der Basis konsequent angewandter Verfahren zweifelhaft geworden ist, können Schuldtitel so behandelt werden, als würden keine weiteren Zinsen darauf auflaufen. Zudem kann der hiermit verbundene Zinsertrag reduziert werden, indem die Schuldtitel zinslos gestellt und entsprechende Zinsforderungen abgeschrieben werden. Die Zinslosstellung eines Schuldtitels wird aufgehoben, wenn der Emittent seine Zinszahlungen wieder aufnimmt oder die Eintreibbarkeit der Zinsen als wahrscheinlich erachtet wird.

Erträge werden vor Abzug nicht erstattungsfähiger Quellensteuern sowie nach Abzug von Steuergutschriften ausgewiesen. Quellensteuern werden in der Betriebsergebnisrechnung separat ausgewiesen. Die Fonds können Steuern unterliegen, die von bestimmten Ländern auf Kapitalgewinne aus dem Verkauf von Anlagen erhoben werden. Kapitalertragsteuern werden nach dem Prinzip der Periodenabgrenzung verbucht und in der Betriebsergebnisrechnung separat ausgewiesen.

(d) Mehrfach-Klassen-Zuordnungen und abgesicherte Anteilsklassen

Wenn nicht anders angegeben, verfügen sämtliche von der Gesellschaft angebotene Klassen in Bezug auf Vermögenswerte und Stimmprivilegien über gleiche Rechte (außer bei Anteilhabern einer Klasse, die über ausschließliche Stimmrechte in Bezug auf Angelegenheiten verfügen, die ausschließlich diese Klasse betreffen). Innerhalb jeder Klasse eines jeden Fonds darf die Gesellschaft entweder teilweise oder nur ausschüttende Anteile (Einkommen ausschüttende Anteile), thesaurierende Anteile (Einkommen thesaurierende Anteile) und Income II-Anteile (Anteile, die eine erhöhte Rendite ausschütten sollen) ausgeben. Aufgrund der Mehrklassen-Struktur kann der Anteilhaber die Methode für den Anteilserwerb wählen, die ihm unter Berücksichtigung der zu erwerbenden Menge, des Zeitraums, für den der Anteilhaber die Anteile halten möchte, sowie der sonstigen Umstände am vorteilhaftesten erscheint. Sind Anteile abweichender Klassen oder Emissionen im Umlauf, kann der NIW je Anteil zwischen den Klassen abweichen, um die Tatsache wiederzugeben, dass das Einkommen thesauriert oder ausgeschüttet wurde, oder für sie können unterschiedliche Gebühren und Aufwendungen anfallen. Realisierte und nicht realisierte Kapitalerträge und -verluste der einzelnen Fonds werden jeder Anteilsklasse täglich auf der Basis des relativen Nettovermögens der einzelnen Klassen des betreffenden Fonds zugewiesen.

Bei den abgesicherten Klassen (die „abgesicherten Klassen“) möchte die Gesellschaft gemäß den Bestimmungen und Auslegungen, die die Zentralbank jeweils bekannt gibt, diese gegen Schwankungen der Währungen, auf die die abgesicherten Klassen lauten, gegenüber anderen Währungen absichern. Die abgesicherten Klassen unterliegen durch diese Transaktionen keiner Hebelwirkung. Die Gesellschaft wird zwar versuchen, das Währungsrisiko abzusichern, es kann jedoch nicht gewährleistet werden, dass sie damit erfolgreich ist. Die Absicherungsgeschäfte sind klar der jeweiligen Klasse zuzuordnen. Alle Kosten und Gewinne/(Verluste) dieser Absicherungsstrategien können den Nutzen für Anteilhaber der betreffenden abgesicherten Anteilsklasse beträchtlich einschränken, wenn die Klassenwährung gegenüber der Funktionswährung und/oder der Währung fällt, auf die einige oder alle Vermögenswerte des betreffenden Fonds lauten und die gegenüber anderen Währungen abgesichert sind.

(e) Devisentransaktionen

Die Abschlüsse der einzelnen Fonds werden unter Zuhilfenahme der primären Wirtschaftsumgebung, in der sie ihre Geschäftstätigkeit ausüben, vorgelegt (die „Funktionswährung“). Die Funktions- und Präsentationswährungen der Fonds der Gesellschaft sind identisch.

Die Gesellschaftssummen der Fonds, die durch das irische Gesellschaftsrecht vorgeschrieben werden, lauten auf US-Dollar, da diese Währung das vorherrschende wirtschaftliche Umfeld der Gesellschaft darstellt.

Die Marktwerte der ausländischen Wertpapiere, Währungspositionen und sonstigen Aktiva und Passiva werden auf Basis der am jeweiligen Tag geltenden Umtauschkurse in die Funktionswährung des jeweiligen Fonds umgerechnet. Schwankungen im Wert der Währungsbeteiligungen und sonstigen Aktiva und Passiva aus Veränderungen der Wechselkurse werden als nicht realisierte Gewinne oder Verluste aus Fremdwährungen erfasst.

Die nicht realisierten Gewinne oder Verluste aus der Umrechnung von Wertpapieren, die auf Fremdwährungen lauten, sind in der Nettoänderung der nicht realisierten Wertzunahme /(-abnahme) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten erfasst, und die nicht realisierten Gewinne oder Verluste aus der Umrechnung von Finanzderivaten, die auf Fremdwährungen lauten, sind in der Nettoänderung der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten in der Betriebsergebnisrechnung enthalten.

Währungsgewinne und -verluste aus dem Verkauf von Wertpapieren, die auf Fremdwährungen lauten, sind im realisierten Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten erfasst, und die Währungsgewinne und -verluste aus dem Verkauf von Derivaten, die auf Fremdwährungen lauten, sind im realisierten Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten in der Betriebsergebnisrechnung enthalten.

Realisierte Gewinne und Verluste zwischen den Transaktions- und Abwicklungsdaten aus dem Erwerb und Verkauf von auf Fremdwährung lautenden Wertpapieren und Finanzderivaten sind im realisierten Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährungen in der Betriebsergebnisrechnung enthalten.

Bestimmte Fonds verfügen über eine abgesicherte Klasse, die Devisenterminkontrakte einget, die dazu bestimmt sind, den Absicherungseffekt auf Fondsebene glattzustellen, damit sich die Funktionswährung weiter an anderen Währungen als der Funktionswährung beteiligen kann.

(f) Transaktionskosten

Transaktionskosten sind Kosten, die entstehen, um ergebniswirksam zum Marktwert bewertete Finanzvermögen und -verbindlichkeiten zu erwerben. Zu ihnen zählen an Mittler, Berater, Makler und Händler gezahlte Gebühren und Provisionen. Transaktionskosten werden in der Betriebsergebnisrechnung unter dem realisierten Nettogewinn/(-verlust) und der Nettoänderung der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten und dem realisierten Nettogewinn/(-verlust) und der Nettoänderung der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten erfasst. Bei Rentenwerten und bestimmten Derivaten können Transaktionskosten nicht aus dem Kaufpreis des Wertpapiers herausgezogen werden, weshalb sie nicht separat ausgewiesen werden können.

(g) Einkommensausgleich

Bei dem von der Gesellschaft angewandten Rechnungslegungsstandard handelt es sich um den sog. Einkommensausgleich. Die Einkommensausgleichsanpassung stellt sicher, dass an die in die Anteilsklassen ausschüttend und ausschüttend II anliegenden Anteilhaber ausgeschüttetes Einkommen prozentual dem Besitzzeitraum im Ausschüttungszeitraum entspricht. Ein Betrag, der dem Teil des Kurses pro Anteil entspricht, der den etwaigen, bis zum Datum der Ausgabe der Anteile aufgelaufenen, jedoch nicht ausgeschütteten Ertrag wiedergibt, wird als Ausgleichszahlung angesehen und als an den jeweiligen Anteilhaber zurückbezahlt behandelt, entweder bei (i) Rücknahme dieser Anteile vor der Zahlung der ersten Dividende auf dieselben oder (ii) Zahlung der ersten Dividende, zu der der Anteilhaber im selben Berichtszeitraum, in dem die Anteile ausgegeben wurden, berechtigt war. Die Zahlung von Dividenden nach der Zahlung der ersten Dividende darauf oder die Rücknahme dieser Anteile nach Zahlung der ersten Dividende wird so ausgelegt, dass darin ein etwaiger, bis zum Datum der jeweiligen Rücknahme oder Erklärung der Dividende aufgelaufener, jedoch unbezahlter Nettoertrag enthalten ist.

(h) Kritische Schätzungen und Annahmen in der Rechnungslegung

Die Erstellung des Abschlusses gemäß FRS 102 verlangt vom Verwaltungsrat Beurteilungen, Schätzungen und Annahmen, die sich auf die Anwendung von Bilanzierungs- und Bewertungsmethoden sowie auf die ausgewiesene Höhe von Vermögenswerten, Verbindlichkeiten, Erträgen und Aufwendungen auswirken. Die tatsächlichen Ergebnisse können von diesen Schätzungen abweichen. Schätzungen und zugrunde liegende Annahmen werden laufend überprüft. Änderungen an bilanziellen Schätzungen werden in dem Berichtszeitraum ausgewiesen, in dem die Schätzungen korrigiert werden, sowie in allen davon betroffenen zukünftigen Zeiträumen.

(i) Swing Pricing

Swing Pricing kann als wirksamer Mechanismus eingesetzt werden, um die Anteilhaber vor den Auswirkungen einer Verwässerung zu schützen, die infolge höherer transaktionsbezogener Kosten im Zusammenhang mit erheblichen Nettozuflüssen oder -abflüssen auftreten kann. Gemäß der Satzung werden die zugrunde liegenden Wertpapiere eines Fonds, die an einem geregelten Markt notiert sind oder gehandelt werden, in der Regel zum Mittelkurs oder zum letzten gehandelten Kurs bei Geschäftsschluss bewertet und bepreist, aber diese Wertpapiere werden unter Verwendung von Geld- und Briefkursen gehandelt. Je größer die Spanne zwischen diesen Geld- und Briefkursen ist, desto größer sind die Auswirkungen auf die Bewertung eines Fonds.

Das Swing Pricing wird umgesetzt, indem der Nettoinventarwert je Anteil um einen Swing-Faktor nach oben oder unten verschoben wird, je nach der Richtung der Netto-Cashflows eines bestimmten Fonds. Der Swing-Faktor ist der vom Verwaltungsrat festgelegte Betrag, um den der Nettoinventarwert je Anteil nach oben oder unten angepasst werden kann, um Handels- und Transaktionskosten (wie steuerliche und andere Kosten und Gebühren) zu berücksichtigen, die beim tatsächlichen Erwerb oder der Veräußerung von Vermögenswerten des betreffenden Fonds anfallen würden. Unter normalen Marktbedingungen beträgt der Swing-Faktor nicht mehr als 2 % des ursprünglichen Nettoinventarwerts je Anteil eines Fonds. Unter außergewöhnlichen Marktbedingungen kann dieser Höchstwert jedoch auf bis zu 5 % erhöht werden, um die Interessen der Anteilhaber zu schützen. Dieser angepasste NIW wird dann auf alle Zeichnungen oder Rücknahmen angewendet, die an dem betreffenden Handelstag eingehen. Erhebliche Nettozuflüsse führen zu einem Anstieg des NIW je Anteil, erhebliche Nettoabflüsse

zu einem Rückgang. Swing Pricing wird von der Gesellschaft angewandt, wenn die Netto-Cashflows einen vom Verwaltungsrat festgelegten Schwellenwert überschreiten, bei dessen Überschreitung der Verwaltungsrat der Ansicht ist, dass sich die durch die Transaktionskosten verursachte Verwässerung wesentlich auf einen Fonds auswirken könnte.

Swing Pricing wird auf Fondsebene und nicht auf Klassenebene implementiert, da die transaktionsbezogenen Kosten auf Fondsebene anfallen.

Zum 31. Dezember 2022 wurde Swing Pricing auf den Income Fund II angewandt. Zum 31. Dezember 2021 wurde auf keinen der anderen Fonds Swing Pricing angewandt.

Der NIW je Anteil ist in Erläuterung 19 angegeben und kann eine Swing-Pricing-Anpassung enthalten. Swing-Price-Anpassungen sind in der Vermögensaufstellung, der Aufwands- und Ertragsrechnung sowie den Veränderungen des Nettovermögens erfasst.

3. ANLAGEN ZUM MARKTWERT UND MARKTBEWERTUNGSHIERARCHIE

Zu dieser Kategorie gehören zwei Unterkategorien: gemäß Bestimmung der Verwaltung bei Auflegung als ergebniswirksam zum Marktwert zu bewertende Finanzvermögen und -verbindlichkeiten und zu Handelszwecken gehaltene Finanzvermögen und -verbindlichkeiten. Bei Auflegung ergebniswirksam zum Marktwert ausgewiesene Finanzvermögen und -verbindlichkeiten sind Finanzinstrumente, die nicht als zu Handelszwecken gehalten eingestuft werden, sondern sie werden verwaltet und ihre Wertentwicklung wird auf Basis des Marktwerts in Übereinstimmung mit der dokumentierten Anlagestrategie des Fonds bewertet. Zu Handelszwecken gehaltene finanzielle Vermögenswerte oder Verbindlichkeiten werden hauptsächlich zum Zweck des kurzfristigen Verkaufs oder Rückkaufs erworben oder eingegangen. Derivate fallen in die Kategorie der zu Handelszwecken gehaltenen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten.

(a) Grundsätze für die Bewertung von Anlagen

Die Fondspolitik erfordert, dass Anlageberatungsgesellschaften („PIMCO“) und der Verwaltungsrat die Informationen über diese Finanzvermögen und -verbindlichkeiten auf Basis des Marktwerts gemeinsam mit anderen verbundenen Finanzinformationen bewerten.

Gewinne und Verluste aus Änderungen im Marktwert der Kategorie „ergebniswirksam zum Marktwert bewertete Finanzvermögen“ werden in die Betriebsergebnisrechnung in das Geschäftsjahr einbezogen, in dem sie anfallen.

Die Wertpapiere des Fonds und anderen Vermögenswerte, für die Marktkurse jederzeit zur Verfügung stehen, werden zum Marktwert bewertet. Der beizulegende Zeitwert wird im Allgemeinen auf der Grundlage der offiziellen Schlusskurse oder der letzten gemeldeten Verkaufspreise ermittelt, oder – falls keine Verkäufe gemeldet werden – auf der Grundlage von Kursen, die von etablierten Marktmakern bereitgestellt werden, oder von Preisen (einschließlich bewerteter Preise), die von den zugelassenen Kursdiensten des Fonds, Kursmeldesystemen und anderen Drittquellen (zusammen „Kursdienste“) bereitgestellt werden.

Anlagen, die zunächst in anderen Währungen als der Funktionswährung des Fonds bewertet wurden, werden mithilfe der Wechselkurse von Kursdiensten umgerechnet. Im Ergebnis kann der NIW der Fondsanteile von Änderungen des Werts der Währungen gegenüber der Fondsfunktionswährung beeinflusst werden. Der Wert von an ausländischen Märkten gehandelten oder auf andere als die Fondsfunktionswährung lautenden Wertpapieren kann an dem Tag deutlich beeinflusst werden, an dem die jeweilige Börse geschlossen ist, und der NIW kann sich an den Tagen ändern, an denen Anleger keine Anteile erwerben, zurückgeben oder tauschen können.

Hat sich der Wert eines Wertpapiers, das ausschließlich an einer ausländischen Börse gehandelt wird, nach dem Schluss der Primärbörse oder des Primärmarkts des Wertpapiers, jedoch vor dem Schluss des Handelstags wesentlich geändert, wird das Wertpapier zum Marktwert auf Grundlage von Verfahren bewertet, die der Verwaltungsrat eingeführt und zugelassen hat. Wertpapiere, die nicht gehandelt werden, wenn ein Fonds geöffnet ist, werden ebenfalls zum Marktwert bewertet. Ein Fonds kann den Marktwert von Anlagen auf Grundlage von Informationen bestimmen, die Kursdienste und andere Drittanbieter liefern, die Kurse zum Marktwert oder Anpassungen durch Bezug auf andere Wertpapiere, Indizes oder Vermögenswerte empfehlen können. Wenn ein Fonds erwägt, ob Marktbewertung erforderlich ist und bei der Bestimmung der Marktwerte, kann er, unter anderem, wesentliche Ereignisse berücksichtigen (bei denen anzunehmen ist, dass sie Änderungen im Wert von Wertpapieren oder Wertpapierindizes enthalten), die nach dem Schluss des betreffenden Markts und vor dem Schluss des Handelstages eintreten. Ein Fonds darf Berechnungswerkzeuge nutzen, die Drittanbieter liefern, um den Marktwert von Wertpapieren zu bestimmen, die von wesentlichen Ereignissen beeinträchtigt wurden. Ausländische Börsen erlauben eventuell den Handel mit ausländischen Wertpapieren an Tagen, an denen die Gesellschaft nicht für das Geschäft geöffnet ist, was dazu führen kann, dass das Anlageportfolio eines Fonds betroffen ist, wenn der Fonds nicht in der Lage ist, Anteile zu kaufen oder zu verkaufen. Die Fonds haben

Kursdienste damit beauftragt, den Marktwert ausländischer Wertpapiere zu bestimmen. Dieser Dienst setzt statistische Daten und Programme ein, die auf der vergangenen Wertentwicklung von Märkten und anderen Wirtschaftsdaten beruhen, um ihn bei der Schätzung des Marktwerts zu unterstützen. Schätzungen von Marktwerten, die ein Fonds für ausländische Wertpapiere nutzt, können vom Wert abweichen, der tatsächlich beim Verkauf dieser Wertpapiere erzielt wird, und die Differenz kann sich wesentlich auf den Abschluss auswirken. Bestimmungen des Marktwerts können subjektive Festsetzungen des Werts eines Wertpapiers oder eines Vermögenswerts erfordern, und der Marktwert, um den NIW eines Fonds zu bestimmen, kann von den notierten oder veröffentlichten Kursen oder den Kursen abweichen, die andere für die gleichen Anlagen verwenden. Darüber hinaus führt der Einsatz von Bestimmungen des Verkehrswerts eventuell nicht immer zu Kursanpassungen der Wertpapiere oder anderen Vermögenswerte, die ein Fonds hält.

(b) Marktbewertungshierarchie

Die Gesellschaft muss Angaben bezüglich der Marktbewertungshierarchie machen, in die die Bewertungen zum beizulegenden Zeitwert für Vermögenswerte und Verbindlichkeiten eingestuft werden. Die Angaben beruhen auf einer dreistufigen Marktbewertungshierarchie für die in Bewertungsverfahren zur Bemessung des beizulegenden Zeitwerts verwendeten Inputfaktoren.

Der beizulegende Zeitwert ist definiert als der Betrag, zu dem in einem Geschäft zwischen sachverständigen, vertragswilligen und unabhängigen Geschäftspartnern ein Vermögenswert ausgetauscht, eine Verbindlichkeit beglichen oder ein Eigenkapitalinstrument gewährt würde. Es sind getrennte Angaben zur Marktbewertungshierarchie für jede Hauptklasse von Aktiva und Passiva erforderlich, die die Bewertung zum Marktwert in Stufen teilt (Stufen 1, 2 und 3). Die für die Bewertung von Wertpapieren verwendeten Parameter bzw. der verwendete Ansatz liefern nicht unbedingt einen Hinweis auf das mit einer Anlage in diesen Wertpapieren verbundene Risiko. Die Stufen 1, 2 und 3 der Marktbewertungshierarchie sind wie folgt definiert:

- Stufe 1 – Quotierte Preise auf aktiven Märkten oder Börsen für identische Aktiva und Passiva.
- Stufe 2 – Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren. Hierzu können insbesondere quotierte Preise für ähnliche Vermögenswerte oder Verbindlichkeiten an Märkten, die aktiv sind, quotierte Preise für identische oder ähnliche Vermögenswerte und Verbindlichkeiten an Märkten, die nicht aktiv sind, andere Inputfaktoren als quotierte Preise, die für die Vermögenswerte und Verbindlichkeiten zu beobachten sind (wie zum Beispiel Zinssätze, Renditekuren, Volatilitäten, Tilgungsgeschwindigkeit, Verlustquoten, Kreditrisiken und Ausfallraten) oder andere bestätigte Inputfaktoren vom Markt zählen.
- Stufe 3 – Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren, die unter diesen Umständen auf bestmöglich verfügbaren Informationen beruhen, wenn beobachtbare Inputfaktoren nicht verfügbar sind, was zur Bestimmung des Marktwerts von Anlagen verwendete Annahmen des Verwaltungsrats oder anderer Personen, die nach seinem Ermessen handeln, einschließen kann.

(c) Bewertungstechniken und die Marktbewertungshierarchie

Die Bewertungsmethoden (bzw. „Bewertungstechniken“) und bedeutenden Parameter, die zur Bestimmung des beizulegenden Zeitwertes von Vermögenswerten von Finanzinstrumenten, die in die Ebene 1 und Ebene 2 der Zeitwerthierarchie eingestuft wurden, herangezogen werden, sind wie folgt:

Festverzinsliche Wertpapiere, einschließlich Unternehmens-, Wandel- und Kommunalanleihen und Schuldverschreibungen, Emissionen von US-Behörden, US-Treasury-Obligationen, Staatsanleihen, Bankdarlehen, wandelbare Vorzugsaktien und Nicht-US-Anleihen, werden normalerweise auf der Grundlage von Kursen von Brokern und Händlern oder anhand von Kursdiensten bewertet, die Wertpapierhändler-Kursen, berichtete Geschäftsabschlüsse oder Bewertungsschätzungen auf Basis ihrer internen Preismodelle verwenden. Die internen Modelle der Kursdienste nutzen beobachtbare Parameter wie Angaben zum Emittenten, Zinssätze, Renditekuren, Geschwindigkeiten der vorzeitigen Tilgung, Bonitätsrisiken/Bonitätsspreads, Ausfallquoten und notierte Preise für vergleichbare Vermögenswerte. Wertpapiere, die ähnliche Bewertungstechniken und Inputfaktoren wie zuvor beschrieben nutzen, werden in Stufe 2 der Marktbewertungshierarchie eingeordnet.

Rentenwerte, die auf Basis verzögerter Lieferung oder im Rahmen einer Rückkaufverpflichtung aus Rückkaufgeschäften erworben werden, werden täglich bis zur Abrechnung am Terminabrechnungsdatum bewertet und in Stufe 2 der Marktbewertungshierarchie eingeordnet.

Durch Hypotheken und Forderungen besicherte Wertpapiere werden bei jedem Handel gewöhnlich als einzelne Tranchen oder Klassen von Wertpapieren herausgegeben. Diese Wertpapiere werden ebenfalls normalerweise von Kursdiensten bewertet, die Broker-Dealer-Kursen oder Bewertungsschätzungen auf Basis ihrer internen Preismodelle verwenden. Die Kursbestimmungsmodelle für diese Wertpapiere berücksichtigen gewöhnlich Eigenschaften der Tranchenstufe, aktuelle Marktdaten, geschätzte Kapitalflüsse und marktbasierende Renditespreads für jede Tranche und Börsennebengeschäfte (je nach Verfügbarkeit). Durch Hypotheken und Forderungen besicherte Wertpapiere, die ähnliche Bewertungstechniken und Inputfaktoren wie zuvor beschrieben nutzen, werden in Stufe 2 der Marktbewertungshierarchie eingeordnet.

Stammaktien, ETFs, börsengehandelte Schuldverschreibungen und derivative Finanzinstrumente, wie Terminkontrakte, Rechte und Optionsscheine oder Optionen auf Futures, die an einer nationalen Wertpapierbörse gehandelt werden, werden zum letztberichteten Verkaufs- oder Abrechnungskurs am Bewertungstag angegeben. Wenn diese Wertpapiere aktiv gehandelt werden und keine Bewertungsanpassungen vorgenommen werden, werden sie in Stufe 1 der Marktbewertungshierarchie eingeordnet.

Bewertungsanpassungen können für bestimmte Wertpapiere durchgeführt werden, die ausschließlich an einer ausländischen Börse gehandelt werden, um die Marktbewegungen zwischen dem Schluss des ausländischen Marktes und dem Schluss der New York Stock Exchange („NYSE“) zu berücksichtigen. Diese Wertpapiere werden mithilfe von Kursdiensten bewertet, die den Zusammenhang von Handelsmustern des ausländischen Wertpapiers mit dem Intraday-Handel am US-Anlagemarkt berücksichtigen. Wertpapiere, die diese Bewertungsanpassungen nutzen, werden in Stufe 2 der Marktbewertungshierarchie eingeordnet. Vorzugswertpapiere und andere Aktien, die an inaktiven Märkten gehandelt oder durch Bezug auf ähnliche Instrumente bewertet werden, werden ebenfalls in Stufe 2 der Marktbewertungshierarchie eingeordnet.

Bei bestimmten börsengehandelten Futures und Optionen können Bewertungsanpassungen vorgenommen werden, um Marktbewegungen zwischen der Börsenabrechnung und dem Schluss der NYSE zu berücksichtigen. Diese Wertpapiere werden anhand von Kursen bewertet, die von einem Kursmeldesystem, etablierten Marketmakern oder Kursdiensten bereitgestellt werden. Finanzderivate, bei denen solche Bewertungsanpassungen vorgenommen werden, werden in Stufe 2 der Marktbewertungshierarchie eingeordnet.

Anlagen in eingetragenen offenen Investmentgesellschaften (außer ETFs) werden auf Grundlage des NIW dieser Anlagen bewertet, und sie werden in Stufe 1 der Bewertungshierarchie eingeordnet. Anlagen in nicht eingetragenen offenen Anlagegesellschaften werden auf Grundlage der NIWs dieser Anlagen bewertet und werden als Stufe 1 betrachtet, vorausgesetzt die NIWs sind beobachtbar, werden täglich berechnet und entsprechen dem Wert, zu dem sowohl Käufe als auch Verkäufe erfolgen.

Freiverkehrsfinanzderivate, wie zum Beispiel Devisenkontrakte, Optionskontrakte oder Swaps beziehen ihren Wert aus den Kursen der zugrunde liegenden Vermögenswerte, Indizes, Referenzsätze und anderen Inputfaktoren oder einer Kombination dieser Faktoren. Diese Kontrakte werden in aller Regel auf der Basis von Broker-Dealer-Kursen oder Kursdiensten bewertet. Abhängig vom Produkt und den Transaktionsbedingungen kann der Wert eines Derivatkontrakts von Kursdiensten mithilfe einer Reihe von Inputfaktoren aus aktiv handelnden Märkten bestimmt werden, darunter beispielsweise Emittenteninformationen, Indizes, Spreads, Zinssätze, Kurven, Dividenden und Wechselkurse. Derivate, die ähnliche Bewertungstechniken und Inputfaktoren wie zuvor beschrieben nutzen, werden in Stufe 2 der Marktbewertungshierarchie eingeordnet.

Börsengehandelte Aktienoptionen und außerbörslich gehandelte derivative Finanzinstrumente wie Devisenterminkontrakte und Optionskontrakte leiten ihren Wert von den Preisen der zugrunde liegenden Vermögenswerte, Indizes, Referenzsätzen und anderen Inputfaktoren oder einer Kombination dieser Faktoren ab. Diese Kontrakte werden in der Regel auf der Grundlage von Kursen bewertet, die von einem Kursmeldesystem, etablierten Marketmakern oder Kursdiensten stammen (normalerweise zum Handelsschluss der NYSE ermittelt). Abhängig vom Produkt und den Bedingungen der Transaktion können derivative Finanzinstrumente von Kursdiensten anhand einer Reihe von Techniken bewertet werden, einschließlich Simulationspreismodellen. Die Preismodelle verwenden Inputfaktoren, die an aktiv notierten Märkten beobachtet werden, wie zum Beispiel notierte Kurse, Emittentendaten, Indizes, Geld-/Briefspannen, Zinssätze, implizite Volatilitäten, Renditekurven, Dividenden und Wechselkurse. Finanzderivate, die ähnliche Bewertungstechniken und Inputfaktoren wie zuvor beschrieben nutzen, werden in Stufe 2 der Marktbewertungshierarchie eingeordnet.

Zentral abgerechnete Swaps, die über eine multilaterale- oder Handelsplattform (z. B. eine registrierte Börse) notiert oder gehandelt werden, werden zum von der betreffenden Börse bestimmten täglichen Abrechnungskurs bewertet. Für zentral abgerechnete Credit Default Swaps verlangt die Clearingstelle von ihren Mitgliedern verfolgbare Stufen während kompletter Laufzeitstrukturen. Diese Stufen werden gemeinsam mit den Preisen außenstehender Dritter zur Ermittlung täglicher Abrechnungskurse verwendet. Diese Wertpapiere werden in Stufe 2 der Marktbewertungshierarchie eingeordnet. Zentral abgerechnete Zinsswaps werden mithilfe eines Preismodells bewertet, das die zugrunde liegenden Zinssätze, einschließlich der Overnight Index Swap Rate und der LIBOR Forward Rate, berücksichtigt. Diese Wertpapiere werden in Stufe 2 der Marktbewertungshierarchie eingeordnet.

Handelsaktiva und -passiva der Stufe 3 zum Marktwert Wenn von PIMCO ein Marktbewertungsverfahren angewandt wird, das wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren einsetzt, werden Anlagen anhand eines Verfahrens bewertet, von dem der Verwaltungsrat oder von diesem angewiesene Personen annehmen, dass es den angemessenen Marktwert korrekt wiedergibt, und sie werden in Stufe 3 der Bewertungshierarchie eingeordnet. Die

Bewertungstechniken und wesentlichen Inputfaktoren, die verwendet werden, um den Marktwert von Anlagen der Fonds sowie von Finanzinstrumenten zu bestimmen, die in Stufe 3 der Marktbewertungshierarchie eingeordnet werden, gestalten sich folgendermaßen:

Indirekte Preisbestimmungsverfahren (Proxy Pricing) bestimmen den Basispreis eines festverzinslichen Wertpapiers und passen diesen dann proportional zu Marktwertänderungen eines vorab bestimmten Wertpapiers an, das in Bezug auf die Laufzeit als vergleichbar erachtet wird. In der Regel handelt es sich hierbei um eine US-Staatsanleihe oder einen auf dem Emissionsland beruhenden staatlichen Schuldtitel. Bei dem Basispreis kann es sich um einen von einem Wertpapierhändler-Kurs, einen Transaktionspreis oder einen anhand einer Analyse von Marktdaten ermittelten internen Wert handeln. Der Basispreis des Wertpapiers kann in regelmäßigen Abständen auf der Grundlage der Verfügbarkeit von Marktdaten und Verfahren, die vom PIMCO Valuation Oversight Committee (Ausschuss für die Bewertungsaufsicht) genehmigt wurden, neu festgesetzt werden. Erhebliche Änderungen der nicht beobachtbaren Inputfaktoren des Proxy-Pricing-Verfahrens (des Basispreises) würden zu direkten und proportionalen Änderungen des Marktwerts des Wertpapiers führen. Diese Wertpapiere werden in Stufe 3 der Marktbewertungshierarchie eingeordnet.

Wenn keine von Dritten bewerteten Preise verfügbar sind oder angenommen wird, dass diese den Marktwert nicht angemessen widerspiegeln, kann sich PIMCO dafür entscheiden, Broker-Kurse direkt vom Wertpapierhändler oder von einem Drittanbieter zu beziehen. Wenn der Marktwert auf einer einzelnen bezogenen Broker-Quotierung beruht, werden diese Wertpapiere in Stufe 3 der Marktbewertungshierarchie eingeordnet. Broker-Quotierungen werden in der Regel von etablierten Marktteilnehmern bezogen. Auch wenn sie unabhängig bezogen werden, verfügt PIMCO nicht über die erforderliche Transparenz, um die zugrunde liegenden Inputfaktoren, auf die sich der Marktkurs stützt, zu überprüfen. Erhebliche Änderungen der Broker-Quotierung hätten direkte und proportionale Änderungen am Marktwert des Wertpapiers zur Folge.

Die Bewertung auf Basis eines Referenzinstruments schätzt den Marktwert durch Verwendung der Korrelation des Wertpapiers zu einem oder mehreren breit angelegten Wertpapieren, Marktindizes und/oder anderen Finanzinstrumenten, deren Preisinformationen problemlos verfügbar sind. Zu den nicht beobachtbaren Inputfaktoren können diejenigen zählen, die in Algorithmenformeln verwendet werden, welche auf der prozentualen Änderung der Referenzinstrumente und/oder der Gewichtung der einzelnen Referenzinstrumente beruhen. Erhebliche Änderungen an den nicht beobachtbaren Inputfaktoren hätten direkte und proportionale Änderungen am Marktwert des Wertpapiers zur Folge. Diese Wertpapiere werden in Stufe 3 der Marktbewertungshierarchie eingeordnet.

Die Bewertung auf Basis einer fundamentalen Analyse schätzt den Marktwert durch Verwendung eines internen Modells, das die Abschlüsse des nicht börsennotierten zugrunde liegenden Unternehmens verwendet. Erhebliche Änderungen an den nicht beobachtbaren Inputfaktoren hätten direkte und proportionale Änderungen am Marktwert des Wertpapiers zur Folge. Diese Wertpapiere werden in Stufe 3 der Marktbewertungshierarchie eingeordnet.

Kurzfristige Schuldtitel (wie Commercial Paper) mit einer Restlaufzeit von 60 Tagen oder weniger können zu fortgeführten Anschaffungskosten bewertet werden, solange die fortgeführten Anschaffungskosten dieser kurzfristigen Schuldtitel annähernd dem ohne Anwendung der Methode der fortgeführten Anschaffungskosten ermittelten beizulegenden Zeitwert des Instruments entsprechen. Diese Wertpapiere werden je nach Quelle des Basispreises der Stufe 2 oder der Stufe 3 der Marktbewertungshierarchie zugewiesen.

4. WERTPAPIERE UND ANDERE ANLAGEN

(a) Barmittel

Barmittel werden zum Nennwert, gegebenenfalls zusätzlich aufgelaufener Zinsen, bewertet. Alle Bankguthaben werden entweder von State Street Bank and Trust Co. oder direkt bei einer Unterverwahrestelle gehalten.

(b) Anlagen in zentralen Fonds

Bestimmte Fonds dürfen im Zusammenhang mit ihren Aktivitäten zum Verwalten von Barmitteln auch im PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund anlegen, einem Teilfonds von PIMCO Select Funds plc. Die Hauptanlagen des PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund erfolgen in Geldmarktinstrumenten und Renteninstrumenten mit kurzer Laufzeit. Dem PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund können Aufwendungen entstehen, die im Zusammenhang mit seinen Anlageaktivitäten stehen. Die PIMCO-Fonds investieren jedoch nur in die Z Class, sodass keine Verwaltungsgebühren anfallen.

(c) Anlagen in Wertpapieren

Die Fonds können die nachfolgend beschriebenen Anlagen und Strategien verwenden, soweit dies gemäß der Anlagepolitik der Fonds zulässig ist.

Transaktionen mit verzögerter Lieferung Bestimmte Fonds dürfen Wertpapiere auf Basis verzögerter Lieferung erwerben oder verkaufen. Ein Fonds geht eine Verpflichtung in Bezug auf diese Transaktionen ein, Wertpapiere zu einem vorab bestimmten Preis oder einer vorab bestimmten Rendite bei Zahlung und Lieferung außerhalb des üblichen Abrechnungszeitraums zu erwerben oder zu verkaufen. Sind Geschäfte mit verzögerter Lieferung offen, bestimmt oder erhält der entsprechende Fonds in dem Umfang liquide Mittel als Sicherheit, die ausreicht, um den Kaufpreis zu begleichen oder die entsprechenden Verpflichtungen zu erfüllen. Beim Erwerb eines Wertpapiers auf Basis verzögerter Lieferung übernimmt der Fonds die Besitzrechte und -risiken des Wertpapiers, einschließlich des Kursrisikos und der Renditeschwankungen, und berücksichtigt diese Schwankungen bei der Bestimmung seines NIW. Ein Fonds kann nach Abschluss einer Transaktion auf Basis verzögerter Lieferung diese veräußern oder neu verhandeln, was zu einem Gewinn oder Verlust führen kann. Hat ein Fonds ein Wertpapier auf Basis verzögerter Lieferung verkauft, nimmt der Fonds nicht an den zukünftigen Gewinnen und Verlusten dieses Wertpapiers teil.

Börsengehandelte Fonds Bestimmte Fonds dürfen in börsengehandelte Fonds („ETFs“) anlegen, bei denen es sich im Allgemeinen um indexbasierte Investmentgesellschaften handelt, die im Wesentlichen ihr gesamtes Vermögen in Wertpapieren halten, die in ihrem spezifischen Index geführt werden, die jedoch auch aktiv verwaltete Investmentgesellschaften sein können. Anteile an ETFs werden während des ganzen Tages an einer Börse gehandelt und repräsentieren eine Anlage in einem Portfolio von Wertpapieren und Vermögenswerten. Als Anteilhaber einer anderen Investmentgesellschaft würde der Fonds seinen prozentualen Anteil an den Aufwendungen der anderen Investmentgesellschaften, einschließlich Beratungsgebühren, zusätzlich zu den Aufwendungen tragen, die dem Fonds direkt im Zusammenhang mit seiner eigenen Geschäftstätigkeit entstehen.

Inflationsindexierte Anleihen Bestimmte Fonds können in inflationsindexierte Anleihen investieren, bei denen es sich um festverzinsliche Wertpapiere handelt, deren Kapitalwert in regelmäßigen Abständen an die Inflationsrate angepasst wird. Die Zinssätze dieser Anleihen werden bei der Emission generell auf einen niedrigeren Satz als bei herkömmlichen Anleihen festgesetzt. Während der Laufzeit einer inflationsindexierten Anleihe werden jedoch Zinsen auf der Basis eines Kapitalwertes gezahlt, der inflationsbereinigt ist. Erhöhungen oder Verringerungen des Kapitalbetrags einer inflationsindexierten Anleihe sind als Zinseinkünfte in der Betriebsergebnisrechnung enthalten, obwohl Anleger ihren Kapitalbetrag nicht vor Fälligkeit erhalten. Die Rückzahlung des ursprünglichen Anleihekapsitals bei Fälligkeit (inflationsbereinigt) ist bei bestimmten inflationsindexierten Anleihen garantiert. Bei Anleihen, die keine vergleichbare Garantie bieten, kann der bereinigte Kapitalwert der bei Fälligkeit zurückgezahlten Anleihe geringer sein als das ursprüngliche Kapital.

Kreditbeteiligungen und -abtretungen Bestimmte Fonds können in direkte Schuldinstrumente anlegen, bei denen es sich um Beteiligungen an Beträgen handelt, die Kreditgebern oder Kreditkonsortien von Industrie-, Regierungs- oder sonstigen Darlehensnehmern geschuldet werden. Die Anlagen eines Fonds in Darlehen können in Form von Darlehensbeteiligungen oder -abtretungen in sämtliche oder einige Anteile eines Darlehens von Dritten erfolgen. Ein Darlehen wird oft von einer Bank oder einem sonstigen Finanzinstitut (der „Kreditgeber“) verwaltet, der als Vertreter für alle Beteiligten agiert. Der Vertreter verwaltet die Bedingungen des Darlehens gemäß den Vorgaben des Darlehensvertrags. Ein Fonds darf in mehrere Serien oder Tranchen eines Darlehens anlegen, die über unterschiedliche Bedingungen verfügen können und mit denen unterschiedliche Risiken verbunden sind. Erwirbt ein Fonds Abtretungen von Verleihern, erwirbt er direkte Rechte gegenüber dem Darlehensnehmer. Zu diesen Darlehen können Beteiligungen an „Überbrückungskrediten“ gehören. Hierbei handelt es sich um Kredite, die Kreditnehmer für einen kurzen Zeitraum (normalerweise unter einem Jahr) aufnehmen, bis eine auf lange Sicht ausgelegte Finanzierung beispielsweise durch die Ausgabe von Anleihen, häufig High-Yield-Anleihen, die für Akquisitionen emittiert werden, gesichert werden kann.

Zu den Arten von Darlehen und verbundenen Anlagen, in die ein Fonds investieren kann, zählen unter anderem vorrangige Darlehen, nachrangige Darlehen (einschließlich zweitrangiger Pfandrechte, B-Notes und Mezzanine-Darlehen), Whole Loans, gewerbliche Immobilien- und sonstige gewerbliche Darlehen und strukturierte Darlehen. Im Fall nachrangiger Darlehen können erhebliche Schulden vorliegen, die der Obligation des Schuldners gegenüber dem Inhaber eines solchen Darlehens vorrangig sind, unter anderem auch im Fall der Insolvenz des Schuldners. Mezzanine-Darlehen werden in der Regel durch eine Verpfändung einer Eigenkapitalbeteiligung am Hypothekendarlehensnehmer, dem die Immobilie gehört, und nicht durch eine Beteiligung an der Hypothek besichert.

Anlagen in Darlehen können ungedeckte Darlehenszusagen umfassen. Hierbei handelt es sich um vertragliche Finanzierungsverpflichtungen. Ungedeckte Darlehenszusagen können revolvingierende Kreditfazilitäten enthalten, die die Fonds verpflichten können, dem Darlehensnehmer auf Verlangen zusätzliche Barmittel zur Verfügung zu stellen. Ungedeckte Darlehenszusagen sind vollständige zukünftige Verpflichtungen, obwohl ein Prozentsatz der Nominaldarlehensbeträge vom Darlehensnehmer niemals ausgeschöpft wird. Bei Anlagen in Darlehensbeteiligungen verfügt ein Fonds über das Recht auf den Erhalt von Kapitalzahlungen, Zinsen und Gebühren, auf die er ein Anrecht hat, und zwar ausschließlich gegenüber dem Kreditgeber, der die Darlehensvereinbarung veräußert, und ausschließlich bei Erhalt von

Zahlungen des Kreditnehmers an den Kreditgeber. Ein Fonds kann für den nicht ausgeschöpften Anteil des zugrunde liegenden Kreditlinienanteils eines variabel verzinslichen Kredits Bereitstellungsgebühren erhalten. Unter bestimmten Umständen kann ein Fonds im Fall einer vorzeitigen Tilgung eines variabel verzinslichen Kredits durch einen Kreditnehmer eine Vorfälligkeitsentschädigungsgebühr erhalten. Eingenommene/gezahlte Gebühren werden als Bestandteil der Zinserträge bzw. Zinsaufwendungen in der Betriebsergebnisrechnung erfasst.

Nicht finanzierte Kreditzusagen zum 31. Dezember 2022 und 31. Dezember 2021 werden in der Vermögensaufstellung als Verbindlichkeit unter Verbindlichkeiten für erworbene Investitionen ausgewiesen.

Hypothekarisch gedeckte und andere forderungsbesicherte Wertpapiere Bestimmte Fonds dürfen in hypothekarisch gedeckte und andere forderungsbesicherte Wertpapiere anlegen, die unmittelbar oder mittelbar die Beteiligung an Hypothekendarlehen auf Immobilien darstellen oder von diesen besichert und aus diesen zahlbar sind. Hypothekarisch gedeckte Wertpapiere basieren auf Pools von privaten und gewerblichen Hypothekendarlehen, einschließlich von Spar- und Darlehensinstituten, Hypothekenbanken, Geschäftsbanken und anderen Einrichtungen begebenen Hypothekendarlehen. Diese Wertpapiere leisten monatliche Zahlungen, die sowohl aus Zins- als auch Kapitalzahlungen bestehen. Die Zinsen können durch feste bzw. flexible Zinssätze festgelegt werden. Die Höhe der vorab geleisteten Zahlungen auf zugrunde liegende Hypotheken beeinflusst den Kurs und die Volatilität von hypothekarisch besicherten Wertpapieren und kann, verglichen mit den Antizipationen zum Kaufzeitpunkt, kürzere oder längere effektive Durationen des Wertpapiers zur Folge haben. Die US-Regierung garantiert, dass Kapital und Zinsen auf bestimmte hypothekarisch besicherte Wertpapiere rechtzeitig gezahlt werden. Von nichtstaatlichen Emittenten zusammengestellte und garantierte Pools, einschließlich staatsnaher Institute, können von unterschiedlich gearteten Versicherungen oder Garantien abgesichert sein. Es kann jedoch nicht zugesichert werden, dass private Versicherer oder Garantiegeber ihre Verpflichtungen aus den Versicherungspoliceen bzw. Garantievereinbarungen erfüllen können. Viele dieser Risiken der Anlage in hypothekarisch gedeckte Wertpapiere, die durch gewerbliche Hypothekendarlehen gesichert werden, spiegeln die Folgen der lokalen sowie der sonstigen Wirtschaftslage für die Immobilienmärkte, die Fähigkeit der Mieter, Mietzahlungen zu leisten, sowie die Fähigkeit einer Immobilie wider, Mieter zu interessieren und zu binden. Diese Wertpapiere können weniger liquide sein und eine höhere Kursvolatilität zeigen als andere Arten von hypothekarisch oder forderungsbesicherten Wertpapieren. Andere forderungsbesicherte Wertpapiere werden aus vielen Arten von Vermögenswerten geschaffen, darunter Autokredite, Forderungen aus Lieferungen und Leistungen wie Kreditkartenforderungen und Krankenhausforderungen, Home-Equity-Darlehen, Studentendarlehen, Bootsdarlehen, Darlehen für Wohnmobile, Darlehen für Freizeitfahrzeuge, Darlehen für Fertighäuser, Flugzeugleasing, Computerleasing und Konsortialkredite.

Collateralized Debt Obligations („CDOs“) umfassen so genannte besicherte Anleiheverbindlichkeiten (Collateralized Bond Obligations, „CBOs“), besicherte Darlehensverbindlichkeiten (Collateralized Loan Obligations, „CLOs“) sowie andere ähnlich strukturierte Wertpapiere. CBOs und CLOs sind Arten forderungsbesicherter Wertpapiere. Bei einem CBO handelt es sich um einen Fonds, der von einem diversifizierten Pool hoch riskanter Rentenpapiere mit einem Rating unterhalb von Investment Grade besichert ist. Ein CLO ist ein Fonds, der typischerweise durch einen Darlehenspool besichert ist, der unter anderem in- und ausländische vorrangige besicherte Darlehen, vorrangige, nicht besicherte Darlehen und nachrangige Unternehmensdarlehen, einschließlich Darlehen mit einem Rating unter Investment Grade oder vergleichbar Darlehen ohne Rating enthält. Die Risiken aus einer Anlage in einem CDO hängen größtenteils von der Art der als Sicherheit dienenden Wertpapiere und der Klasse des CDO ab, in die der Fonds anlegt. CBOs, CLOs und andere CDOs sind mit zusätzlichen Risiken verbunden, einschließlich insbesondere, (i) dass Ausschüttungen aus als Sicherheit dienenden Wertpapieren möglicherweise nicht ausreichen, um Zinsen oder sonstige Auszahlungen zu begleichen, (ii) die Qualität der Sicherheit im Wert nachgeben oder in Verzug geraten kann, (iii) dass der Fonds in CBOs, CLOs oder anderen CDOs anlegen kann, die nachrangig gegenüber anderen Klassen sind, und (iv) dass die komplexe Struktur des Wertpapiers zum Zeitpunkt der Anlage nicht vollständig verstanden wird und Konflikte mit dem Emittenten hervorrufen oder unerwartete Anlageergebnisse herbeiführen kann.

Collateralised Mortgage Obligations Collateralized Mortgage Obligations („CMOs“) sind Schuldtitel eines Rechtssubjekts, die von Whole Mortgage Loans oder privaten Hypothekendarlehen besichert und in Klassen gegliedert sind. CMOs sind in mehrere Klassen gegliedert, die oft als „Tranchen“ bezeichnet werden. Dabei wurde für jede Klasse eine andere Laufzeit festgelegt, und jede Klasse hat das Recht auf einen eigenen Kapital- und Zinszahlungsplan, einschließlich vorfristiger Rückzahlungen. CMOs und CMBS können weniger liquide sein und eine höhere Kursvolatilität zeigen als andere Arten von hypothekarisch oder forderungsbesicherten Wertpapieren.

Stripped Mortgage Backed Securities („SMBS“) sind derivative Hypothekendarlehen mit mehreren Klassen. SMBS gliedern sich gewöhnlich in zwei Klassen, die

Zins- und Kapitalausschüttungen aus einem Pool von Hypothekwerten in unterschiedlichen Verhältnissen erhalten. Im Extremfall erhält eine Klasse die gesamten Zinsen (die „IO“ [Interest-Only]-Klasse), während die andere Klasse die gesamten Kapitalzahlungen erhält (die „PO“ [Principal-Only]-Klasse). Für IOs erhaltene Zahlungen sind in den Zinseinkünften der Betriebsergebnisrechnung enthalten. Da bei Fälligkeit eines IO kaum oder kein Kapital anfällt, wird der Buchwert des Wertpapiers monatlich bis zur Fälligkeit angepasst. Diese Anpassungen sind in den Zinseinkünften der Betriebsergebnisrechnung enthalten. Für POs erhaltene Zahlungen werden als Herabsetzung der Kosten und der Parität der Wertpapiere behandelt.

Wertpapiere mit Sachausschüttungen Bestimmte Fonds dürfen in Wertpapiere mit Sachausschüttungen (Payment In-Kind Securities, „PIKs“) anlegen. PIKs gewähren dem Emittenten ggf. die Möglichkeit, zu jedem Zinszahlungsdatum Zinszahlungen entweder bar und/oder in zusätzlichen Schuldpapieren vorzunehmen. Diese zusätzlichen Schuldtitel haben in der Regel dieselben Bedingungen, einschließlich Fälligkeitstermine, Zinsen und verbundene Risiken, wie die ursprünglichen Anleihen. Die täglichen Marktkurse der Originalanleihen können angefallene Zinsen enthalten („Dirty Price“ [Kurs einschließlich Stückzinsen]). Diese sind als Bestandteil des zum Marktwert bewerteten Finanzvermögens aus übertragbaren Wertpapieren im Finanzstatus enthalten.

Emissionen von US-Regierungsbehörden oder staatlich geförderten Unternehmen Bestimmte Fonds dürfen in Wertpapieren von US-Regierungsbehörden oder staatlich geförderten Unternehmen anlegen. Wertpapiere von US-Regierungsbehörden sind Obligationen der US-Regierung, ihrer Behörden oder Organe und werden in bestimmten Fällen von diesen garantiert. Einige Wertpapiere der US-Regierung, wie zum Beispiel Schatztitel, Wechsel und Anleihen, sowie von der Government National Mortgage Association („GNMA“ oder „Ginnie Mae“) garantierte Wertpapiere, werden von der US-Regierung in vollem Umfang unterstützt; andere, wie zum Beispiel von Federal Home Loan Banks, sichern das Recht, dass der Emittent vom US Department of the Treasury (das „US Finanzministerium“) leihen darf, und andere, wie zum Beispiel von der Federal National Mortgage Association („FNMA“ oder „Fannie Mae“) werden dadurch gesichert, dass die US-Regierung nach eigenem Ermessen Obligationen der Behörde erwerben kann. Wertpapiere der US-Regierung können Nullkuponwertpapiere umfassen. Nullkuponwertpapiere schützen keine laufenden Zinsen aus. Für sie gelten höhere Risiken als für zinszahlende Wertpapiere.

Zu den regierungsnahen Garantiegebern (d. h. ohne Schutz der vollumfänglichen Unterstützung der US-Regierung) zählen die FNMA und die Federal Home Loan Mortgage Corporation („FHLMC“ oder „Freddie Mac“). Die FNMA ist eine staatlich geförderte Gesellschaft. Die FNMA erwirbt konventionelle (d. h. nicht von einer Regierungsbehörde versicherte oder garantierte) Immobilienhypotheken aus einem Verzeichnis zugelassener Verkäufer/Dienstleister. Zu diesen zählen staatlich und bundesstaatlich amtlich zugelassene Spar- und Darlehenskassen, Genossenschaftsbanken, Geschäftsbanken, Kreditgenossenschaften und Hypothekenbanken. Für von der FNMA begebene Durchlaufpapiere garantiert die FNMA die rechtzeitige Zahlung von Kapital und Zinsen. Sie genießen jedoch nicht die vollumfängliche Unterstützung der US-Regierung. Die FHLMC gibt Participation Certificates („PCs“) aus. Bei ihnen handelt es sich um Durchlaufpapiere. Jedes vertritt die ungeteilte Beteiligung an einem Pool von Wohnhypotheken. Die FHLMC garantiert die rechtzeitige Zahlung von Zinsen und den endgültigen Kapitalinzug. PCs genießen jedoch nicht die vollumfängliche Unterstützung der US-Regierung.

Im Juni 2019 begannen die FNMA und die FHLMC mit der von UMBS (Uniform Mortgage-Backed Securities) anstelle ihrer derzeitigen Angebote an TBA-fähigen Wertpapieren (die „Single Security Initiative“). Die Single Security Initiative zielt darauf ab, die Liquidität des TBA-Markts insgesamt zu unterstützen, und gleicht die Merkmale von FNMA- und FHLMC-Zertifikaten an. Welche Auswirkungen die Single Security Initiative auf den Markt für TBA und andere hypothekenbesicherte Wertpapiere haben wird, ist ungewiss.

Roll-Timing-Strategien können eingesetzt werden, wenn der Fonds versucht, den Ablauf oder die Fälligkeit einer Position wie etwa einer TBA-Transaktion (To Be Announced) auf einen Basiswert zu verlängern, indem er die Position vor ihrem Ablauf schließt und eine neue Position in Bezug auf denselben Basiswert eröffnet, die ein späteres Ablaufdatum hat. Ge- und verkaufte TBA-Wertpapiere werden im Finanzstatus jeweils als Vermögenswerte oder Verbindlichkeiten ausgewiesen.

Börsennotierte Immobilienfonds („REITs“) Manche Fonds können in REITs investieren. Dabei handelt es sich um gepoolte Anlagevehikel, die ertragbringende Immobilien besitzen und in der Regel auch betreiben. Wenn ein REIT bestimmte Anforderungen erfüllt, unter anderem, dass er im Wesentlichen seine gesamten steuerpflichtigen Erträge (außer Nettokapitalgewinnen) an die Anteilinhaber ausschüttet, ist er im Hinblick auf die an Anteilinhaber ausgeschütteten Erträge nicht steuerpflichtig. Von REITs erhaltene Ausschüttungen können als Ertrag, Kapitalgewinn oder Kapitalrückführung eingestuft werden. Eine Kapitalrückführung wird vom Fonds als Minderung der Kostenbasis seiner Anlage im REIT

erfasst. Für REITs fallen Verwaltungsgebühren und andere Aufwendungen an, sodass die Fonds, die in REITs investieren, ihren jeweiligen Anteil an den Kosten für den Betrieb der REITs tragen.

Beschränkt handelbare Wertpapiere Bestimmte Fonds dürfen in Wertpapiere anlegen, die rechtlichen oder vertraglichen Weiterverkaufseinschränkungen unterliegen und im Allgemeinen privat verkauft werden können, aber vor einem öffentlichen Verkauf registriert oder von einer solchen Registrierung befreit werden müssen. Privat platzierte Wertpapiere gelten allgemein als beschränkt handelbar. Der Verkauf von eingeschränkten Wertpapieren kann zeitaufwändige Verhandlungen sowie Aufwendungen beinhalten und der sofortige Verkauf zu einem akzeptablen Kurs kann schwierig zu erzielen sein. Zum 31. Dezember 2022 von den Fonds gehaltene beschränkt handelbare Wertpapiere werden in den Erläuterungen zur Aufstellung der Wertpapiieranlagen offengelegt.

Transaktionen mit Emissionstermin Bestimmte Fonds dürfen Wertpapiere „per Emissionstermin“ erwerben oder verkaufen. Diese Transaktionen finden unter Vorbehalt statt, da ein Wertpapier zwar bereits genehmigt wurde, jedoch noch nicht am Markt begeben wurde. Transaktionen zum Kauf oder Verkauf von Wertpapieren per Emissionstermin beinhalten die Zusage eines Fonds, diese Wertpapiere zu einem im Voraus festgelegten Preis oder einer im Voraus festgelegten Rendite zu kaufen oder zu verkaufen, wobei die Zahlung und die Lieferung außerhalb des üblichen Abrechnungszeitraums erfolgen. Ein Fonds darf Wertpapiere auf Basis „per Emission“ verkaufen, bevor diese ausgehändigt werden, was zu einem realisierten Kapitalgewinn oder -verlust führen kann.

Unbefristete Anleihen Bestimmte Fonds können in unbefristete Anleihen investieren. Dies sind festverzinsliche Wertpapiere ohne Fälligkeitstermin, die jedoch auf Dauer einen Kupon zahlen (ohne angegebenen End- oder Fälligkeitstermin). Im Gegensatz zu typischen festverzinslichen Wertpapieren besteht für unbefristete Anleihen keine Verpflichtung, das Kapital zurückzuzahlen. Die Kuponzahlungen sind hingegen verpflichtend. Während unbefristete Anleihen keinen Fälligkeitstermin aufweisen, können sie ein Kündigungsdatum haben, an dem die unbegrenzte Dauer wegfällt und der Emittent den erhaltenen Kapitalbetrag am angegebenen Kündigungstermin zurückzahlen kann. Außerdem kann eine unbefristete Anleihe zusätzliche Merkmale haben, beispielsweise Zinserhöhungen an regelmäßigen Terminen oder eine Erhöhung an einem vorab festgelegten Zeitpunkt in der Zukunft.

Optionsscheine sind Wertpapiere, die in der Regel zusammen mit einer Schuldverschreibung oder einem Vorzugstitel ausgegeben werden und dem Inhaber das Recht verleihen, eine anteilige Menge an Stammaktien zu einem bestimmten Preis zu kaufen. Optionsscheine haben normalerweise eine Laufzeit, die in Jahren gemessen wird, und berechtigen den Inhaber zum Kauf von Stammaktien eines Unternehmens zu einem Preis, der in der Regel über dem Marktpreis zum Zeitpunkt der Ausgabe des Optionsscheins liegt. Optionsscheine können mit höheren Risiken verbunden sein als bestimmte andere Arten von Anlagen. Im Allgemeinen berechnen Optionsscheine nicht zum Erhalt von Dividenden oder zur Ausübung von Stimmrechten in Bezug auf die zugrunde liegenden Wertpapiere, und sie stellen keine Rechte an den Vermögenswerten des Emittenten dar. Außerdem ändert sich ihr Wert nicht unbedingt mit dem Wert der zugrunde liegenden Wertpapiere, und sie verlieren ihren Wert, wenn sie nicht an oder vor ihrem Ablaufdatum ausgeübt werden. Übersteigt der Kurs der zugrunde liegenden Aktie während der Laufzeit des Optionsscheins nicht den Ausübungspreis, verfällt der Optionsschein wertlos. Optionsscheine können den potenziellen Gewinn oder Verlust aus der Anlage im Vergleich zu einer Anlage desselben Betrags in den zugrunde liegenden Wertpapieren erhöhen. Ebenso kann der prozentuale Anstieg oder Rückgang des Wertes eines Aktienoptionsscheins größer sein als der prozentuale Anstieg oder Rückgang des Wertes der zugrunde liegenden Stammaktie. Optionsscheine können sich auf den Kauf von Aktien oder Schuldtiteln beziehen. Schuldverschreibungen, denen Optionsscheine zum Erwerb von Aktien beigefügt sind, weisen viele Merkmale von wandelbaren Wertpapieren auf, und ihre Preise können zu einem gewissen Grad die Wertentwicklung der zugrunde liegenden Aktie widerspiegeln. Schuldverschreibungen können auch mit beigefügten Optionsscheinen ausgegeben werden, die zum Kauf weiterer Schuldverschreibungen zum gleichen Zinssatz berechtigen. Ein Rückgang der Zinssätze würde es dem Portfolio ermöglichen, solche Optionsscheine mit Gewinn zu verkaufen. Bei einem Anstieg der Zinsen verfallen diese Optionsscheine im Allgemeinen wertlos.

5. KREDITE UND ANDERE FINANZIERUNGSTRANSAKTIONEN

Die Fonds dürfen die nachfolgend beschriebenen Kredite und Finanzierungstransaktionen abschließen, sofern dies gemäß der Anlagepolitik des jeweiligen Fonds zulässig ist.

Die folgenden Angaben enthalten Informationen zur Fähigkeit der Fonds, Barmittel oder Wertpapiere gemäß den maßgeblichen Verordnungen der Zentralbank

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)

und dem Prospekt zu verleihen oder zu leihen, soweit dies gemäß ihren Anlagezielen und ihrer Anlagepolitik zulässig ist, sowie vorbehaltlich der von der Zentralbank jeweils festgelegten Grenzen und der Bestimmungen des Prospekts. Diese können als Kredite oder Finanzierungstransaktionen der Fonds betrachtet werden. Nachfolgend ist beschrieben, wo diese Instrumente in den Abschlüssen der Fonds zu finden sind.

(a) Pensionsgeschäfte

Bestimmte Fonds dürfen Pensionsgeschäfte eingehen. Bei einem typischen Pensionsgeschäft nimmt der Fonds einen Basisschuldtitle (Sicherheit) vorbehaltlich der Verpflichtung des Verkäufers zum Rückkauf und des Fonds zum Weiterverkauf der Verbindlichkeit zu einem vereinbarten Preis und Zeitpunkt in Besitz. Bei einem Pensionsgeschäft mit offener Fälligkeit gibt es kein im Voraus festgelegtes Rückkaufdatum, und die Vereinbarung kann vom Fonds oder vom Kontrahenten jederzeit gekündigt werden. Die zugrunde liegenden Wertpapiere für alle Pensionsgeschäfte werden von der Verwahrstelle eines Fonds oder von benannten Unterverwahrstellen im Rahmen von Drei-Parteien-Pensionsgeschäften gehalten und bleiben in bestimmten Fällen unter Verwahrung des Kontrahenten. Der Marktwert der Sicherheit muss jederzeit dem Gesamtbetrag der Rückkaufverbindlichkeiten einschließlich Zinsen entsprechen oder höher sein als dieser Gesamtbetrag. Pensionsgeschäfte, einschließlich angefallener Zinsen, sind im Finanzstatus enthalten. Zinseinkünfte werden in der Betriebsergebnisrechnung als Bestandteil der Zinserträge erfasst. In Zeiträumen mit erhöhtem Bedarf an Sicherheiten muss ein Fonds eventuell eine Gebühr für den Erhalt von Sicherheiten bezahlen, was zu Zinsaufwendungen für den Fonds führen kann.

(b) Umgekehrte Pensionsgeschäfte

Bestimmte Fonds dürfen umgekehrte Pensionsgeschäfte eingehen. Bei einem umgekehrten Pensionsgeschäft übergibt ein Fonds einem Finanzinstitut, dem Kontrahenten, ein Wertpapier im Gegenzug für Barmittel, mit einer gleichzeitigen Vereinbarung zum Rückkauf desselben oder im Wesentlichen desselben Wertpapiers zu einem vereinbarten Preis und Datum. Bei einem umgekehrten Pensionsgeschäft mit offener Fälligkeit gibt es kein im Voraus festgelegtes Rückkaufdatum, und die Vereinbarung kann vom Fonds oder des Kontrahenten jederzeit gekündigt werden. Der Fonds ist zum Erhalt etwaiger Kapital- und Zinszahlungen berechtigt, die auf das Wertpapier, das an den Kontrahenten während der Laufzeit der Vereinbarung geliefert wurde, vorgenommen wurden. Barmittel, die für gelieferte Wertpapiere ausbezahlt wurden, zusätzlich aufgelaufener Zinszahlungen, die von einem Fonds an Kontrahenten vorzunehmen sind, werden im Finanzstatus als Verbindlichkeit ausgewiesen. Vom Fonds an Kontrahenten vorgenommene Zinszahlungen werden in der Betriebsergebnisrechnung als Bestandteil der Zinsaufwendungen erfasst. In Zeiträumen mit erhöhtem Bedarf an Sicherheiten kann ein Fonds eventuell eine Gebühr für den Einsatz des Wertpapiers durch den Kontrahenten erhalten, was zu Zinseinkünften für den Fonds führen kann. Ein Fonds stellt von den Anlageberatungsgesellschaften oder anderweitig für liquide erklärte Vermögenswerte zurück, die dazu bestimmt sind, die Verpflichtung aus einem umgekehrten Pensionsgeschäft zu erfüllen.

(c) Leerverkäufe

Bestimmte Fonds dürfen Leerverkaufs-Transaktionen tätigen. Ein Leerverkauf ist eine Transaktion, bei der ein Fonds Wertpapiere, die nicht in seinem Besitz sind, im Vorgriff auf einen Rückgang des beizulegenden Zeitwerts der Wertpapiere verkaufen kann. In einem Leerverkauf veräußerte Wertpapiere und gegebenenfalls auf diese zahlbare Zinsen werden im Finanzstatus als Verbindlichkeit wiedergegeben. Ein Fonds ist verpflichtet, die Wertpapiere zum Zeitpunkt der Glattstellung der Short Position zum Handelspreis zu liefern. Die möglichen Verluste aus einem Leerverkauf können unbegrenzt sein, während Verluste aus Käufen die Höhe des angelegten Gesamtbetrages nicht übersteigen können.

(d) Sale-Buybacks

Bestimmte Fonds können Finanzierungsgeschäfte eingehen, die als „Sale-Buybacks“ (Verkäufe-Rückkäufe) bezeichnet werden. Ein Sale-Buyback-Geschäft (Rückkauf-Finanzierung) besteht aus dem Verkauf eines Wertpapiers durch einen Fonds an ein Finanzinstitut, den Kontrahenten, mit einer gleichzeitigen Vereinbarung zum Rückkauf desselben oder im Wesentlichen desselben Wertpapiers zu einem vereinbarten Preis und an einem vereinbarten Datum. Ein Fonds ist nicht zum Erhalt von Kapital- und Zinszahlungen berechtigt, die auf das Wertpapier, das an den Kontrahenten während der Laufzeit der Vereinbarung verkauft wurde, vorgenommen wurden. Die vereinbarten Erlöse für Wertpapiere, die von einem Fonds zurückzukaufen sind, werden im Finanzstatus als Verbindlichkeit ausgewiesen. Ein Fonds weist Nettoerträge aufgrund eines Preisunterschieds zwischen dem für das übertragene Wertpapier erhaltenen Preis und dem vereinbarten Rückkaufpreis aus. Dies wird allgemein als Preisrückgang bezeichnet. Ein Preisrückgang besteht aus (i) den entfallenen etwaigen Zins- und inflationären Ertragsberichtigungen, die ein Fonds ansonsten erhalten hätte, wenn das Wertpapier nicht verkauft worden wäre, und (ii) den zwischen einem Fonds und dem Kontrahenten vereinbarten Finanzierungsbedingungen. Die etwaigen entfallenen Zins- und inflationären Ertragsberichtigungen werden in der Betriebsergebnisrechnung als Bestandteile des Zinsertrags ausgewiesen. Von einem Fonds an Kontrahenten aufgrund von ausgehandelten Finanzierungsbedingungen vorgenommene Zinszahlungen werden in der Betriebsergebnisrechnung als Bestandteil der Zinsaufwendungen erfasst. In Zeiträumen mit erhöhtem Bedarf an Sicherheiten kann ein Fonds eventuell eine Gebühr für den Einsatz des

Wertpapiers durch den Kontrahenten erhalten, was zu Zinseinkünften für den Fonds führen kann. Ein Fonds stellt von den Anlageberatungsgesellschaften oder anderweitig für liquide erklärte Vermögenswerte zurück, die dazu bestimmt sind, die Verpflichtung aus Sale-Buyback-Geschäften zu erfüllen.

6. FINANZDERIVATE

Die folgenden Offenlegungen enthalten Informationen darüber, wie und warum die Fonds Finanzderivate einsetzen, und wie Finanzderivate die finanzielle Lage, das Ergebnis der Geschäftstätigkeit und die Kapitalflüsse der Fonds beeinflussen. Die zum Ende des Geschäftsjahres ausstehenden Finanzderivate, wie sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen erfasst werden, und die Beträge der realisierten und die Veränderungen der nicht realisierten Gewinne und Verluste aus Finanzderivaten während des Geschäftsjahres, wie sie in der Betriebsergebnisrechnung erfasst werden, dienen als Indikatoren für den Umfang der Finanzderivataktivitäten für die Fonds.

(a) Devisenterminkontrakte

Bestimmte Fonds dürfen Devisenterminkontrakte in Verbindung mit der Abrechnung geplanter Käufe oder Verkäufe von Wertpapieren eingehen, um Währungsrisiken in Verbindung mit einigen oder allen Fondswertpapieren abzusichern oder als Teil der Anlagestrategie. Ein Devisenterminkontrakt ist ein Vertrag zwischen zwei Parteien über den Kauf und Verkauf einer Währung zu einem bestimmten Kurs zu einem zukünftigen Zeitpunkt. Der Marktwert eines Devisenterminkontrakts schwankt mit den Änderungen der Wechselkurse. Devisenterminkontrakte werden täglich zum letzten Börsenkurs bewertet, und die Wertänderung wird vom Fonds als nicht realisierter Gewinn oder Verlust erfasst. Realisierte Gewinne oder Verluste entsprechen dem Unterschied zwischen dem Wert des Kontrakts zum Zeitpunkt seiner Eröffnung und dem Wert zum Zeitpunkt seiner Schließung und werden mit Lieferung oder Erhalt der Währung erfasst. Diese Kontrakte können mit Marktrisiken verbunden sein, die über den nicht realisierten Gewinn oder Verlust hinausgehen, die im Finanzstatus wiedergegeben werden. Zusätzlich kann ein Fonds Risiken ausgesetzt sein, wenn die Kontrahenten nicht in der Lage sind, die Vertragsbedingungen zu erfüllen, oder wenn sich der Wert der Währung gegenüber der Funktionswährung nachteilig ändert. Um dieses Risiko zu vermindern, können Barmittel oder Wertpapiere gemäß den Bestimmungen der zugrunde liegenden Verträge als Sicherheiten ausgetauscht werden.

Bestimmte Fonds verfügen über eine abgesicherte Klasse, die Devisenterminkontrakte eingeht, die dazu bestimmt sind, den Absicherungseffekt auf Fondsebene glattzustellen, damit sich die abgesicherten Klassen weiter an anderen Währungen als der Funktionswährung beteiligen kann. Es kann nicht garantiert werden, dass diese klassenspezifischen Devisenterminkontrakte erfolgreich sein werden.

Bei Absicherungen auf Klassenebene werden die realisierten und nicht realisierten Gewinne oder Verluste ausschließlich den betreffenden Anteilsklassen zugeordnet. Die nicht realisierten Gewinne oder Verluste sind als Bestandteil der Finanzderivate im Finanzstatus ausgewiesen. Im Zusammenhang mit diesen Verträgen können Wertpapiere in Übereinstimmung mit den Bedingungen der jeweiligen Verträge zu Sicherheiten bestimmt werden.

(b) Terminkontrakte

Bestimmte Fonds dürfen Terminkontrakte abschließen. Ein Fonds kann Terminkontrakte verwenden, um sein Risiko an den Wertpapiermärkten oder gegenüber Schwankungen der Zinssätze und Währungskurse zu verwalten. Die Hauptrisiken in Verbindung mit dem Einsatz von Terminkontrakten sind die unvollständige Korrelation zwischen der Veränderung des Marktwertes der von einem Fonds gehaltenen Wertpapiere und den Preisen von Terminkontrakten sowie die Möglichkeit eines illiquiden Marktes. Terminkontrakte werden auf der Basis ihrer täglich festgestellten Abrechnungskurse bewertet. Beim Abschluss eines Terminkontrakts muss ein Fonds bei seinem Terminhändler einen Geldbetrag oder US-Regierungs- und Behördenanleihen oder ausgewählte Staatsanleihen in Übereinstimmung mit den ursprünglichen erforderlichen Einschüssen des Händlers oder der Börse hinterlegen. Terminkontrakte werden täglich zum letzten Börsenkurs bewertet, und auf Basis dieser Bewegungen der Preise der Kontrakte kann der Fonds eine entsprechende Forderung oder Verbindlichkeit für die Wertänderung stellen bzw. einziehen („Marge für Finanzderivate“). Gewinne oder Verluste werden erfasst, gelten jedoch nicht als realisiert, bis die Kontrakte auslaufen oder glattgestellt werden. Terminkontrakte beinhalten in unterschiedlichem Maße Verlustrisiken, die über die im Finanzstatus ausgewiesene Marge für Finanzderivate hinausgehen.

(c) Terminkontrakte

Bestimmte Fonds können Optionen verkaufen oder kaufen, um Einkommen zu erzielen oder um eine vorhandene Position oder zukünftige Anlage abzusichern. Ein Fonds darf Kauf- und Verkaufsoptionen auf Wertpapiere und derivative Finanzinstrumente verkaufen, die sich in seinem Besitz befinden oder in die er anlegen darf. Durch den Verkauf von Verkaufsoptionen erhöht sich tendenziell das Engagement eines Fonds im Basiswert. Durch den Verkauf von

Kaufoptionen verringert sich tendenziell das Engagement eines Fonds im Basiswert. Veräußert ein Fonds eine Kauf- oder Verkaufsoption, dann erfasst er einen Betrag, der der erhaltenen Prämie entspricht, als Verbindlichkeit und bewertet diese zum letzten Börsenkurs, um den aktuellen Wert der verkauften Option wiederzugeben. Diese Verbindlichkeiten sind im Finanzstatus enthalten. Erhaltene Prämien aus dem Verkauf von Optionen, die auslaufen, werden als realisierte Gewinne erfasst. Erhaltene Prämien aus dem Verkauf von Optionen, die ausgeübt oder glattgestellt werden, werden den Erlösen hinzuzurechnet oder gegen die aus den zugrunde liegenden Futures, Swaps, Wertpapiere oder Währungstransaktionen gezahlten Beträge aufgerechnet, um den realisierten Gewinn oder Verlust zu ermitteln. Bestimmte Optionen können mit Prämien verkauft werden, die zu einem zukünftigen Termin festgelegt werden. Die Prämien für diese Optionen basieren auf impliziten Volatilitätsparametern unter bestimmten Bedingungen. Ein Fonds, der eine Option veräußert, hat keine Kontrolle darüber, ob das Basisinstrument verkauft („Call“) oder gekauft („Put“) wird, und im Ergebnis trägt er das Marktrisiko einer ungünstigen Kursänderung des Instruments, das der verkauften Option zugrunde liegt. Es besteht das Risiko, dass sich der Fonds aufgrund eines illiquiden Marktes eventuell nicht in der Lage sieht, die Transaktion glattzustellen.

Ein Fonds darf ebenfalls Verkaufs- und Kauf-Optionen erwerben. Der Kauf von Verkaufsoptionen neigt dazu, das Fondsrisiko gegenüber den zugrunde liegenden Instrumenten zu erhöhen. Der Kauf von Kaufoptionen neigt dazu, das Fondsrisiko gegenüber den zugrunde liegenden Instrumenten zu senken. Ein Fonds zahlt eine Prämie, die ergebniswirksam zum Marktwert als Finanzvermögen in den Finanzstatus einfließt, und später neu bewertet wird, um den aktuellen Wert der Option wiederzugeben. Gezahlte Prämien für den Kauf von Optionen, die auslaufen, werden als realisierte Verluste verbucht. Bestimmte Optionen können mit Prämien gekauft werden, die zu einem zukünftigen Termin festgelegt werden. Die Prämien für diese Optionen basieren auf impliziten Volatilitätsparametern unter bestimmten Bedingungen. Das mit dem Kauf von Verkaufs- und Kaufoptionen verbundene Risiko beschränkt sich auf die gezahlte Prämie. Gezahlte Prämien aus dem Kauf von Optionen, die ausgeübt oder glattgestellt werden, sind den gezahlten Beträgen hinzuzufügen oder gegen die Erlöse aus dem Basisanlagegeschäft aufzurechnen, um den realisierten Gewinn oder Verlust bei Ausführung der zugrunde liegenden Transaktion zu bestimmen.

Credit Default Swaptions Bestimmte Fonds können Credit Default Swaptions kaufen oder verkaufen, um eine Absicherung des Kreditrisikos einer Anlage zu erreichen, ohne sich dem Basiswert gegenüber zu verpflichten. Eine Credit Default Swaption ist eine Option zum Verkauf oder Kauf von Kreditrisiko für einen bestimmten Referenzwert durch Abschluss eines vordefinierten Swaps zu einem bestimmten zukünftigen Zeitpunkt.

Devisenoptionen Bestimmte Fonds können Devisenoptionen verkaufen oder kaufen. Durch den Verkauf oder Kauf von Devisenoptionen erhält ein Fonds das Recht, ist jedoch nicht verpflichtet, die festgelegten Devisenbeträge zu einem Wechselkurs zu kaufen oder zu verkaufen, der zu einem bestimmten Datum geltend gemacht werden kann. Diese Optionen können als Kauf- oder Verkaufsdeckungsgeschäft gegen mögliche Schwankungen der Wechselkurse oder zum Aufbau eines Engagements in Devisen dienen.

Inflation-Capped Options Bestimmte Fonds können Inflation-Capped Options kaufen oder verkaufen, um die Renditen zum Zwecke von Absicherungsmöglichkeiten zu erhöhen. Veräußert ein Fonds eine Inflation-Capped Option, dann erfasst er einen Betrag, der der erhaltenen Prämie entspricht, als Verbindlichkeit und bewertet diese zum letzten Börsenkurs, um den aktuellen Wert der verkauften Option wiederzugeben. Kauft ein Fonds eine Inflation-Capped Option, bezahlt der Fonds eine Prämie, die als Vermögenswert ausgewiesen und dann zum letzten Börsenkurs bewertet wird, um den aktuellen Wert der Option wiederzugeben. Der Kauf von Inflation-Capped Options soll einen Fonds vor Inflationserosion über einem bestimmten Satz aus einer bestimmten angenommenen Beteiligung schützen. Zum Schutz von Anlagen in inflationsgekoppelten Produkten kann eine Untergrenze (Floor) verwendet werden.

Interest Rate-Capped Options Bestimmte Fonds können Interest Rate-Capped Options kaufen oder verkaufen, um die Renditen zum Zwecke von Absicherungsmöglichkeiten zu erhöhen. Veräußert ein Fonds eine Interest Rate-Capped Option, dann erfasst er einen Betrag, der der erhaltenen Prämie entspricht, als Verbindlichkeit und bewertet diese zum letzten Börsenkurs, um den aktuellen Wert der verkauften Option wiederzugeben. Kauft ein Fonds eine Interest Rate-Capped Option, bezahlt der Fonds eine Prämie, die als Vermögenswert ausgewiesen und dann zum letzten Börsenkurs bewertet wird, um den aktuellen Wert der Option wiederzugeben. Der Kauf von Interest Rate-Capped Options soll einen Fonds vor dem Risiko variabler Zinssätze oberhalb eines bestimmten Satzes aus einer bestimmten angenommenen Beteiligung schützen. Zum Schutz von Anlagen in zinsgekoppelten Produkten kann eine Untergrenze (Floor) verwendet werden.

Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte Bestimmte Fonds können Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte („Futures Option“) kaufen oder verkaufen, um eine vorhandene Position oder künftige Investments abzusichern, zu Spekulationszwecken oder zur

Verwaltung des Risikos im Zusammenhang mit Marktschwankungen. Eine Futures Option ist ein Optionskontrakt, dessen Basiswert ein einziger Futures-Kontrakt ist.

Optionen auf Rohstoffterminkontrakte Bestimmte Fonds können Optionen auf Rohstoffterminkontrakte („Rohstoffoptionen“) verkaufen oder kaufen. Der Basiswert für die Rohstoffoption ist nicht der Rohstoff selbst, sondern vielmehr ein Terminkontrakt auf den Rohstoff. Zur Ausübung einer Rohstoffoption gehört nicht die tatsächliche Lieferung des zugrunde liegenden Rohstoffs, sondern vielmehr die Zahlung des Differenzbetrags zwischen dem aktuellen Marktwert des zugrunde liegenden Futures Contract und dem Ausübungskurs direkt auf das Verwahrstellenkonto eines Fonds. Bei Optionen, die „im Geld“ sind, wird ein Fonds normalerweise die Position ausgleichen, anstatt die Option auszuüben, um den Restzeitwert zu wahren.

Barriere-Optionen Bestimmte Fonds können eine Vielzahl von Optionen mit nicht standardmäßigen Auszahlungsstrukturen oder anderen Merkmalen („Barriere-Optionen“) verkaufen oder kaufen. Barriere-Optionen werden allgemein außerbörslich gehandelt. Ein Fonds kann in verschiedene Arten von Barriere-Optionen investieren, unter anderem auch in Down-and-in- sowie in Up-and-in-Optionen. Down-and-in- und Up-and-in-Optionen sind standardmäßigen Optionen ähnlich. Der wesentliche Unterschied besteht darin, dass die Option für den Käufer der Option wertlos ausläuft, wenn der Kurs des zugrunde liegenden Instruments vor dem Ablaufdatum der Option einen bestimmten Barriere-Kurs erreicht bzw. nicht erreicht.

Zinsswaptions Bestimmte Fonds können Zinsswaptions eingehen, wobei es sich um Optionen zum Abschluss vordefinierter Swap-Vereinbarungen zu einem bestimmten zukünftigen Zeitpunkt handelt. Der Verkäufer der Swaption wird bei Ausübung durch die Käufer zum Kontrahenten des Swaps. Aus der Zinsswaption geht hervor, ob der Käufer der Swaption bei Ausübung ein Empfänger eines festen Zinssatzes ist oder einen festen Zinssatz bezahlt.

(c) Optionen auf Wertpapiere Bestimmte Fonds können Optionen auf Wertpapiere verkaufen oder kaufen, um Renditen zu erhöhen oder um eine vorhandene Position oder zukünftige Anlage abzusichern. Eine Option auf ein Wertpapier verwendet ein angegebenes Wertpapier als Basiswert für den Optionskontrakt.

Straddle-Optionen Bestimmte Fonds können verschiedene Formen von Straddle-Optionen („Straddle“) verwenden. Bei einem Straddle handelt es sich um eine Anlagestrategie, die Kombinationen aus Optionen einsetzt, die es dem Fonds ermöglichen, auf der Basis zukünftiger Preisschwankungen (nach oben oder unten) des zugrunde liegenden Wertpapiers zu profitieren. Ein verkaufter Straddle umfasst den gleichzeitigen Verkauf einer Kaufoption und einer Verkaufsoption auf dasselbe Wertpapier zum selben Ausübungskurs und mit demselben Verfallsdatum. Der verkaufte Straddle erhöht sich im Wert, wenn der Preis des Basiswerts vor dem Verfallsdatum nur geringfügig schwankt. Ein gekaufter Straddle umfasst den gleichzeitigen Kauf einer Kaufoption und einer Verkaufsoption auf dasselbe Wertpapier zum selben Ausübungskurs und mit demselben Verfallsdatum. Der gekaufte Straddle erhöht sich im Wert, wenn der Preis des Basiswerts ungeachtet der Richtung vor dem Verfallsdatum stark schwankt.

(d) Swaps

Bestimmte Fonds dürfen in Swaps anlegen. Swaps sind bilateral verhandelte Vereinbarungen zwischen einem Fonds und einem Kontrahenten, um Anlagekapitalflüsse, Vermögenswerte, Devisen oder marktgebundene Erträge zu bestimmen, zukünftigen Intervallen zu wechseln oder zu tauschen. Swap-Vereinbarungen werden privat im Freiverkehr ausgehandelt („OTC-Swaps“) oder können über eine dritte Partei, die als zentraler Kontrahent oder Clearingorganisation für Derivate bezeichnet wird, abgerechnet werden („zentral abgerechnete Swaps“). Ein Fonds darf Asset-Swaps, Credit Default Swaps, Cross Currency Swaps, Zinsswaps, Total Return Swaps, Variance Swaps sowie andere Arten von Swaps eingehen, um sein Kredit-, Währungs-, Zins-, Rohstoff-, Aktien- und Inflationsrisiko zu verwalten. In Verbindung mit diesen Vereinbarungen können Wertpapiere oder Barmittel in Übereinstimmung mit den Bedingungen des jeweiligen Swaps zu Sicherheiten oder Hinterlegungssummen bestimmt werden, um bei Säumnis oder Insolvenz/Zahlungsunfähigkeit auf werthaltige Vermögenswerte zurückgreifen zu können.

Zentral abgerechnete Swaps werden täglich an den Marktwert angepasst. Hierbei werden Bewertungen angesetzt, die gemäß dem zugrunde liegenden Kontrakt oder gemäß den Anforderungen des zentralen Kontrahenten bzw. der Clearingorganisation für Derivate ermittelt werden. Änderungen des Marktwerts werden, falls vorhanden, in der Betriebsergebnisrechnung als Nettoänderung der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) erfasst. Tägliche Änderungen bei der Bewertung zentral abgerechneter Swaps („Swap Variation Margin“), falls vorhanden, werden im Finanzstatus als Forderung oder Verbindlichkeit aus Wertänderungen ausgewiesen. Zu Beginn des Berichtszeitraums geleistete oder erhaltene Zahlungen aus OTC-Swaps werden als solche in der Vermögensaufstellung ausgewiesen und repräsentieren Prämien, die bei Abschluss des Swaps als Ausgleich für Differenzen zwischen den vereinbarten

Bedingungen des Swaps und den vorherrschenden Marktbedingungen (Kreditspreads, Wechselkurse, Zinssätze und andere relevante Faktoren) gezahlt oder vereinnahmt wurden. Erhaltene (gezahlte) Abschlussprämien werden anfänglich als Verbindlichkeiten (Vermögenswerte) verbucht und anschließend zum letzten Börsenkurs bewertet, um den aktuellen Wert des Swaps wiederzugeben. Diese Abschlussprämien werden bei Beendigung oder Fälligkeit des Swaps in der Betriebsergebnisrechnung als realisierte Gewinne oder Verluste ausgewiesen. Bei Beendigung eines Swaps erhaltene oder geleistete Liquidierungszahlungen werden in der Betriebsergebnisrechnung als realisierter Gewinn oder Verlust erfasst. Vom Fonds regelmäßige erhaltene oder geleistete Nettozahlungen werden als Teil der realisierten Gewinne oder Verluste in die Betriebsergebnisrechnung einbezogen.

Zur Anwendung bestimmter Anlagerichtlinien und -beschränkungen des Fonds können Swaps wie andere derivative Instrumente vom Fonds zum Marktwert, zum Nennwert oder zum vollständigen Engagementwert bewertet werden. Im Fall eines Credit Default Swap (siehe unten) bewertet der Fonds den Credit Default Swap jedoch bei der Anwendung bestimmter Anlagerichtlinien und -beschränkungen des Fonds zum Nennwert bzw. zum vollständigen Engagementwert (d. h. mit der Summe aus dem Nennbetrag für den Kontrakt und dem Marktwert). Für die Anwendung bestimmter sonstiger Anlagerichtlinien und -beschränkungen des Fonds kann er den Credit Default Swap jedoch zum Marktwert bewerten. So kann ein Fonds Credit Default Swaps beispielsweise für Zwecke seiner (gegebenenfalls geltenden) Richtlinien hinsichtlich der Kreditqualität zum vollständigen Engagementwert bewerten, da dieser Wert das tatsächliche wirtschaftliche Engagement des Fonds während der Laufzeit des Credit Default Swaps darstellt. In diesem Zusammenhang können sowohl der Nennbetrag als auch der Marktwert positiv oder negativ sein - je nachdem, ob der Fonds Schutz über den Credit Default Swap verkauft oder kauft. Die Art und Weise, in der bestimmte Wertpapiere oder sonstige Instrumente vom Fonds zur Anwendung von Anlagerichtlinien und -beschränkungen bewertet werden, kann von der Art und Weise abweichen, in der diese Anlagen von anderen Arten von Anlegern bewertet werden.

Der Abschluss dieser Vereinbarungen umfasst in unterschiedlichem Ausmaß Elemente von Zins-, Kredit-, Markt- und Dokumentationsrisiken enthalten, die über den im Finanzstatus enthaltenen Umfang hinausgehen. Diese Risiken beinhalten die Möglichkeit, dass kein liquider Markt für diese Vereinbarungen existiert, dass der Kontrahent dieser Vereinbarungen seinen Pflichten nicht nachkommt oder die Vertragsbedingungen anders auslegt und dass ungünstige Zinsentwicklungen auftreten können.

Das maximale Verlustrisiko eines Fonds aus dem Kontrahentenkreditrisiko entspricht dem diskontierten Nettowert der während der Vertragsrestlaufzeit vom Kontrahenten zu erhaltenden Kapitalflüsse, falls dieser Betrag positiv ist. Das Risiko wird von einer Rahmenaufrechnungsvereinbarung zwischen einem Fonds und dem Kontrahenten abgeschwächt, sowie durch die Stellung von Sicherheiten für einen Fonds, um das Kontrahentenrisiko eines Fonds abzudecken.

Korrelationswaps Bestimmte Fonds dürfen in Korrelationswaps anlegen, um Engagements in die Basisreferenzwerte einzugehen oder die damit verbundenen Risiken zu reduzieren. Bei Korrelationswaps vereinbaren zwei Parteien den Tausch von Kapitalflüssen auf Basis der gemessenen Korrelation bestimmter Basisreferenzwerte. Eine Partei stimmt zu, eine „feste Zinszahlung“ oder eine Zahlung zum Ausübungskurs für den „variablen Zinssatz“ oder die realisierte Kurskorrelation des Basisvermögenswerts gegenüber dem Nennbetrag zu tauschen. Bei Auflegung wird der Ausübungskurs allgemein so gewählt, dass der Marktwert des Swaps bei null liegt. Zum Fälligkeitsdatum wird ein Nettokapitalfluss getauscht, wobei der Auszahlungsbetrag der Differenz zwischen der realisierten Kurskorrelation des Basisvermögenswerts und dem Ausübungskurs multipliziert mit dem Nennbetrag entspricht. Als Empfänger der Kurskorrelation mit fester Zinszahlung würde der Fonds den Auszahlungsbetrag erhalten, wenn die realisierte Kurskorrelation des Basisvermögenswerts unter dem Ausübungskurs liegt, und würde den Auszahlungsbetrag schulden, wenn die Korrelation über dem Ausübungskurs liegt. Als Zahler der Kurskorrelation mit fester Zinszahlung würde der Fonds den Auszahlungsbetrag schulden, wenn die realisierte Kurskorrelation des Basisvermögenswerts unter dem Ausübungskurs liegt und würde den Auszahlungsbetrag erhalten, wenn die Korrelation über dem Ausübungskurs liegt. Diese Art von Vereinbarung ist im Grunde ein Terminkontrakt auf die zukünftig realisierte Kurskorrelation des Basisvermögenswerts.

Credit Default Swaps Bestimmte Fonds dürfen Credit Default Swaps auf Unternehmensanleihen, Darlehen, Staatsanleihen, US-Kommunalanleihen oder US-Schatzpapiere zur Absicherung gegen den Zahlungsausfall von Emittenten einsetzen (d. h. um das Risiko zu senken, wenn ein Fonds Beteiligungen an der Referenzobligation besitzt oder ihrem Risiko ausgesetzt ist) oder um eine aktive Long- oder Short-Position in Bezug auf die Wahrscheinlichkeit des Ausfalls eines bestimmten Emittenten einzugehen. Bei Credit Default Swaps nimmt eine Partei (der „Sicherungsnehmer“) eine Reihe von Zahlungen an eine andere Partei (der „Sicherungsgeber“) gegen das Recht vor, einen bestimmten Ertrag zu erhalten, wenn es bei der Referenzeinheit, der referenzierten Obligation oder dem referenzierten Index,

wie im jeweiligen Swap angegeben, zu einem bestimmten Kreditereignis kommt. Als Sicherungsgeber in Credit Default Swaps erhält der Fonds gewöhnlich vom Sicherungsnehmer einen festen Einkommenssatz während der Laufzeit des Swaps, vorausgesetzt, es tritt kein Kreditereignis ein. Als Verkäufer würde ein Fonds seinem Portfolio effektiv Fremdfinanzierung hinzufügen, da zusätzlich zu seinen Gesamtnettovermögenswerten der Fonds dem Anlagerisiko auf den Nennbetrag des Swaps unterliegen würde.

Tritt der Fonds als Sicherungsgeber auf und tritt ein Kreditereignis ein, das in den Bedingungen dieses bestimmten Swaps festgelegt ist, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag bis zum Nominalwert des Swaps und übernimmt, in bestimmten Fällen, das Liefern der referenzierten Verbindlichkeit, einer anderen zu liefernden Obligation oder des Basiswertpapiers, das im referenzierten Index enthalten ist, oder (ii) zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln oder Wertpapieren, der dem Nominalbetrag des Swaps abzüglich des Rückzahlungswerts der referenzierten Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im referenzierten Index enthalten ist, entspricht. Tritt der Fonds als Sicherungsnehmer auf und tritt ein Kreditereignis ein, das in den Bedingungen dieses bestimmten Swaps festgelegt ist, erhält der Fonds entweder (i) vom Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nominalwert des Swaps entspricht, und übernimmt die Lieferung der referenzierten Verbindlichkeit, einer anderen zu liefernden Obligation oder des Basiswertpapiers, das im referenzierten Index enthalten ist, oder (ii) erhält einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln oder Wertpapieren, der dem Nominalbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückzahlungswerts der referenzierten Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das in dem referenzierten Index enthalten ist. Die Rückzahlungswerte werden von Marktmakeuren unter Berücksichtigung von entweder branchenüblichen Beitreibungsraten oder unternehmensspezifischen Faktoren und Erwägungen bis zum Eintreten eines Kreditereignisses geschätzt. Ist ein Kreditereignis eingetreten, wird der Rückzahlungswert durch eine vereinfachte Auktion ermittelt, wobei eine Mindestanzahl zulässiger Maklergebote zusammen mit einer festgelegten Bewertungsmethode zur Berechnung des Abrechnungswerts genutzt wird. In der Lage zu sein, andere Obligationen zu liefern, kann zu einer CTD-Option (das Recht des Sicherungsnehmers, die zu liefernde Obligation mit dem geringsten Wert nach einem Kreditereignis zu liefern) führen.

Credit Default Swaps auf Unternehmens- oder Staatsemissionen beinhalten Zahlungen der einen an die andere Partei gegen das Recht, einen bestimmten Ertrag im Falle eines Zahlungsausfalls oder eines anderen Kreditereignisses zu erhalten. Tritt ein Kreditereignis ein und es wird nicht zugunsten eines Barmittelausgleichs entschieden, kann eine Vielzahl anderer Lieferbarer Obligationen anstelle der bestimmten referenzierten Obligation geliefert werden. In der Lage zu sein, andere Obligationen zu liefern, kann zu einer CTD-Option (das Recht des Sicherungsnehmers, die zu liefernde Obligation mit dem geringsten Wert nach einem Kreditereignis zu liefern) führen.

Credit Default Swaps auf Kreditindizes beinhalten, dass eine Partei einen Zahlungsfluss an eine andere Partei im Gegenzug für das Recht vornimmt, im Fall einer Wertberichtigung, von Mindereinnahmen für Kapital oder Zinsen oder Zahlungsunfähigkeit aller oder eines Teils der Referenzeinheiten, aus denen der Kreditindex besteht, einen bestimmten Ertrag zu erhalten. Bei einem Kreditindex handelt es sich um einen Korb von Kreditinstrumenten- oder Engagements, die einen Teil des Kreditmarkts als Ganzes verkörpern. Diese Indizes bestehen aus Referenzkrediten, die mittels Umfrage von Händlern von diesen als die liquidesten Titel unter den Credit Default Swaps basierend auf dem Bereich des Index bestimmt werden. Indexkomponenten können insbesondere Wertpapiere mit Investment Grade-Rating, hoch rentierliche Wertpapiere, forderungsbesicherte Wertpapiere, Schwellenmärkte und/oder unterschiedliche Kredit-Ratings innerhalb des jeweiligen Bereichs enthalten. Kreditindizes werden mittels Credit Default Swaps mit standardisierten Bedingungen einschließlich eines festen Spreads und standardmäßiger Fälligkeitstermine gehandelt. Ein Index-Credit Default Swap bezieht sich auf alle Indexkomponenten, und bei einem Ausfall wird das Kreditereignis basierend auf der Gewichtung der jeweiligen Komponente im Index abgewickelt. Die Zusammensetzung der Indizes ändert sich regelmäßig, für gewöhnlich alle sechs Monate, und bei den meisten Indizes hat jede Komponente die gleiche Gewichtung im Index. Der Fonds darf Credit Default Swaps auf Kreditindizes einsetzen, um ein Portfolio von Credit Default Swaps oder -anleihen abzusichern, der nicht so teuer ist wie der Kauf zahlreicher Credit Default Swaps, um einen ähnlichen Effekt zu erreichen. Credit Default Swaps auf Indizes sind Instrumente, die Anleger, die Anleihen besitzen, gegen Zahlungsausfall schützen sollen. Sie werden von Wertpapierhändlern genutzt, um auf Änderungen der Kreditqualität zu spekulieren.

Auf absoluter Grundlage dargestellte, implizite Kreditspreads, die zum Ende des Geschäftsjahres zur Bestimmung des Marktwerts von Credit Default Swaps auf Unternehmensmittel, Kredite, Staatsanleihen, US-Kommunalanleihen oder US-Schatzpapiere verwendet werden, werden – soweit vorhanden – in der Aufstellung der Wertpapieranlagen ausgewiesen. Sie dienen als Indikator für den gegenwärtigen Status des Zahlungs-/Performancerisikos und stellen die Wahrscheinlichkeit oder das Risiko eines Ausfalls

der Referenzeinheit dar. Der implizite Kreditspread einer bestimmten Referenzeinheit reflektiert die Kosten von Schutzkäufen/-verkäufen und kann Vorauszahlungen beinhalten, die zum Abschluss der Vereinbarung geleistet werden müssen. Größere Kreditspreads repräsentieren einen Rückgang der Bonität der Referenzeinheit und eine größere Wahrscheinlichkeit oder ein größeres Risiko für einen Ausfall oder den Eintritt eines anderen Kreditereignisses, wie in den Vereinbarungsbedingungen definiert. Bei Credit Default Swaps für forderungsbesicherte Wertpapiere und Kreditindizes dienen die notierten Marktpreise und die sich daraus ergebenden Werte als Indikator des gegenwärtigen Status des Zahlungs-/Performancerisikos. Eine Erhöhung der Marktwerte auf absoluter Basis im Vergleich mit dem nominellen Betrag des Swaps repräsentieren einen Rückgang der Bonität der Referenzeinheit und eine größere Wahrscheinlichkeit oder ein größeres Risiko für einen Ausfall oder den Eintritt eines anderen Kreditereignisses, wie in den Vereinbarungsbedingungen definiert.

Der maximal mögliche Betrag (nicht abgezinst), den ein Fonds als Sicherungsgeber/Sicherungsnehmer zukünftig unter einem Credit Default Swap eventuell zahlen muss, entspricht dem Nennbetrag der Vereinbarung. Die Nennbeträge aller zum 31. Dezember 2022 ausstehender Credit Default Swaps des Fonds als Sicherungsgeber/-nehmer werden in der Aufstellung der Wertpapieranlagen ausgewiesen. Diese potenziellen Beträge würden teilweise von vorhandenen Restwerten der jeweiligen referenzierten Obligationen, von beim Abschluss der Vereinbarung erhaltenen Vorauszahlungen oder von bei der Abwicklung von Credit Default Swaps (mit dem Fonds in der Position des Sicherungsnehmers), erhaltenen Nettobeträgen ausgeglichen, die der Fonds für die gleiche(n) Referenzeinheit(en) einget.

Währungsswaps Bestimmte Fonds können Währungsswap-Vereinbarungen eingehen, um Devisenengagements einzugehen oder die damit verbundenen Risiken zu reduzieren. Währungsswap-Vereinbarungen beinhalten zwei Parteien, die zwei unterschiedliche Währungen mit einer Vereinbarung tauschen, den Tausch zu einem späteren Zeitpunkt zu festgelegten Tauschschätzen umzukehren. Der Austausch von Währungen am Auflegungsdatum des Kontrakts erfolgt zum aktuellen Kassakurs. Der Rücktausch bei Fälligkeit kann zum selben Wechselkurs, zu einem bestimmten Kurs oder zu dem zu diesem Zeitpunkt aktuellen Kassakurs erfolgen. Zinszahlungen erfolgen gegebenenfalls zwischen den Parteien auf der Grundlage von bei der Auflegung des Kontrakts in den beiden Währungen verfügbaren Zinssätzen. Die Laufzeiten für Währungsswaps können sich über viele Berichtszeiträume erstrecken. Währungsswaps werden gewöhnlich mit Geschäfts- und Anlagebanken verhandelt. Einzelne Cross Currency Swaps sehen eventuell keinen Tausch von Kapitalbarmittelflüssen vor, sondern ausschließlich den Tausch von Zinsbarmittelflüssen. Der Tausch von Währungen zum Auflegungsdatum wird separat auf Bruttobasis im Finanzstatus ausgewiesen, wobei der Nennbetrag in der Hauptwährung für die fest- bzw. variabel verzinsliche Komponente jeweils als Forderung bzw. Verbindlichkeit erfasst wird.

Bei Absicherungen auf Klassenebene werden die realisierten und nicht realisierten Gewinne oder Verluste ausschließlich den betreffenden Anteilsklassen zugeordnet. Die nicht realisierten Gewinne oder Verluste sind in den Finanzderivaten im Finanzstatus ausgewiesen. Im Zusammenhang mit diesen Verträgen können Wertpapiere in Übereinstimmung mit den Bedingungen der jeweiligen Verträge zu Sicherheiten bestimmt werden.

Zinsswaps Bestimmte Fonds unterliegen bei der Realisierung ihres Anlageziels einem Zinsrisiko. Da ein Fonds festverzinsliche Anleihen hält, kann der Wert dieser Anleihen sinken, wenn die Zinssätze steigen. Um die Absicherung gegen dieses Risiko zu unterstützen und seine Fähigkeit aufrecht zu erhalten, Einkünfte zu marktüblichen Zinssätzen zu erzielen, darf der Fonds Zinsswaps eingehen. Bei Zinsswaps tauscht der Fonds mit einer anderen Partei deren jeweilige Zinszahlungsverpflichtungen auf den Kapitalnennbetrag. Bestimmte Arten von Zinsswaps können Folgendes beinhalten: (i) Zinssatz-Obergrenzen, bei denen eine Partei zustimmt, gegen eine Prämie in dem Fall Zahlungen an die andere vorzunehmen, dass die Zinssätze einen bestimmten Satz oder eine bestimmte „Obergrenze“ überschreiten, (ii) Zinssatzuntergrenzen, bei denen eine Partei gegen eine Prämie zustimmt, in dem Fall Zahlungen an die andere vorzunehmen, dass die Zinssätze unter einen bestimmten Satz oder eine bestimmte „Untergrenze“ fallen, (iii) Zinssatz-Ober- und -Untergrenzen, bei denen eine Partei eine Obergrenze veräußert und eine Untergrenze erwirbt oder umgekehrt, um sich selbst gegen Zinssatzbewegungen zu schützen, die bestimmte Mindest- oder Höchstsätze überschreiten, (iv) kündbare Zinsswaps, bei denen der Kontrahent die Swaptransaktion als Ganzes zu Nullkosten und zu einem bestimmten Datum und zu einem Zeitpunkt vor dem Fälligkeitsdatum beenden darf, (v) Spread-Locks, die es dem Nutzer von Zinsswaps ermöglichen, das Termindifferential (oder den Spread) zwischen dem Zinsswapsatz und einer bestimmten Benchmark festzuschreiben, oder (vi) Basiswaps, bei denen zwei Parteien variable Zinssätze tauschen, die auf unterschiedlichen Geldmärkten basieren.

Total Return Swaps Bestimmte Fonds dürfen Total Return Swaps eingehen. Total Return Swaps auf Rohstoffe enthalten Verpflichtungen, bei denen Barmittel auf Basis von Rohstoffkursen gegen entweder feste oder variable Kurse oder Zinssätze getauscht werden. Eine Partei würde in diesem Fall Zahlungen auf Basis des Marktwerts des beteiligten Rohstoffs erhalten und einen festen Betrag zahlen. Total Return Swaps auf Indizes enthalten Verpflichtungen zur Zahlung von Zinsen im Tausch gegen einen marktgebundenen Ertrag. Ein Kontrahent zahlt den Gesamtertrag eines bestimmten Referenzvermögenswerts aus. Dabei kann es sich um eine Aktie, einen Index oder eine Anleihe handeln. Im Gegenzug erhält er regelmäßige Zahlungsflüsse. In dem Umfang, in dem der Gesamtertrag eines Basiswertpapiers oder -index die Abwicklungszinsverpflichtung übertrifft oder unterschreitet, erhält der Fonds eine Zahlung vom Kontrahenten bzw. leistet eine Zahlung an den Kontrahenten.

Bestimmte Fonds dürfen in Total Return Equity Swaps („Aktienwaps“) anlegen. Aktienwaps können eingesetzt werden, um einen Gewinn abzusichern oder um einen Verlust zu vermeiden, der aus Schwankungen im Wert oder Kurs von Aktien oder Finanzinstrumenten oder einem Index aus diesen Aktien oder Finanzinstrumenten herrührt. Bei einem Aktienwap handelt es sich um ein derivatives Instrument, das die wirtschaftliche Wertentwicklung und den Kapitalfluss einer traditionellen Aktienanlage nachbilden soll.

Das Aktienwaps eigene Risiko hängt von der Position eines Fonds bei einer Transaktion ab: wenn ein Fonds Aktien-Swaps einsetzt, kann er sich in eine Long Position zum Basiswert bringen. In diesem Fall profitiert der Fonds von allen Wertzunahmen der Basisaktie und erleidet jede Wertabnahme. Die einer Long Position eigenen Risiken gleichen den mit dem Kauf der Basisaktie einhergehenden Risiken. Umgekehrt kann sich der Fonds in eine Short Position zum Wert der Basisaktie bringen. In diesem Fall profitiert der Fonds von allen Kursverfällen der Basisaktie und erleidet Verluste aus etwaigen Kurszunahmen. Die mit einer Short Position einhergehenden Risiken sind größer als die einer Long Position: Während es bei einer Long Position einen maximalen Höchstverlust gibt, wenn die Basisaktie mit null bewertet wird, entspricht der maximale Verlust aus einer Short Position der Wertzunahme der Basisaktie. Diese Zunahme ist theoretisch unbegrenzt.

Allerdings ist anzumerken, dass die Short bzw. Long Position eines Aktienwaps auf dem Urteil der Anlageberatungsgesellschaften über die zukünftige Richtung des Basiswertpapiers beruht. Die Position könnte sich nachteilig auf die Wertentwicklung des Fonds auswirken.

Volatilitäts-Swapvereinbarungen sind auch als auch Forward-Volatility-Agreement bekannt und sind Vereinbarungen, in deren Rahmen sich die Kontrahenten zu Zahlungen im Zusammenhang mit Veränderungen der Volatilität (d. h. des Ausmaßes der Veränderungen innerhalb eines festgelegten Zeitraums) eines zugrunde liegenden referenzierten Instruments verpflichten, beispielsweise einer Währung, eines Zinssatzes, eines Index, eines Wertpapiers oder eines anderen Finanzinstruments. Volatilitätsswaps gestatten den Parteien den Versuch, das Volatilitätsrisiko abzusichern und/oder Positionen in der prognostizierten künftigen Volatilität eines zugrunde liegenden referenzierten Instruments einzugehen. Der Fonds kann beispielsweise einen Volatilitätsswap eingehen, um eine Position darauf zu bilden, dass die Volatilität des referenzierten Instruments über einen bestimmten Zeitraum steigen wird. Wenn die Volatilität des referenzierten Instruments in dem festgelegten Zeitraum steigt, erhält der Fonds von dem Kontrahenten eine Zahlung auf Basis des Betrags, um den die realisierte Volatilität des referenzierten Instruments ein zwischen den Parteien vereinbartes Volatilitätsniveau übersteigt. Wenn die Volatilität des referenzierten Instruments in dem festgelegten Zeitraum nicht steigt, leistet der Fonds an den Kontrahenten eine Zahlung auf Basis des Betrags, um den die realisierte Volatilität des referenzierten Instruments unter das zwischen den Parteien vereinbarte Volatilitätsniveau sinkt. Zum Fälligkeitsdatum wird ein Nettokapitalfluss getauscht, wobei der Auszahlungsbetrag der Differenz zwischen der realisierten Kursvolatilität des referenzierten Instruments und dem Ausübungskurs multipliziert mit dem Nennbetrag entspricht. Als Empfänger der realisierten Preisvolatilität erhält der Fonds den Auszahlungsbetrag, wenn die realisierte Kursvolatilität des referenzierten Instruments höher ist als der Strike, bzw. muss den Auszahlungsbetrag zahlen, wenn die Volatilität niedriger ist als der Strike. Als Zahler der realisierten Preisvolatilität muss der Fonds den Auszahlungsbetrag zahlen, wenn die realisierte Kursvolatilität des referenzierten Instruments höher ist als der Strike, bzw. erhält den Auszahlungsbetrag, wenn die Volatilität niedriger ist als der Strike. Zahlungen auf einen Volatilitätsswap sind höher, wenn sie auf dem mathematischen Quadrat der Volatilität beruhen (d. h. der mit sich selbst multiplizierten gemessenen Volatilität, als „Varianz“ bezeichnet). Diese Art von Volatilitätsswap wird häufig als Varianzswap bezeichnet.

7. EFFIZIENTE PORTFOLIOVERWALTUNG

Innerhalb der durch die Anlageziele und Anlagepolitik der Fonds und nach Maßgabe der von der Zentralbank jeweils festgesetzten Grenzen und des laut Prospektbestimmungen erlaubten Umfangs sind die Finanzderivate und Anlagetechniken von allen Fonds für eine effiziente Portfolioverwaltung einzusetzen. Die Fonds können diese Finanzderivate und Anlagetechniken zur Absicherung gegen Zinsänderungen, Devisenkursänderungen in anderen Währungen als der Funktionswährung, gegen Änderungen in Wertpapierkursen oder als Teil ihrer allgemeinen Anlagestrategie einsetzen.

Der durch die Pensionsgeschäfte im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 entstandene Zinsertrag/(-aufwand) betrug insgesamt 155.496.772 USD/(296.154 USD) (31. Dezember 2021: 1.815.898 USD/(4.593.880 USD)).

Der durch die umgekehrten Pensionsgeschäfte im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 entstandene Zinsertrag/(-aufwand) betrug insgesamt 9.791.008 USD/(45.026.160 USD) (31. Dezember 2021: 4.690.120 USD/(10.666.937 USD)).

Der durch die Sale-Buyback-Geschäfte im Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2022 entstandene Zinsertrag/(-aufwand) betrug insgesamt 950 USD/(6.496.889 USD) (31. Dezember 2021: 259.028 USD/(225.795 USD)).

8. BESTEUERUNG

Nach geltendem Recht und herrschender Praxis qualifiziert sich die Gesellschaft als Investmentgesellschaft gemäß Definition in § 739B des Taxes Consolidation Act von 1997 in seiner jeweils geltenden Fassung, solange sie in Irland ansässig ist. Auf dieser Grundlage ist sie mit ihren Geschäfts- oder Kapitalerträgen in Irland nicht steuerpflichtig. Bei Eintritt eines „steuerpflichtigen Ereignisses“ kann jedoch in Irland eine Steuer anfallen. Ein steuerpflichtiges Ereignis schließt alle Ausschüttungszahlungen an Anteilinhaber und alle Einlösungen, Rücknahmen, Stormierungen, Übertragungen oder fiktiven Veräußerungen (eine fiktive Veräußerung tritt bei Ablauf eines entsprechenden Zeitraums ein) von Anteilen sowie die Vereinnahmung oder Löschung von Anteilen eines Anteilinhabers durch die Gesellschaft, um den auf einen sich aus einer Übertragung ergebenden Gewinn zu zahlenden Steuerbetrag zu begleichen.

Die Gesellschaft unterliegt in Irland keiner Steuer bei steuerpflichtigen Ereignissen mit Bezug auf:

- Anteilinhaber, die im steuerlichen Sinne zum Zeitpunkt des steuerpflichtigen Ereignisses nicht in Irland ansässig oder gewöhnlich ansässig sind, vorausgesetzt, dass dem Fonds die erforderlichen, unterzeichneten Erklärungen gemäß den Bestimmungen des Taxes Consolidation Act, 1997 in seiner jeweils geltenden Fassung vorliegen, dem Fonds keine Informationen vorliegen, die in angemessener Weise darauf hindeuten, dass die entsprechenden darin enthaltenen Angaben sachlich nicht mehr zutreffend sind, oder der Fonds von der irischen Steuerbehörde bevollmächtigt wurde, mangels entsprechender Erklärungen Brutto-Zahlungen vorzunehmen;
- bestimmte steuerbefreite, in Irland ansässige Anleger, die der Gesellschaft die erforderlichen, unterzeichneten gesetzlichen Erklärungen vorgelegt haben.
- bei Transaktionen in Bezug auf Anteile, die in einem von den Revenue Commissioners benannten anerkannten Clearingsystem gehalten werden;
- eines Tausches von Anteilen eines Teilfonds in Anteile eines anderen Teilfonds des Fonds;
- es zu einem Austausch von Anteilen aufgrund einer qualifizierenden Verschmelzung oder Restrukturierung des Fonds mit einem anderen Fonds kommt; und
- bestimmter Formen des Anteilsaustausches zwischen Ehegatten und ehemaligen Ehegatten.

Wurde keine angemessene Erklärung vorgelegt, unterliegt der Fonds bei Eintritt eines Steueratbestandes der irischen Steuer.

Die Vorschriften für Anlageorganismen sehen vor, dass die Steuerbehörden Investmentfonds, die außerhalb Irlands vermarktet werden, die Genehmigung erteilen können, Zahlungen an nicht in Irland ansässige Anteilinhaber ohne Abzug der irischen Steuer zu leisten, wenn keine maßgebliche Erklärung vorliegt, sofern die vorgeschriebenen „äquivalenten Maßnahmen“ getroffen werden. Ein Fonds, der zugelassen werden möchte, muss dies schriftlich bei den Finanzkommissaren beantragen und die Einhaltung der betreffenden Bedingungen bestätigen.

Dividenden, Zinsen und Kapitalerträge (soweit zutreffend), die der Gesellschaft hinsichtlich ihrer Anlagen (mit Ausnahme von Wertpapieren irischer Emittenten) zufließen, können in den Ländern, in denen sich die Emittenten der Anlagen befinden, steuerpflichtig sein und unter anderem der Quellensteuer unterliegen. Es ist davon auszugehen, dass die Gesellschaft keinen Anspruch auf reduzierte Quellensteuersätze nach den Doppelbesteuerungsabkommen zwischen Irland und diesen Ländern hat. Falls sich diese Rechtslage ändert und die Anwendung eines reduzierten Steuersatzes zu Steuererstattungen an die Gesellschaft führt, werden die Nettoinventarwerte nicht rückwirkend geändert. Vielmehr wird die Erstattung anteilig auf die zum Zeitpunkt der Erstattung bestehenden Anteilinhaber verteilt.

In Übereinstimmung mit dem von der britischen Steuerbehörde United Kingdom HM Revenue and Customs eingeführten, neuen Regelwerk für Reporting Funds wird jede einzelne Anteilklasse zu Zwecken der Besteuerung in Großbritannien als eigenständiger „Offshore-Fonds“ betrachtet. Das Regelwerk für Reporting Funds lässt zu, dass ein Offshore-Fonds beim HM Revenue and Customs vorab um Zulassung für die Behandlung als „Reporting Fund“ ersuchen kann. Sobald ein Offshore-Fonds den Status eines Reporting Fund erhalten hat, behält er diesen Status, so lange er die Bedingungen für einen Reporting Fund erfüllt, ohne dass er dafür die erneute Zulassung bei der HM Revenue and Customs beantragen muss. Jede Anteilklasse der Gesellschaft wird als Reporting Fund behandelt. Dies wurde von HM Revenue and Customs genehmigt.

9. DIVIDENDENAUSCHÜTTUNGSPOLITIK

Wie in der jeweiligen Fondsergänzung angegeben, können Dividendenausschüttungen festgesetzt werden auf:

- Nettokapitalerträge, die aus Zinsen und Dividenden abzüglich Aufwendungen bestehen.
- Realisierte Gewinne aus der Veräußerung von Anlagen abzüglich realisierter und nicht realisierter Verluste (einschließlich Gebühren und Aufwendungen). Für den Fall, dass die bei der Veräußerung von Anlagen realisierten Gewinne abzüglich der realisierten und nicht realisierten Verluste negativ sind, können die Fonds dennoch Dividenden aus den Nettokapitalerträgen und/oder Kapital bezahlen.
- Andere Mittel (einschließlich Kapital), die nach dem Gesetz aus dem betreffenden Fonds bzw. der betreffenden Anteilklasse des betreffenden Fonds ausgeschüttet werden können.

Verwaltungsgebühren und andere Gebühren oder ein Teil davon können dem Kapital belastet werden. Das kann dazu führen, dass das Kapital sinkt und Erträge mit einem verminderten Potenzial für zukünftiges Kapitalwachstum erwirtschaftet werden. Dieser Zyklus kann sich solange fortsetzen, bis das Kapital aufgezehrt ist. Der Grund für die Belastung des Kapitals ist, den an die Anteilinhaber ausschüttbaren Betrag zu maximieren.

Für die Klassen Income II kann der Verwaltungsrat in seinem Ermessen entscheiden, die Gebühren aus dem Kapital zu bezahlen und das Renditedifferenzial zwischen den jeweiligen abgesicherten Anteilsklassen und den grundlegenden Anteilsklassen zu berücksichtigen (was einer Ausschüttung aus dem Kapital entspricht). Das Renditedifferenzial kann positiv oder negativ sein und wird unter Berücksichtigung des Beitrags der Anteilsklassenbesicherung aus den abgesicherten Klassen berechnet.

Im Fall der Klassen M Retail, des PIMCO Asia High Yield Bond Fund, des Asia Strategic Interest Bond Fund, des Euro Income Bond Fund, des Euro Short-Term Fund, des Income Fund, des Low Duration Income Fund, des Mortgage Opportunities Fund und des US Short-Term Fund werden, mit Ausnahme der Klassen G Institutional, G Retail, E ausschüttend Q, E ausschüttend II Q und Investor ausschüttend A, Dividendenausschüttungen monatlich festgesetzt und je nach Wahl des Anteilinhabers monatlich in bar ausgezahlt oder in zusätzliche Anteile reinvestiert.

Für die Administrative Classes des Diversified Income Fund, BE Retail, BM Retail, BN Retail, M Retail and N Retail, werden Dividendenausschüttungen monatlich festgesetzt und je nach Wahl des Anteilinhabers monatlich in bar ausgezahlt oder in zusätzliche Anteile reinvestiert.

Für die Klassen G Institutional, G Retail und Investor ausschüttend A werden Dividendenausschüttungen jährlich festgesetzt und je nach Wahl des Anteilinhabers jährlich in bar ausgezahlt oder in zusätzliche Anteile reinvestiert.

Im Falle aller anderen Fonds mit ausschüttenden Anteilsklassen werden Ausschüttungen vierteljährlich festgesetzt und werden, abhängig von der Entscheidung des Anteilinhabers, in bar ausgezahlt oder nach der Erklärung in zusätzliche Anteile reinvestiert.

Dividendenausschüttungen an Inhaber rückgabeberechtigter Anteile werden in der Betriebsergebnisrechnung als Finanzierungskosten klassifiziert. Die auf die

thesaurierenden Anteile entfallenden Erträge oder Kapitalzuwachs werden weder festgesetzt noch ausgeschüttet. Stattdessen wird der NIW je Anteil der thesaurierenden Anteile entsprechend dieser Erträge oder dieses Wertzuwachses erhöht. Dividendenausschüttungen, die nicht in Anteile reinvestiert werden, werden den Anteilinhabern per Banküberweisung ausgezahlt. Dividendenausschüttungen, die nach Ablauf von sechs Jahren ab dem Datum ihrer Erklärung nicht eingefordert werden, verfallen und fließen an den jeweiligen Fonds zurück. Die Anteilinhaber können sich entscheiden, die Dividendenausschüttungen in zusätzliche Anteile zu reinvestieren oder sich die Dividendenausschüttungen bar auszahlen zu lassen, indem sie das entsprechende Kästchen im Antragsformular auswählen.

Für die nachfolgenden Fonds wurde ein Teil der Dividendenausschüttungen gemäß der Betriebsergebnisrechnung aus dem Kapital gezahlt (Angaben in Tausend):

Fonds	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2022	Geschäftsjahr zum 31. Dez. 2021
PIMCO Capital Securities Fund	\$ 30	\$ 0
PIMCO Climate Bond Fund	1	0
Diversified Income Fund	5.609	0
Diversified Income Duration Hedged Fund	524	605
Dynamic Bond Fund	237	0
Dynamic Multi-Asset Fund	€ 4.339	€ 6.563
Global Bond Fund	\$ 824	\$ 0
PIMCO Global Core Asset Allocation Fund	2.887	3.365
Global High Yield Bond Fund	124	0
Global Investment Grade Credit ESG Fund	0	15
Global Low Duration Real Return Fund	131	51
Global Real Return Fund	805	0
Income Fund	3.564	1.310
Low Average Duration Fund	19	0
Low Duration Opportunities Fund	644	0
Total Return Bond Fund	104	0
UK Corporate Bond Fund	£ 247	£ 0
UK Long Term Corporate Bond Fund	69	29

10. SOFT COMMISSIONS

Die Gesellschaft bzw. ihre Anlageberatungsgesellschaft kann Transaktionen im Namen der Fonds über oder mit Unterstützung von Ausführungsmaklern durchführen, die zusätzlich zur routinemäßigen Order-Ausführung gelegentlich Güter, Dienstleistungen oder andere Vorteile wie etwa Research- und Beratungsdienste für die Gesellschaft oder ihre Beauftragten bereitstellen oder beschaffen können. Die Gesellschaft bzw. ihre Anlageberatungsgesellschaft kann diesen Brokern Full-Service-Provisionssätze zahlen, die teilweise für die Bereitstellung zulässiger Güter oder Dienstleistungen verwendet werden können. Diejenigen Anlageberatungsgesellschaften, bei denen es sich um Wertpapierfirmen handelt, die der Richtlinie über Märkte für Finanzinstrumente („MiFID“) unterliegen oder die gleichwertigen aufsichtsrechtlichen Bestimmungen unterworfen sind, müssen Research-Leistungen Dritter, die sie im Zusammenhang mit der Verwaltung des Vermögens der einzelnen Fonds kaufen, direkt aus ihren eigenen Mitteln bezahlen.

11. GETRENNTE HAFTUNG

Die Gesellschaft ist eine offene Investmentgesellschaft des Umbrella-Typs mit variablem Kapital und Haftungstrennung zwischen ihren Teilfonds. Dementsprechend sind etwaige Verbindlichkeiten, die im Namen eines Fonds der Gesellschaft entstanden oder diesem zuzuordnen sind, ausschließlich aus den Vermögenswerten des betreffenden Fonds zu begleichen, und weder die Gesellschaft noch ein Verwaltungsratsmitglied, Konkursverwalter, Revisor, Insolvenzverwalter, kommissarischer Insolvenzverwalter oder eine sonstige Person dürfen die Vermögenswerte dieses Fonds zum Ausgleich von Verbindlichkeiten im Namen eines anderen Fonds der Gesellschaft verwenden oder sind verpflichtet, sie hierzu zu verwenden, unabhängig davon, wann diese Verbindlichkeit entstanden ist.

12. ÄNDERUNGEN AM PROSPEKT, AN DER GRÜNDUNGSURKUNDE UND DER SATZUNG

Am 7. Februar 2022 wurden der Prospekt und die Ergänzungen für die Gesellschaft aufgrund der Auflegung von Back-End-Anteilsklassen, und zwar „BE Retail“, „BN Retail“ und „BM Retail“ (die „Back-End-Anteilsklassen“), im Diversified Income Fund, im Dynamic Multi-Asset Fund, im Emerging Markets Bond Fund, im Global High Yield Bond Fund und im StockPLUS™ Fund aktualisiert. Darüber hinaus wird für die GBP-Anteilsklassen in Bezug auf jeden Fonds kein Ausgabeaufschlag erhoben und der Abschreibungszeitraum für den PIMCO Climate Bond Fund, den PIMCO ESG Income Fund und den Income Fund II wurde von einem Jahr auf drei Jahre verlängert.

Am 13. April 2022 wurde der Abschnitt „ESG“ des Prospekts um eine Definition für „festverzinsliche ESG-Wertpapiere“ ergänzt, die beschreibt, was eine grüne Anleihe, eine soziale Anleihe, eine nachhaltige Anleihe und eine nachhaltigkeitsbezogene Anleihe ist. Am selben Tag wurde die Ergänzung für den PIMCO Climate Bond Fund im Zusammenhang mit der Beschreibung der „festverzinslichen ESG-Wertpapiere“ aktualisiert, um klarzustellen, dass der Fonds auch in andere Arten von festverzinslichen ESG-Wertpapieren investieren kann, einschließlich solcher aus dem Sektor der fossilen Brennstoffe. Weitere Einzelheiten finden Sie in der Offenlegungsverordnung im ungeprüften Anhang. Am selben Tag wurden die Ergänzungen für den UK Sterling Long Average Duration Fund, den US Small Cap StocksPLUS™ Fund, den PIMCO RAE PLUS Emerging Markets Fund und den PIMCO RAE PLUS Global Developed Fund aus dem Prospekt entfernt, nachdem sie von der Zentralbank offiziell widerrufen worden waren.

Am 13. April 2022 wurde die Ergänzung für den PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund im Hinblick auf die überarbeiteten Angaben zum Gebührenverzicht aktualisiert, und die Ergänzung für den Inflation Multi-Asset Fund wurde geändert, um die Namensänderung des Fonds von „Inflation Strategy Fund“ in „Inflation Multi-Asset Fund“ zu berücksichtigen. Darüber hinaus wurde die Ergänzung aktualisiert, um die vom Fonds verwendete Benchmark zu ändern und die Senkung der einheitlichen Verwaltungsgebühr widerzuspiegeln, die der Fonds für die verschiedenen Anteilsklassen erhebt. Die Angaben zu den Anlagen des Fonds in Aktien bzw. aktienähnlichen Wertpapieren wurden ebenfalls geändert. Die Ergänzung für den PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund wurde geändert, um die Senkung der vom Fonds erhobenen Verwaltungsgebühr widerzuspiegeln. In dieser Hinsicht wurde die Verwaltungsgebühr für die Class E, die Class M Retail, die Class G Retail und die Class T jeweils um 31 Basispunkte gesenkt. Die in Bezug auf die Class R erhobene Verwaltungsgebühr wurde um 17 Basispunkte gesenkt.

Am 22. April 2022 wurden die Ergänzungen für den PIMCO European Short-Term Opportunities Fund und den Euro Short-Term Fund aktualisiert, um eine Änderung der Definition in Bezug auf den „Handelstag“ für die Fonds von „jeder Tag, an dem die Banken in München, Deutschland, für den Geschäftsverkehr geöffnet sind ...“ in „jeder Tag, an dem die Banken in England für den Geschäftsverkehr geöffnet sind ...“, zu berücksichtigen, nachdem bestimmte Portfoliomanager der PIMCO Europe GmbH von München in die Niederlassung London umgezogen sind.

Am 1. Juni 2022 wurde die Ergänzung für den PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund aktualisiert, um einen Gebührenverzicht von 0,30 % zu berücksichtigen, der ab dem 1. Juni 2022 in Bezug auf die Verwaltungsgebühr für alle Anteilsklassen des Fonds (mit Ausnahme der Class Z) gilt, am 1. Juni 2023 auf 0,15 % gesenkt wird und am 1. Juni 2024 vollständig ausläuft.

Am 8. Juni 2022 wurden der Low Duration Opportunities ESG Fund, der Diversified Income ESG Fund und der Emerging Local Bond ESG Fund von der Zentralbank zugelassen, und die Ergänzungen für diese Fonds wurden in den konsolidierten Prospekt aufgenommen.

Am 13. Juni 2022 wurden die Ergänzungen für den PIMCO ESG Income Fund, den Global Bond ESG Fund, den Emerging Markets Bond ESG Fund und den Global Investment Grade Credit ESG Fund aktualisiert, in Übereinstimmung mit den Klassifizierungsanforderungen von Artikel 8 der Offenlegungsverordnung und um eindeutig festzulegen, dass die Fonds im Rahmen ihres Ansatzes für nachhaltige Anlagen ökologische und soziale Merkmale bewerten müssen (mit der Feststellung, dass nachhaltige Anlagen zwar weiterhin Teil des Ziels der Fonds sein werden, „nachhaltige Investitionen“ jedoch nicht Teil des jeweiligen Anlageziels sind). Die Fonds werden weiterhin in nachhaltige Anlagen investieren, ein ökologisches und soziales Ausschlusscreening durchführen und mit Emittenten bezüglich deren ESG-Praktiken in Dialog treten. Weitere Einzelheiten finden Sie in der Offenlegungsverordnung im ungeprüften Anhang.

Am 1. Juli 2022 wurde die Ergänzung für den Euro Credit Fund im Hinblick auf die überarbeitete Offenlegung zum Gebührenverzicht aktualisiert. Am selben Tag wurde die Ergänzung für den Global LIBOR Plus Bond Fund aktualisiert, um die Änderung des Fondsnamens in Low Duration Opportunities Fund widerzuspiegeln und um die vom Fonds verwendete Benchmark zu ändern. Am selben Tag wurden die Ergänzungen für den PIMCO Capital Securities Fund, den Low Duration Opportunities ESG Fund, den PIMCO Credit Opportunities Bond Fund, den Dynamic Bond Fund, den Mortgage Opportunities Fund und den PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund aktualisiert, um die von den Fonds verwendete Benchmark zu ändern.

Am 22. Juli 2022 wurden die Ergänzungen für den Euro Short Term Fund, den Global Real Return Fund und den Global Low Duration Real Return Fund aktualisiert, um ausdrücklich darauf hinzuweisen, dass sie ökologische Merkmale bewerten werden, indem sie verbindliche ESG-Kriterien für die Auswahl der zugrunde liegenden Vermögenswerte einführen, die zusätzlich zu den aktuellen Anlagestrategien der Fonds gelten. Die Fonds sind als Fonds gemäß Artikel 8 im Sinne der Offenlegungsverordnung eingestuft. Am selben Tag

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)

wurde die Ergänzung der Gesellschaft zur Bewerbung ökologischer Merkmale aktualisiert, um die Ausschlussstrategie und die Offenlegung zum Emittentenengagement weiter zu verbessern. Darüber hinaus wird durch die Offenlegung klargestellt, dass die taxonomiekonformen Investitionen 0 % betragen müssen. Weitere Einzelheiten finden Sie in der Offenlegungsverordnung im ungeprüften Anhang.

Am 29. Juli 2022 wurde die Ergänzung für den Strategic Income Fund aktualisiert, um die vom Fonds verwendete Benchmark zu ändern, um die geänderte eigene Aktienstrategie des Fonds widerzuspiegeln, um die Beendigung der Ernennung von Research Affiliates, LLC und Parametric Portfolio Associates, LLC widerzuspiegeln, um den geänderten Schwellenwert für die Anlage in anderen ertragsbringenden Anlagen zu berücksichtigen, um die Änderung der Anlagen, die von der Anlagegrenze des Fonds für Schwellenländer ausgeschlossen sind, zu berücksichtigen und um eine Senkung der Verwaltungsgebühr für die Anteilsklassen des Fonds zu berücksichtigen.

Am 8. August 2022 wurde der Prospekt im Hinblick auf Änderungen der Angaben zum LIBOR, den Abschnitt über die Besteuerung, die Mandate der Verwaltungsratsmitglieder, Änderungen der Abrechnungsfristen für den Erhalt von Zeichnungsgeldern für bestimmte Anteilsklassen und die Schaffung einer neuen Anteilsklassenart, Class F, in den Fondsergänzungen für den Income Fund II und den Asia Strategic Interest Bond Fund aktualisiert, deren Ergänzungen ebenfalls am selben Tag entsprechend aktualisiert wurden.

Am 30. September 2022 wurden die Ergänzungen für den Asia Strategic Interest Bond Fund und den PIMCO Asia High Yield Bond Fund aktualisiert, um den Handelsschluss der Fonds von 9.00 Uhr irischer Zeit an jedem Handelstag in 10.00 Uhr irischer Zeit an jedem Handelstag zu ändern.

Am 30. November 2022 wurden der Prospekt und die wesentlichen Ergänzungen für die Gesellschaft gemäß der Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (EU) 2019/2088 („Offenlegungsverordnung“) aktualisiert und von der Zentralbank zur Kenntnis genommen, um einen Anhang mit vorvertraglichen Angaben für jede Ergänzung zu den Fonds nach Artikel 8 und Artikel 9 aufzunehmen. Am gleichen Tag wurden die Ergänzung „Bewerbung ökologischer Merkmale“ und alle Verweise im gesamten Verkaufsprospekt entfernt. Die Offenlegung zur Konformität mit der Taxonomie-Verordnung in jedem Artikel 9 und Artikel 8 sowie den Fondsergänzungen wurde ebenfalls entfernt. Am selben Tag wurde der Prospekt mit der Offenlegung der wichtigen nachteiligen Auswirkungen auf der Website aktualisiert. Weitere Einzelheiten finden Sie in der Offenlegungsverordnung im ungeprüften Anhang.

Die Gründungsurkunde und die Satzung der Gesellschaft wurden im Laufe des Geschäftsjahres am 15. September 2022 geändert.

13. GEBÜHREN UND AUFWENDUNGEN

(a) An die Verwaltungsgesellschaft zu zahlende Gebühren

Mit Ausnahme der BN Retail-Anteile, der BM Retail-Anteile und der BE Retail-Anteile, wie in der entsprechenden Fondsergänzung offengelegt, darf die Gesamtgebühr 2,50 % p. a. des Nettoinventarwerts des jeweiligen Fonds nicht übersteigen.

(b) Verwaltungsgebühr

Die Verwaltungsgesellschaft erbringt oder beschafft für jeden Fonds, wie im Prospekt beschrieben, Anlageberatungs-, Administrations-, Verwahr- und andere Dienstleistungen, wofür jeder Fonds eine einzelne Managementgebühr an die Verwaltungsgesellschaft zahlt. Die Verwaltungsgebühr (wie im Prospekt definiert) für jeden Fonds läuft an jedem Handelstag (wie in der Ergänzung für den jeweiligen Fonds definiert) auf und ist monatlich rückwirkend zahlbar. Die Verwaltungsgesellschaft kann die Verwaltungsgebühr vollständig oder teilweise an die Anlageberatungsgesellschaften entrichten, um die von diesen erbrachten Anlageberatungs- und anderen Dienste zu bezahlen und damit die Anlageberatungsgesellschaften die Kosten für die Administrations-, Verwahr- und anderen Dienste begleichen können, die die Verwaltungsgesellschaft für die Fonds erbracht hat.

Die Verwaltungsgebühr für die einzelnen Klassen der einzelnen Fonds (angegeben in Prozent pro Jahr ihres NIW) lautet wie folgt:

	Klassen Inst'l, G Inst'l, Inv.		BE Retail BM Retail BN Retail Klassen E, G Retail, M Retail, N Retail, T (%)	Class R (%)	Class W (%)
	Admin (%)	H Inst'l (%)			
PIMCO Asia High Yield Bond Fund	0,65	0,82	1,55	k. A.	k. A.
Asia Strategic Interest Bond Fund	0,65	k. A.	1,50	k. A.	k. A.
PIMCO Capital Securities Fund	0,79	k. A.	1,69	0,93	k. A.

	Klassen Inst'l, G Inst'l, Inv.		H Inst'l (%)	BE Retail BM Retail BN Retail Klassen E, G Retail, M Retail, N Retail, T (%)	Class R (%)	Class W (%)
	Admin (%)	H Inst'l (%)				
PIMCO Climate Bond Fund ⁽¹⁾	0,52	k. A.	k. A.	1,42	k. A.	k. A.
Commodity Real Return Fund	0,74	0,91	1,64	k. A.	k. A.	
PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	0,90	k. A.	1,80	k. A.	k. A.	
Diversified Income Fund	0,69	0,86	1,59	k. A.	0,55	
Diversified Income Duration Hedged Fund	0,69	k. A.	1,59	k. A.	k. A.	
Diversified Income ESG Fund	0,72	k. A.	1,62	k. A.	k. A.	
Dynamic Bond Fund	0,90	1,07	1,80	0,99	k. A.	
Dynamic Multi-Asset Fund	0,85	1,02	1,85	k. A.	k. A.	
Emerging Local Bond Fund	0,89	1,06	1,89	k. A.	k. A.	
Emerging Local Bond ESG Fund	0,92	k. A.	1,92	k. A.	k. A.	
Emerging Markets Bond Fund	0,79	0,96	1,69	k. A.	k. A.	
Emerging Markets Bond ESG Fund	0,89	k. A.	1,74	k. A.	k. A.	
Emerging Markets Corporate Bond Fund	0,95	k. A.	1,85	k. A.	k. A.	
PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund ⁽²⁾	0,65	k. A.	1,55	k. A.	k. A.	
Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	0,85	k. A.	1,75	k. A.	k. A.	
PIMCO ESG Income Fund	0,59	k. A.	1,49	0,82	k. A.	
Euro Bond Fund	0,46	k. A.	1,36	k. A.	k. A.	
Euro Credit Fund ⁽³⁾	0,46	0,38	1,36	k. A.	k. A.	
Euro Income Bond Fund	0,49	k. A.	1,39	k. A.	k. A.	
Euro Long Average Duration Fund	0,46	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.	
Euro Short-Term Fund ⁽⁴⁾	0,29	k. A.	1,04	k. A.	k. A.	
PIMCO European High Yield Bond Fund	0,55	k. A.	1,45	k. A.	k. A.	
PIMCO European Short-Term Opportunities Fund ⁽⁵⁾	0,32	0,49	0,82	k. A.	k. A.	
Global Advantage Fund	0,70	k. A.	1,70	k. A.	k. A.	
Global Bond Fund	0,49	0,66	1,39	0,76	0,39	
Global Bond ESG Fund	0,52	k. A.	1,42	k. A.	k. A.	
Global Bond Ex-US Fund	0,49	0,66	1,39	k. A.	k. A.	
PIMCO Global Core Asset Allocation Fund	0,95	1,12	2,15	k. A.	k. A.	
Global High Yield Bond Fund	0,55	0,72	1,45	0,80	k. A.	
Global Investment Grade Credit Fund	0,49	0,66	1,39	0,76	0,39	
Global Investment Grade Credit ESG Fund	0,52	k. A.	1,42	k. A.	k. A.	
Global Low Duration Real Return Fund	0,49	k. A.	1,39	k. A.	k. A.	
Global Real Return Fund	0,49	0,66	1,39	0,76	k. A.	
Income Fund	0,55	0,72	1,45	0,80	k. A.	
Income Fund II ⁽⁶⁾	0,55	k. A.	1,45	k. A.	k. A.	
Inflation Multi-Asset Fund	0,79	0,96	1,69	k. A.	k. A.	
Low Average Duration Fund	0,46	0,63	1,36	0,75	k. A.	
Low Duration Global Investment Grade Credit Fund	0,49	k. A.	1,39	k. A.	k. A.	
Low Duration Income Fund ⁽⁷⁾	0,55	0,72	1,45	k. A.	k. A.	

	Klassen Inst1, G Inst1, Inv. Admin (%)	H Inst1 (%)	BE Retail BM Retail BN Retail Klassen E, G Retail, M Retail, N Retail, T (%)	Class R (%)	Class W (%)
Low Duration Opportunities Fund	0,49	k. A.	1,20	k. A.	k. A.
Low Duration Opportunities ESG Fund	0,52	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	0,99	k. A.	1,89	k. A.	k. A.
Mortgage Opportunities Fund	0,69	0,86	1,59	k. A.	k. A.
StocksPLUS™ Fund	0,55	0,72	1,45	k. A.	k. A.
PIMCO StocksPLUS™ AR Fund	0,69	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
Strategic Income Fund	0,79	k. A.	1,69	k. A.	k. A.
Total Return Bond Fund	0,50	0,67	1,40	0,77	k. A.
PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	1,40	1,57	2,50	k. A.	k. A.
UK Corporate Bond Fund	0,46	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
UK Long Term Corporate Bond Fund	0,46	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
US High Yield Bond Fund	0,55	0,72	1,45	0,80	k. A.
US Investment Grade Corporate Bond Fund	0,49	0,66	1,39	k. A.	k. A.
US Short-Term Fund ⁽¹⁾	0,45	0,62	0,85	k. A.	k. A.

⁽¹⁾ Diese Zahl berücksichtigt den Verzicht auf Gebühren der Verwaltungsgesellschaft in Höhe von 0,05 % für die Investor Class vom 31. Mai 2021 bis 31. Mai 2023. Der Gebührenverzicht endet am 1. Juni 2023.

⁽²⁾ Bei allen Klassen ist ein Gebührenverzicht der Verwaltungsgesellschaft in Höhe von 0,30 % p. a. berücksichtigt. Der Gebührenverzicht wird am 1. Juni 2023 auf 0,15 % p. a. gesenkt. Der Gebührenverzicht läuft zum 1. Juni 2024 ab und kann sich bis zu dem Zeitpunkt verlängern, zu dem die Verwaltungsgesellschaft durch vorherige schriftliche Mitteilung an die Anteilhaber des Fonds entscheidet, diese Gebühr aufzuheben oder künftig nicht mehr anzuwenden.

⁽³⁾ Bei der Class H Institutional wird ein Gebührenverzicht der Verwaltungsgesellschaft in Höhe von 0,25 % p. a. berücksichtigt. Der Gebührenverzicht erstreckt sich bis zum 30. Juni 2023 und läuft zum 01. Juli 2023 ab.

⁽⁴⁾ Die Sätze der Klassen Institutional und E berücksichtigen einen Gebührenverzicht der Verwaltungsgesellschaft in Höhe von 0,11 % p. a. ab dem 31. Mai 2021. Der Gebührenverzicht endet am 19. Januar 2024.

⁽⁵⁾ Die Sätze der Klassen Institutional und H Institutional berücksichtigen einen Gebührenverzicht der Verwaltungsgesellschaft in Höhe von 0,14 % p. a. Der Satz der Class E berücksichtigt einen Gebührenverzicht der Verwaltungsgesellschaft in Höhe von 0,54 % p. a. Der Gebührenverzicht läuft am 18. Januar 2024 ab.

⁽⁶⁾ Bei allen Klassen wird bei dieser Zahl ein Gebührenverzicht der Verwaltungsgesellschaft in Höhe von 0,04 % p. a. berücksichtigt. Der Gebührenverzicht lief zum 1. Januar 2023 ab.

⁽⁷⁾ Bei allen Klassen wird bei dieser Zahl ein Gebührenverzicht der Verwaltungsgesellschaft in Höhe von 0,05 % p. a. berücksichtigt. Der Gebührenverzicht für alle Klassen erstreckt sich erstreckte sich bis zum 31. Dezember 2022 und lief zum 1. Januar 2023 ab.

⁽⁸⁾ In den Gebühren für die Klassen E, G Retail und M Retail wird ein Gebührenverzicht der Verwaltungsgesellschaft in Höhe von 0,30 % p. a. berücksichtigt, der sich bis zu dem Zeitpunkt erstreckt, zu dem die Verwaltungsgesellschaft durch vorherige schriftliche Mitteilung an die Anteilhaber des Fonds entscheidet, diesen Gebührenverzicht künftig nicht mehr anzuwenden oder zu reduzieren.

Der Diversified Income ESG Fund, der Emerging Local Bond ESG Fund und der Low Duration Opportunities ESG Fund wurden im Geschäftsjahr aufgelegt.

Die Verwaltungsgebühren für alle Fonds (mit Ausnahme des Inflation Multi-Asset Fund, des PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund und des Strategic Income Fund) blieben gegenüber dem 31. Dezember 2021 unverändert, mit Ausnahme der oben genannten Änderungen in Bezug auf den Gebührenverzicht.

Die Verwaltungsgebühren für alle Fonds (mit Ausnahme des Inflation Multi-Asset Fund, des PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund und des Strategic Income Fund) blieben gegenüber dem 31. Dezember 2021 unverändert, mit Ausnahme der oben genannten Änderungen in Bezug auf den Gebührenverzicht.

Die Verwaltungsgebühr für die Anteilsklassen H Institutional, BE Retail, BM Retail, BN Retail, E, G Retail, M Retail, N Retail und T fällt allgemein höher aus als die Verwaltungsgebühr für die anderen Anteilsklassen. Aus dieser höheren Gebühr kann die Verwaltungsgesellschaft die Kosten für Vertriebs-, Mittler- oder andere Dienste begleichen, die Vertriebsstellen, Wertpapierhändler, Banken, Finanzintermediäre oder andere Intermediäre den Anteilhabern dieser Anteilsklassen der Fonds direkt oder indirekt erbringen. Da es sich bei der Verwaltungsgebühr um einen festen Betrag handelt, wird das Risiko von Preiserhöhungen bei den Kosten für durch die Verwaltungsgebühr abgedeckte Dienste von der Verwaltungsgesellschaft und nicht von den Anteilhabern getragen. Die Verwaltungsgesellschaft trägt darüber hinaus das Risiko, dass das Ausgabenniveau für diese Dienste aufgrund eines sinkenden Nettovermögens die Höhe der Verwaltungsgebühr übersteigt. Auf der anderen Seite können alle Preissenkungen für von der Verwaltungsgebühr

abgedeckte Dienste der Verwaltungsgesellschaft und nicht den Anteilhabern zugute. Dies betrifft u. a. geringere Kosten (in Prozent des Nettovermögens) aufgrund eines steigenden Nettovermögens.

Aufgrund der Art der Emission von Class Z wird in der Betriebsergebnisrechnung keine Verwaltungsgebühr ausgewiesen (die Class Z werden primär für andere Fonds der Gesellschaft oder für Direktanlagen durch institutionelle Anleger angeboten, die mit den Anlageberatungsgesellschaften oder einem verbundenen Unternehmen von PIMCO eine Anlageverwaltungsvereinbarung oder sonstige Vereinbarung abgeschlossen haben). Um doppelte Gebühren zu vermeiden, wird die Verwaltungsgebühr für die Class Z auf 0,00 % pro Jahr festgesetzt.

(c) Anlageberatungsdienste

Im Namen der Gesellschaft erbringt bzw. veranlasst die Verwaltungsgesellschaft Anlageberatungsdienstleistungen. Zu diesen Dienstleistungen gehören die Anlage und Wiederanlage der Vermögenswerte jedes Fonds. Die Gebühren der Anlageberatungsgesellschaften (zuzüglich gegebenenfalls hierauf anfallender MwSt.) werden von der Verwaltungsgesellschaft aus der Verwaltungsgebühr beglichen.

(d) Administrations-, Verwahr- sowie sonstige Dienste

Im Namen der Gesellschaft erbringt bzw. veranlasst die Verwaltungsgesellschaft Administrations-, Verwahr- und sonstige Dienste. Zu diesen Dienstleistungen gehören Administrations- und Transferstellenfunktionen, Fondsbuchhaltung sowie die Funktion als Verwahrstelle und Unterverwahrstelle in Bezug auf die einzelnen Fonds. Die Gebühren und Aufwendungen des Administrators und der Verwahrstelle (zuzüglich gegebenenfalls hierauf anfallender MwSt.) werden von der Verwaltungsgesellschaft aus der Verwaltungsgebühr bzw. von den Anlageberatungsgesellschaften gezahlt.

Die Verwaltungsgesellschaft erbringt und/oder beschafft im Auftrag der Gesellschaft bestimmte andere Dienstleistungen. Diese können enthalten: Dienste von Notierungsmaklern, Zahlstellen und anderen Vertretern vor Ort sowie Buchhaltungs-, Prüf-, Rechts- sowie sonstige Dienste qualifizierter Berater, Gesellschaftssekretärsdienste, Druck-, Veröffentlichungs- und Übersetzungsdienste sowie die Erbringung und Koordination bestimmter Aufsichts-, Administrations- und Anteilhaberdienste, die für den Betrieb der Fonds erforderlich sind. Gebühren und ordentliche Aufwendungen für diese Dienste (zuzüglich gegebenenfalls hierauf anfallender MwSt.) werden von der Verwaltungsgesellschaft oder von den Anlageberatungsgesellschaften für die Verwaltungsgebühr gezahlt.

Die Fonds übernehmen sonstige Aufwendungen im Zusammenhang mit ihrem Betrieb, die nicht von der Verwaltungsgebühr abgedeckt werden und die variieren und die Gesamthöhe der Aufwendungen der Fonds beeinflussen können. Hierzu zählen unter anderem Steuern und staatliche Abgaben, Maklergebühren, Provisionen und sonstige Transaktionskosten (einschließlich u. a. Gebühren und Aufwendungen im Zusammenhang mit Due-Diligence-Prüfungen von Anlagen und potenziellen Anlagen und/oder im Zusammenhang mit Verhandlungen über solche Transaktionen), Fremdfinanzierungskosten einschließlich Zinsaufwand, Gründungskosten, außerordentliche Aufwendungen (wie Prozesskosten und Schadenersatzleistungen) sowie die Gebühren und Aufwendungen der unabhängigen Verwaltungsratsmitglieder der Gesellschaft sowie ihrer Berater.

Die Gesellschaft bezahlte den unabhängigen Verwaltungsratsmitgliedern während des Geschäftsjahres zum 31. Dezember 2022 Honorare in Höhe von 180.000 EUR (31. Dezember 2021: 180.000 EUR). Darüber hinaus werden jedem unabhängigen Verwaltungsratsmitglied alle angemessenen Auslagen erstattet. Nicht unabhängige Verwaltungsratsmitglieder haben keinen Anspruch auf eine gesonderte Vergütung für ihre Tätigkeit als Verwaltungsratsmitglied der Fonds. Die Verwaltungsratsgehälter sind in den „Sonstigen Aufwendungen“ der Betriebsergebnisrechnung enthalten.

In der folgenden Tabelle sind die der Gesellschaft während der Geschäftsjahre zum 31. Dezember 2022 und zum 31. Dezember 2021 von den Abschlussprüfern berechneten Gebühren aufgeführt: Die Gebühren in der nachstehenden Tabelle verstehen sich zuzüglich Mehrwertsteuer.

Vergütung des Abschlussprüfers	31. Dez. 2022	31. Dez. 2021
Prüfung von Gesellschaftsabschlüssen	€ 636.152	€ 567.652
Sonstige Sicherungsdienste	0	0
Steuerberatung	0	0
Dienste außerhalb der Abschlussprüfung	0	0

Servicegebühr Die Servicegebühr, die ausschließlich für die Investor Classes anfällt, ist an die Verwaltungsgesellschaft zu zahlen und darf verwendet werden, um Wertpapierhändler, Finanzintermediäre oder sonstige Intermediäre zu vergüten, die Dienste im Zusammenhang mit dem Vertrieb und der Vermarktung von Anteilen erbringen und/oder für die Erbringung bestimmter Anteilhaberdienstleistungen oder für die Verwaltung von Plänen oder Programmen, die Fondsanteile als Finanzierungsmittel verwenden, und um sonstige verbundene Aufwendungen (wie in der Ergänzung für den jeweiligen Fonds definiert) zu erstatten. Die Verwaltungsgesellschaft erbringt diese Dienstleistungen direkt oder indirekt über Wertpapierhändler, Finanzintermediäre oder sonstige Intermediäre für alle Anteilhaber der

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)

Investor Classes. Alle Anteilhaber der Investor Classes erhalten identische Dienstleistungen für die erhobenen Gebühren. Diese Dienste können beinhalten: die Beantwortung von Anteilhaberanfragen zu den Fonds und ihrer Wertentwicklung, die Unterstützung von Anteilhabern beim Erwerb, der Rücknahme und dem Tausch von Anteilen, die Führung von individueller Kontoinformationen und die Bereitstellung von Kontoauszügen an die Anteilhaber sowie die Führung sonstiger Unterlagen, die für die Anlage der Anteilhaber im Fonds relevant sind.

Pläne oder Programme, die Fondsanteile als Finanzierungsmittel verwenden, können fondsgebundene Versicherungsprodukte sowie Pensions-, Altersversorgungs- oder Sparpläne von Arbeitgebern beinhalten. Alle Anteilhaber der Investor Classes erhalten Dienstleistungen entsprechend den Vereinbarungen mit den Finanzintermediären, mit denen die Anteilhaber ein Dienstleistungsverhältnis unterhalten. Die Servicegebühr errechnet sich aus 0,35 % p. a. des NIW des jeweiligen Fonds, der auf die Investor Classes entfällt. Die Servicegebühr hat sich seit dem 31. Dezember 2021 nicht geändert. Die Servicegebühr wird aus dem NIW gezahlt, der auf den NIW der Investor Classes dieser Fonds entfällt. Die Servicegebühr für die einzelnen Fonds läuft an jedem Handelstag auf und ist monatlich im Nachhinein zahlbar. Die Verwaltungsgesellschaft darf zu ihrer eigenen Verwendung etwaige Servicegebühren ganz oder teilweise einbehalten, die nicht an Wertpapierhändler, Banken, Finanzintermediäre oder sonstige Intermediäre zu zahlen sind.

Bestandspflegegebühr Die Bestandspflegegebühr für Administrative Classes ist zahlbar an die Vertriebsstelle für persönliche Dienstleistungen, die sie den Anteilhabern der Fonds erbringt, und für die Führung der Anteilhaberkonten, einschließlich der Vergütung und der Aufwendungen (einschließlich Telefonkosten und Gemeinkosten) von Finanzberatern und sonstigen Mitarbeitern beteiligter oder involvierter Händler, bestimmter Banken oder anderer Finanzintermediäre, die bei der Abwicklung von Kauf- oder Rücknahmeanträgen oder der Abwicklung von Dividendenzahlungen unterstützend tätig sind, den Anteilhabern regelmäßig Informationen über ihre Beteiligung an den Fondsanteilen liefern, Informationen von der Gesellschaft an die Anteilhaber weitergeben, laufende Beratungsleistungen in Bezug auf die Eignung bestimmter vom Fonds angebotener Anlagemöglichkeiten vor dem Hintergrund der Anteilhaberanforderungen erbringen, Anfragen der Anteilhaber zu diesen Diensten beantworten oder Mitarbeiter für die Erbringung derartiger Dienste schulen.

Die Vertriebsstelle erbringt diese Dienste direkt oder indirekt über Wertpapierhändler, Banken, Finanzintermediäre oder sonstige Intermediäre für alle Inhaber von Administrative Classes. Die Bestandspflegegebühr wird auf der Grundlage von 0,50 % p. a. des auf die Administrative Classes entfallenden NIW der einzelnen Fonds berechnet, mit Ausnahme des StocksPLUSTM Fund, bei dem sie auf der Grundlage von 0,75 % p. a. berechnet wird. Die Bestandspflegegebühr für die einzelnen Fonds läuft an jedem Handelstag auf und ist monatlich rückwirkend zahlbar. Die Vertriebsstelle darf zu ihrer eigenen Verwendung etwaige Bestandspflegegebühren ganz oder teilweise einbehalten, die nicht an Wertpapierhändler, Banken, Finanzintermediäre oder sonstige Intermediäre zu zahlen sind.

Die Bestandspflegegebühr hat sich seit dem 31. Dezember 2021 nicht geändert.

(e) Vertriebsgebühr

Die Vertriebsgebühr, die für die Anteile der Klassen T, BN Retail, BM Retail und BE Retail anwendbar ist, wird an die Vertriebsstelle für Dienstleistungen bezahlt, die diese Anteilhabern der Fonds erbracht hat.

Die Vertriebsstelle erbringt diese Dienste direkt oder indirekt über Wertpapierhändler, Banken, Finanzintermediäre oder sonstige Intermediäre für alle Inhaber von Anteilen der Class T. Die Vertriebsgebühr errechnet sich aus 0,40 % p. a. des NIW des jeweiligen Fonds, der auf die Anteile der Class T entfällt, außer in Bezug auf den PIMCO Asia High Yield Bond Fund, den PIMCO Credit Opportunities Bond Fund, den Dynamic Bond Fund, den Euro Bond Fund, den Global Bond Fund, den Global Bond ESG Fund, den Global Bond Ex-US Fund, den Global Low Duration Real Return Fund, den Global Real Return Fund, den Low Duration Opportunities Fund, den PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund und den Total Return Bond Fund. Für diese Fonds wird eine Vertriebsgebühr in Höhe von 0,30 % p. a. des NIW bezahlt, der den Anteilen der Class T zuzurechnen ist.

Lediglich in Bezug auf die Anteilsklassen BE Retail, BM Retail und BN Retail kann die Vertriebsgebühr, sofern in der entsprechenden Ergänzung angegeben, bis zu 1 % des NIW betragen, so dass die Gesamtgebühr 2,50 % des NIW übersteigen kann.

Die Vertriebsgebühr für die einzelnen Fonds läuft an jedem Handelstag auf und ist monatlich im Nachhinein zahlbar. Die Vertriebsstelle darf zu ihrer eigenen Verwendung etwaige Vertriebsgebühren ganz oder teilweise einbehalten, die nicht an Wertpapierhändler, Banken, Finanzintermediäre oder sonstige Intermediäre zu zahlen sind.

(f) Ausgabenbegrenzung (einschließlich Verzicht auf und Nachzahlung von Verwaltungsgebühren)

Gemäß der geltenden Fassung des Verwaltungsvertrags zwischen der Gesellschaft und der Verwaltungsgesellschaft vom 28. Januar 1998 ist die Verwaltungsgesellschaft mit der Gesellschaft übereingekommen, die gesamten jährlichen Betriebskosten eines Fonds für alle Klassen des Fonds zu verwalten, wobei sie auf ihre Verwaltungsgebühr ganz oder teilweise verzichtet bzw. diese ganz oder teilweise reduziert oder erstattet, falls (und für den Zeitraum, in dem) diese Betriebskosten aufgrund gezahlter Gründungskosten sowie anteiliger Verwaltungsrats honorare die Summe aus der Verwaltungsgebühr der Klasse dieses Fonds (vor Anrechnung eines etwa anwendbaren Verzichts auf die Verwaltungsgebühr) aus etwa anfallenden Service- und Bestandspflegegebühren sowie aus sonstigen von dieser Fondsklasse zu tragenden Kosten, die die oben beschriebene Verwaltungsgebühr nicht abdeckt, (ausgenommen Gründungskosten und anteilige Verwaltungsrats honorare) zzgl. 0,0049 % p. a. (täglich auf Basis des Fonds-NIW berechnet) überschreiten.

In jedem Monat, in dem der Verwaltungsvertrag gilt, darf die Verwaltungsgesellschaft von einem Fonds einen beliebigen Anteil der Verwaltungsgebühr wiedererlangen, auf die sie während der vorangegangenen 36 Monate gemäß dem Verwaltungsvertrag verzichtet bzw. die sie in diesem Zeitraum gemäß dem Verwaltungsvertrag reduziert oder erstattet hat (der „Erstattungsbeitrag“), vorausgesetzt dieser an die Verwaltungsgesellschaft gezahlte Betrag erfüllt folgende Bedingungen: 1) Er darf pro Jahr 0,0049 % des durchschnittlichen (täglich berechneten) Nettovermögens der Klasse des betreffenden Fonds nicht überschreiten; 2) er liegt nicht über dem Gesamterstattungsbeitrag; 3) er enthält keine der Verwaltungsgesellschaft zuvor erstatteten Beträge; bzw. 4) er führt nicht dazu, dass eine Klasse eines Fonds einen negativen Nettoertrag behält.

Die in der Betriebsergebnisrechnung angegebene Verwaltungsgebühr wird vor Berücksichtigung des jeweils gegebenenfalls gewährten Verzichts auf Verwaltungsgebühren angegeben. Die Verzicht auf Verwaltungsgebühren werden in der Betriebsergebnisrechnung unter Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft ausgewiesen. Die Verwaltungsgebühr wird der Verwaltungsgesellschaft nach Berücksichtigung des Verzichts gezahlt.

14. TRANSAKTIONEN ZWISCHEN HINTERBUNDENEN PARTEIEN

Bei der Verwaltungsgesellschaft, den Anlageberatungsgesellschaften, den Vertriebsstellen und den Verwaltungsratsmitgliedern handelt es sich um verbundene Parteien. An diese Parteien gegebenenfalls zahlbare Gebühren werden in Erläuterung 13 offengelegt.

Zum 31. Dezember 2022 hielt die Verwaltungsgesellschaft 1.786.291 (31. Dezember 2021: 2.203.631) Anteile des US Short-Term Fund.

Jeder der Fonds kann in die anderen Fonds der Gesellschaft und/oder andere Organismen für gemeinsame Anlagen investieren, die von der Anlageberatungsgesellschaft oder mit dieser verbundenen Unternehmen verwaltet werden („verbundene Fonds“).

Die folgenden Fonds hielten im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 und 31. Dezember 2021 Überkreuzinvestitionen innerhalb des Umbrella-Fonds. Diese Überkreuzinvestitionen innerhalb des Umbrella-Fonds wurden zum Zweck der Darstellung der Summe der Fonds der Gesellschaft eliminiert.

	31. Dez. 2022
	Überkreuzinvestitionen innerhalb des Umbrella-Fonds
Fonds	
Diversified Income Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund
Diversified Income Fund	Asia Strategic Interest Bond Fund
Diversified Income Fund	PIMCO European High Yield Bond Fund
Diversified Income Fund	US Short-Term Fund
Diversified Income Duration Hedged Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund
Diversified Income Duration Hedged Fund	Asia Strategic Interest Bond Fund
Diversified Income Duration Hedged Fund	PIMCO European High Yield Bond Fund
Diversified Income Duration Hedged Fund	US Short-Term Fund
Dynamic Bond Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund
Dynamic Bond Fund	Asia Strategic Interest Bond Fund
Dynamic Bond Fund	US Short-Term Fund
Dynamic Multi-Asset Fund	PIMCO Capital Securities Fund
Dynamic Multi-Asset Fund	Income Fund
Dynamic Multi-Asset Fund	PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund
Emerging Local Bond Fund	Asia Strategic Interest Bond Fund
Emerging Local Bond Fund	Emerging Local Bond ESG Fund

31. Dez. 2022	
Fonds	Überkreuzinvestitionen innerhalb des Umbrella-Fonds
Emerging Local Bond Fund	PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund
Emerging Markets Bond Fund	PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund
Euro Income Bond Fund	PIMCO European High Yield Bond Fund
Global Bond Fund	PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund
Global Bond Fund	Global Bond Ex-US Fund
Global Bond Fund	PIMCO European High Yield Bond Fund
Global Bond Fund	UK Corporate Bond Fund
Global Bond Fund	US Short-Term Fund
Global Bond ESG Fund	Global Investment Grade Credit ESG Fund
Global High Yield Bond Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund
Global High Yield Bond Fund	PIMCO European High Yield Bond Fund
Global Investment Grade Credit Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund
Global Investment Grade Credit Fund	Asia Strategic Interest Bond Fund
Global Investment Grade Credit Fund	PIMCO European High Yield Bond Fund
Low Average Duration Fund	US Short-Term Fund
Low Duration Opportunities Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund
Low Duration Opportunities Fund	Asia Strategic Interest Bond Fund
Total Return Bond Fund	US Short-Term Fund
US High Yield Bond Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund

31. Dez. 2021	
Fonds	Überkreuzinvestitionen innerhalb des Umbrella-Fonds
Diversified Income Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund
Diversified Income Fund	Asia Strategic Interest Bond Fund
Diversified Income Fund	PIMCO European High Yield Bond Fund
Diversified Income Fund	US Short-Term Fund
Diversified Income Duration Hedged Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund
Diversified Income Duration Hedged Fund	Asia Strategic Interest Bond Fund
Diversified Income Duration Hedged Fund	PIMCO European High Yield Bond Fund
Diversified Income Duration Hedged Fund	US Short-Term Fund
Dynamic Bond Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund
Dynamic Bond Fund	Asia Strategic Interest Bond Fund
Dynamic Bond Fund	US Short-Term Fund
Dynamic Multi-Asset Fund	PIMCO Capital Securities Fund
Dynamic Multi-Asset Fund	Income Fund
Emerging Local Bond Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund
Emerging Local Bond Fund	Asia Strategic Interest Bond Fund
Emerging Markets Bond Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund
Emerging Markets Bond Fund	Asia Strategic Interest Bond Fund
Euro Income Bond Fund	PIMCO European High Yield Bond Fund
Euro Income Bond Fund	US Short-Term Fund
Global Bond Fund	PIMCO European High Yield Bond Fund
Global Bond Fund	Global Bond Ex-US Fund
Global Bond Fund	UK Corporate Bond Fund
Global Bond Fund	US Short-Term Fund
Global Bond ESG Fund	Global Investment Grade Credit ESG Fund
PIMCO Global Core Asset Allocation Fund	Mortgage Opportunities Fund
Global High Yield Bond Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund
Global High Yield Bond Fund	PIMCO European High Yield Bond Fund
Global Investment Grade Credit Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund
Global Investment Grade Credit Fund	Asia Strategic Interest Bond Fund
Global Investment Grade Credit Fund	PIMCO European High Yield Bond Fund
Low Average Duration Fund	US Short-Term Fund
Low Duration Opportunities Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund
Low Duration Opportunities Fund	Asia Strategic Interest Bond Fund
Total Return Bond Fund	US Short-Term Fund
US High Yield Bond Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund
US Investment Grade Corporate Bond Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund
US Investment Grade Corporate Bond Fund	Asia Strategic Interest Bond Fund

Bestimmte Fonds investieren in die Class Z des PIMCO China Bond Fund, eines Fonds von PIMCO Specialty Funds Ireland p.l.c., und in den PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund, eines Fonds von PIMCO Select Funds plc, die als verbundene Fonds gelten. Aufgrund der Ausgestaltung des Angebots der Class Z und um doppelte Gebühren zu vermeiden, beträgt die Verwaltungsgebühr für die Class Z beider Fonds 0,00 % pro Jahr.

Bestimmte Fonds investieren in die Fonds von PIMCO ETFs plc: den PIMCO Euro Short-Term High Yield Corporate Bond Index UCITS ETF, den PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF, den PIMCO Sterling Short Maturity UCITS ETF und den PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF, und diese gelten als verbundene Fonds. Da diese Fonds keine gebührenfreien Anteilsklassen haben, wird die Verwaltungsgebühr vom Dachfonds und vom zugrunde liegenden verbundenen Fonds bezahlt. Ein Verzicht auf die Anlageberatungsgebühr wird daher vor der Zahlung durch den Fonds an die Verwaltungsgesellschaft ausgeglichen, was in der Betriebsergebnisrechnung innerhalb der Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft ausgewiesen wird.

Während der Geschäftsjahre zum 31. Dezember 2022 und zum 31. Dezember 2021 kauften und verkauften die unten erwähnten Fonds Wertpapiere verbundener Fonds, sie nahmen Käufe und Verkäufe in Bezug auf Überkreuzinvestitionen und Käufe und Verkäufe von Anlagen in verbundenen Fonds vor (Angaben in Tausend):

Fonds	31. Dez. 2022	
	Käufe	Verkäufe
PIMCO Asia High Yield Bond Fund	\$ 908.623	\$ 895.972
Asia Strategic Interest Bond Fund	129.084	124.231
PIMCO Capital Securities Fund	190.635	542.608
PIMCO Climate Bond Fund	449	22.179
Commodity Real Return Fund	85.291	5.900
PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	5.183	8.342
Diversified Income Fund	638.902	1.645.597
Diversified Income Duration Hedged Fund	75.129	141.980
Diversified Income ESG Fund	200	200
Dynamic Bond Fund	441.881	264.103
Dynamic Multi-Asset Fund	104.045	26.348
Emerging Local Bond Fund	1.837.395	1.892.204
Emerging Markets Bond Fund	1.462.642	1.981.418
Emerging Markets Bond ESG Fund	210.705	83.931
Emerging Markets Corporate Bond Fund	92.941	88.297
PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	119.731	128.393
Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	1.000	1.438
Euro Bond Fund	265.381	223.907
Euro Credit Fund	80.580	117.241
Euro Income Bond Fund	254.310	373.646
Euro Long Average Duration Fund	19.622	16.672
Euro Short-Term Fund	71.651	76.393
PIMCO European High Yield Bond Fund	12.406	8.873
PIMCO European Short-Term Opportunities Fund	39.660	47.565
Global Advantage Fund	153.288	145.735
Global Bond Fund	1.056.550	1.129.083
Global Bond ESG Fund	9.751	15.801
Global Bond Ex-US Fund	641.210	604.043
PIMCO Global Core Asset Allocation Fund	680.984	811.602
Global High Yield Bond Fund	727.445	1.125.258
Global Investment Grade Credit Fund	3.785.028	4.629.158
Global Investment Grade Credit ESG Fund	87.522	194.414
Global Low Duration Real Return Fund	232.291	226.698
Global Real Return Fund	837.486	812.145
Income Fund	1.603.346	2.928.690
Income Fund II	15.740	16.700
Inflation Multi-Asset Fund	87.463	56.410
Low Average Duration Fund	552.743	550.289
Low Duration Global Investment Grade Credit Fund	359.824	340.371
Low Duration Income Fund	181.275	178.894
Low Duration Opportunities Fund	491.198	704.279
Low Duration Opportunities ESG Fund	100	100
PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	21.008	18.700

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)

Fonds	31. Dez. 2022	
	Käufe	Verkäufe
Mortgage Opportunities Fund	\$ 1.108.810	\$ 1.242.395
StocksPLUS™ Fund	150.012	544.833
PIMCO StocksPLUS™ AR Fund	410	600
Strategic Income Fund	339.690	329.066
Total Return Bond Fund	447.487	642.290
PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	116.658	79.650
UK Corporate Bond Fund	12.034	18.983
UK Long Term Corporate Bond Fund	33.666	11.074
US High Yield Bond Fund	909.401	1.318.576
US Investment Grade Corporate Bond Fund	344.028	348.295
US Short-Term Fund	498.555	563.279

Fonds	31. Dez. 2021	
	Käufe	Verkäufe
PIMCO Asia High Yield Bond Fund	\$ 930.487	\$ 627.852
Asia Strategic Interest Bond Fund	165.995	157.516
PIMCO Capital Securities Fund	842.578	1.282.906
PIMCO Climate Bond Fund	12.181	36.255
Commodity Real Return Fund	85.802	2.857
PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	48.254	56.216
Diversified Income Fund	709.844	846.494
Diversified Income Duration Hedged Fund	162.297	194.020
Dynamic Bond Fund	685.201	652.706
Dynamic Multi-Asset Fund	68.805	0
Emerging Local Bond Fund	2.803.551	3.028.245
Emerging Markets Bond Fund	2.226.141	2.506.979
Emerging Markets Bond ESG Fund	400.193	195.636
Emerging Markets Corporate Bond Fund	125.375	117.717
PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	146.141	149.062
Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	5.796	5.138
PIMCO ESG Income Fund	38.088	37.501
Euro Bond Fund	409.047	675.330
Euro Credit Fund	244.089	268.477
Euro Income Bond Fund	289.126	338.915
Euro Long Average Duration Fund	9.199	18.917
Euro Short-Term Fund	130.792	29.055
PIMCO European High Yield Bond Fund	0	10.407
PIMCO European Short-Term Opportunities Fund	78.910	54.093
Global Advantage Fund	133.329	132.261
Global Bond Fund	1.872.859	1.915.889
Global Bond ESG Fund	31.687	59.669
Global Bond Ex-US Fund	321.477	316.136
PIMCO Global Core Asset Allocation Fund	558.323	413.432
Global High Yield Bond Fund	1.747.596	1.870.595
Global Investment Grade Credit Fund	6.186.283	9.924.519
Global Investment Grade Credit ESG Fund	147.939	108.832
Global Low Duration Real Return Fund	220.996	234.412
Global Real Return Fund	545.874	423.198
Income Fund	15.696.715	15.975.225
Income Fund II	7.602	4.900
Inflation Multi-Asset Fund	83.666	70.300
Low Average Duration Fund	246.591	234.632
Low Duration Global Investment Grade Credit Fund	267.013	155.242
Low Duration Income Fund	338.363	223.065
Low Duration Opportunities Fund	1.085.237	858.876
PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	44.210	35.000
Mortgage Opportunities Fund	2.344.185	2.305.270
StocksPLUS™ Fund	205.747	165.929
PIMCO StocksPLUS™ AR Fund	701	400
Strategic Income Fund	350.865	387.451
Total Return Bond Fund	872.762	1.201.072
PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	30.407	29.700
UK Corporate Bond Fund	13.283	261.176
UK Long Term Corporate Bond Fund	\$ 9.780	\$ 31.686
US High Yield Bond Fund	1.675.695	1.761.476

Fonds	31. Dez. 2021	
	Käufe	Verkäufe
US Investment Grade Corporate Bond Fund	248.414	288.579
US Short-Term Fund	74.780	775.389

Die folgende Tabelle zeigt den Wert der umlaufenden Anteile im Besitz der Allianz-Gruppe, von Fonds der Gesellschaft, von mit der Gesellschaft verbundenen Fonds und von Mitarbeitern der Anlageberatungsgesellschaften in ihrer Eigenschaft als verbundene Parteien der Gesellschaft. Dabei handelt es sich zum 31. Dezember 2022 und zum 31. Dezember 2021 um über 20 % des Nettovermögens des Fonds.

Fonds	31. Dez. 2022	31. Dez. 2021
	% Gehalten	% Gehalten
PIMCO Asia High Yield Bond Fund	21,53	k. A.
Asia Strategic Interest Bond Fund	49,24	55,13
PIMCO Capital Securities Fund	23,94	k. A.
PIMCO Climate Bond Fund	21,78	k. A.
PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	25,65	25,07
Diversified Income ESG Fund	100,00	k. A.
Dynamic Multi-Asset Fund	25,10	k. A.
Emerging Local Bond ESG Fund	100,00	k. A.
Emerging Markets Bond Fund	22,87	34,74
PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	57,57	k. A.
Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	26,22	22,84
Euro Credit Fund	30,16	20,77
Euro Income Bond Fund	21,29	26,26
PIMCO European High Yield Bond Fund	98,78	95,52
PIMCO European Short-Term Opportunities Fund	31,55	k. A.
PIMCO Global Core Asset Allocation Fund	65,44	34,62
Income Fund II	40,67	91,35
Inflation Multi-Asset Fund	29,48	k. A.
Low Duration Opportunities ESG Fund	100,00	k. A.
PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	50,65	k. A.
PIMCO StocksPLUS™ AR Fund	84,86	94,07
Strategic Income Fund	47,13	k. A.
US Short-Term Fund	31,95	38,70

Fonds, bei denen Anteilhaber mehr als 20 % des Nettovermögens des Fonds besitzen, werden in Erläuterung 16 gesondert ausgewiesen; davon ausgenommen sind die Allianz-Gruppe, Fonds der Gesellschaft, mit der Gesellschaft verbundene Fonds und Mitarbeiter der Anlageberatungsgesellschaften.

Während des Geschäftsjahres zum 31. Dezember 2022 verkaufte der Income Fund Wertpapiere im Wert von 136.931 USD (31. Dezember 2021: USD null) an Repack Bond Collateral Ltd. (die „Körperschaft“), eine nach dem Recht der Kaimaninseln gegründete befreite Gesellschaft mit beschränkter Haftung, die eine verbundene Partei der Anlageberatungsgesellschaft ist. Es wurden keine Gebühren von der Körperschaft an die Anlageberatungsgesellschaft gezahlt. Zum 31. Dezember 2022 hielt der Income Fund 9.694 Schuldverschreibungen (31. Dezember 2021: 9.694 Schuldverschreibungen) von BNP Paribas Issuance BV., die durch von der Körperschaft begebene Schuldverschreibungen besichert sind. Während des Geschäftsjahres zahlte die Körperschaft dem Income Fund Ausschüttungen in Höhe von insgesamt 43.624 USD (31. Dezember 2021: 32.746 USD) und Drawdowns in Höhe von 0 USD (31. Dezember 2021: 260.225 USD).

Beteiligungen der Verwaltungsratsmitglieder und des Sekretärs an Anteilen und Verträgen

Zum 31. Dezember 2022 hielt V. Mangala Ananthanarayanan 8.187,77 (31. Dezember 2021: 8.187,77) Anteile des PIMCO Asia High Yield Bond Fund, 5.319,15 (31. Dezember 2021: 0) Anteile des PIMCO Capital Securities Fund, 8.757,87 (31. Dezember 2021: 8.757,87) Anteile des Dynamic Multi-Asset Fund, 3.619,69 (31. Dezember 2021: 0) Anteile des Emerging Markets Bond Fund und 27.543,65 (31. Dezember 2021: 22.028,26) Anteile des Income Fund, wobei es sich jeweils um Fonds der Gesellschaft handelt.

Zum 31. Dezember 2022 hielt Ryan P. Blute 5.387,93 (31. Dezember 2021: 5.387,93) Anteile des PIMCO Asia High Yield Bond Fund, 24.131,27 (31. Dezember 2021: 24.131,27) Anteile des Low Average Duration Fund und 82.494,63 (31. Dezember 2021: 72.957,20) Anteile des Low Duration Income Fund, wobei es sich jeweils um Fonds der Gesellschaft handelt.

Zum 31. Dezember 2022 hielt Craig A. Dawson 18.118,23 (31. Dezember 2021: 18.118,23) Anteile des PIMCO Capital Securities Fund, 97.370,98 (31. Dezember 2021: 97.370,98) Anteile des Duration Income Fund und 92.850,51 (31. Dezember 2021: 92.850,51) Anteile des Low Duration Opportunities Fund, wobei es sich jeweils um Fonds der Gesellschaft handelt.

Zum 31. Dezember 2022 hielt David M. Kennedy 4.449,56 (31. Dezember 2021: 4.729,05) Anteile des Emerging Markets Bond Fund und 16.786,79 (31. Dezember 2021: 16.786,79) Anteile des PIMCO Global Core Allocation Fund. Beide sind Fonds der Gesellschaft.

Während der zum 31. Dezember 2022 und 31. Dezember 2021 endenden Geschäftsjahre hielt kein anderes Verwaltungsratsmitglied eine Beteiligung an Anteilen der Gesellschaft.

Während der zum 31. Dezember 2022 und 31. Dezember 2021 endenden Geschäftsjahre hielt der Sekretär keine Beteiligung an Anteilen der Gesellschaft.

Die Gesellschaft hatte während der Geschäftsjahre zum 31. Dezember 2022 oder 31. Dezember 2021 keine Angestellten.

15. WECHSELKURSE

Um einen gemeinsamen Abschluss und Finanzdaten für die Gesellschaft zu erhalten (was nach irischem Gesellschaftsrecht erforderlich ist), wurden die Beträge im Finanzstatus zu dem am 31. Dezember 2022 geltenden Wechselkurs von Euro in US-Dollar (USD/EUR 0,93699) umgerechnet (31. Dezember 2021: USD/EUR 0,87935) und von Pfund Sterling in US-Dollar (USD/GBP 0,83132) (31. Dezember 2021: USD/GBP 0,73831) umgerechnet. Die Beträge in der Betriebsergebnisrechnung und im Ausweis der Nettovermögensänderungen wurden zu einem durchschnittlichen während des am 31. Dezember 2022 endenden Geschäftsjahres geltenden Wechselkurs von Euro in US-Dollar (USD/EUR 0,95111) (31. Dezember 2021: USD/EUR 0,84577) und von Pfund Sterling in US-Dollar (USD/GBP 0,81159) (31. Dezember 2021: USD/GBP 0,72716) umgerechnet.

Die folgende Tabelle gibt die für die Umrechnung der Anlagen und sonstigen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten, die auf von der Funktionswährung des jeweiligen Fonds abweichende Währungen lauten, in Pfund Sterling, Euro und US-Dollar, die Funktionswährungen von Fonds der Gesellschaft, verwendeten Wechselkurse wieder.

Der Wechselkurs für den Argentinischen Peso („ARS“) zum 31. Dezember 2022 enthält einen 83%igen Abschlag (31. Dezember 2021: 96 %) aufgrund der Abweichung zwischen dem offiziellen und dem inoffiziellen Wechselkurs Argentiniens.

Fremd-währung	31. Dez. 2022 Präsentationswährung		
	EUR	GBP	USD
AED	k. A.	k. A.	3,67265
ARS	346,74937	k. A.	324,90000
AUD	1,57377	1,77380	1,47460
BRL	5,63481	k. A.	5,27975
CAD	1,44607	1,62987	1,35495
CHF	0,98742	k. A.	0,92520
CLP	909,24323	k. A.	851,95000
CNH	7,38414	8,32269	6,91885
CNY	7,41920	8,36220	6,95170
COP	5.174,97022	k. A.	4.848,88500
CZK	24,15399	k. A.	22,63200
DKK	7,43643	8,38163	6,96785
DOP	k. A.	k. A.	56,22000
EGP	k. A.	k. A.	24,75500
EUR (or €)	1,00000	1,12710	0,93699
GBP (or £)	0,88723	1,00000	0,83132
GHS	k. A.	k. A.	10,20000
HKD	8,32983	k. A.	7,80495
HUF	400,44985	k. A.	375,21670
IDR	16.614,40701	k. A.	15.567,50000
ILS	3,76579	k. A.	3,52850
INR	88,29355	k. A.	82,73000
JPY (or ¥)	140,81824	158,71670	131,94500
KES	k. A.	k. A.	123,40000
KRW	1.349,53703	k. A.	1.264,50000
KZT	k. A.	k. A.	462,72000
MXN	20,79776	23,44122	19,48725
MYR	k. A.	k. A.	4,40500
NGN	k. A.	k. A.	460,75000

Fremd-währung	31. Dez. 2022 Präsentationswährung		
	EUR	GBP	USD
NOK	10,51348	11,84977	9,85100
NZD	1,68748	1,90197	1,58115
PEN	4,06996	k. A.	3,81350
PHP	k. A.	k. A.	55,72750
PLN	4,68122	k. A.	4,38625
RON	k. A.	k. A.	4,63605
RSD	k. A.	k. A.	109,92500
RUB	77,90922	k. A.	73,00000
SEK	11,12021	12,53362	10,41950
SGD	1,43140	1,61333	1,34120
THB	k. A.	k. A.	34,63500
TRY	19,97838	22,51769	18,71950
TWD	32,80245	k. A.	30,73550
UGX	k. A.	k. A.	3.720,00000
USD (or \$)	1,06725	1,20290	1,00000
UYU	k. A.	k. A.	39,76500
VND	k. A.	k. A.	23.575,00000
ZAR	18,15925	k. A.	17,01500
ZMW	k. A.	k. A.	18,07500

Fremd-währung	31. Dez. 2021 Präsentationswährung		
	EUR	GBP	USD
AED	k. A.	k. A.	3,67305
ARS	228,82733	k. A.	201,22000
AUD	1,56413	1,86294	1,37542
BRL	6,33420	k. A.	5,57000
CAD	1,43645	1,71087	1,26315
CHF	1,03616	k. A.	0,91115
CLP	968,89418	k. A.	852,00000
CNH	7,23151	8,61302	6,35905
CNY	7,24777	k. A.	6,37335
COP	4.628,40293	k. A.	4.070,00000
CZK	24,84997	k. A.	21,85190
DKK	7,43757	8,85844	6,54025
DOP	k. A.	k. A.	57,26000
EGP	k. A.	k. A.	15,71000
EUR (or €)	1,00000	1,19104	0,87935
GBP (or £)	0,83960	1,00000	0,73831
GHS	k. A.	k. A.	6,17500
HKD	8,86595	k. A.	7,79630
HUF	368,56496	k. A.	324,09870
IDR	16.207,93925	k. A.	14.252,50000
ILS	3,53942	k. A.	3,11240
INR	84,53448	k. A.	74,33565
JPY (or ¥)	130,95424	155,97170	115,15500
KRW	1.351,84619	k. A.	1.188,75000
KZT	k. A.	k. A.	434,80500
MXN	23,27279	27,71882	20,46500
MYR	k. A.	k. A.	4,16600
NGN	k. A.	k. A.	413,75000
NOK	10,02817	11,94395	8,81830
NZD	1,66099	k. A.	1,46060
PEN	4,53828	k. A.	3,99075
PHP	k. A.	k. A.	50,99250
PLN	4,58337	k. A.	4,03040
RON	k. A.	k. A.	4,35170
RSD	k. A.	k. A.	103,39000
RUB	85,29709	k. A.	75,00625
SEK	10,29604	12,26299	9,05385
SGD	1,53312	1,82600	1,34815
THB	k. A.	k. A.	33,40500
TRY	15,10173	17,98676	13,27975
TWD	31,46291	k. A.	27,66700
UAH	k. A.	k. A.	27,28250

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)

Fremd-währung	31. Dez. 2021		
	EUR	GBP	USD
UGX	k. A.	k. A.	3.545,00000
USD (or \$)	1,13720	1,35445	1,00000
UYU	k. A.	k. A.	44,70000
VND	k. A.	k. A.	22.790,00000
ZAR	18,14971	k. A.	15,96000
ZMW	k. A.	k. A.	16,66810

16. FINANZIELLE RISIKEN

Die Hauptrisiken, die sich aus den Finanzinstrumenten der Gesellschaft ergeben, sind das Marktpreis-, Devisen-, Zinssatz-, Liquiditäts-, Kredit- und Kontrahentenrisiko.

(a) Marktpreisrisiko

Das Marktpreisrisiko ergibt sich im Wesentlichen aus der Unsicherheit hinsichtlich der zukünftigen Kurse der Finanzinstrumente im Bestand. Es stellt den potenziellen Verlust dar, der jedem Fonds entstehen könnte, wenn Marktpositionen bei nachteiligen Kursbewegungen gehalten werden. Die Anlageberatungsgesellschaften prüfen die Vermögensstrukturierung des Portfolios, um das mit bestimmten Ländern oder Industriezweigen verbundene Risiko zu minimieren, während sie weiterhin die Anlageziele der Fonds verfolgen.

Die Anlageberatungsgesellschaften verwenden eine Reihe quantitativer Techniken, um die Auswirkungen von Marktrisiken, einschließlich Kreditereignisse, Zinssatzänderungen, Kreditspreads und Beitreibungswerte, auf das Anlageportfolio der Fonds zu bewerten.

Die Anlageberatungsgesellschaften verwendeten die Risikopotenzialanalyse (Value at Risk, „VaR“), eine von Finanzinstituten weitgehend eingesetzte Technik zur Messung, Bewertung und Darstellung des Marktrisikos. Das VaR ist ein statistischer Rahmen, der die Quantifizierung des Marktrisikos in einem Portfolio mit einem bestimmten Konfidenzintervall in einem festgelegten Haltezeitraum ermöglicht. Bestimmte Fonds dürfen das relative VaR-Modell oder das absolute VaR-Modell verwenden. Bei Einsatz des relativen VaR-Modells darf das Risikopotenzial eines Fondsportfolios das doppelte Risikopotenzial eines vergleichbaren Benchmark-Portfolios oder Referenzportfolios (d. h. eines ähnlichen Portfolios ohne Derivate) nicht überschreiten, welches das angestrebte Anlageverhalten des jeweiligen Fonds wiedergibt. Bei Einsatz des absoluten VaR-Modells darf das Risikopotenzial eines Fondsportfolios 20 % des Nettoinventarwerts des Fonds nicht übersteigen und die Haltedauer beträgt 20 Tage, wobei die Datenhistorie mindestens ein Jahr beträgt. Das VaR soll die erwarteten maximalen Verluste in Dollar messen, die aus dem interaktiven Verhalten aller wesentlichen Marktkurse, Spreads, Schwankungen, Zinssätze sowie anderer Risiken, einschließlich des Devisen-, Zinssatz-, Schwellenmarkt- und Konvexitätsrisikos, die aus den historisch beobachteten Verhältnissen zwischen diesen Märkten resultieren können.

Obwohl der Einsatz von Derivaten zu zusätzlichen Fremdkapitalrisiken führen kann, wird jedes derartige zusätzliche Risiko mithilfe der VaR-Methode in Übereinstimmung mit den Anforderungen der Zentralbank gesichert und gesteuert. Die Anlageberatungsgesellschaften überwachen das Portfoliorisiko täglich mithilfe von Marktfaktoranalysen. Mögliche Marktrisiken

In den folgenden Tabellen werden der minimale, maximale, durchschnittliche VaR und der VaR zum Geschäftsjahresende der einzelnen Fonds zum 31. Dezember 2022 und zum 31. Dezember 2021 aufgeführt:

Fonds	Methode	Vergleichsindex	31. Dez. 2022			Jahresende
			Min.	Max.	Durchschnitt	
PIMCO Asia High Yield Bond Fund	Relativ	JPMorgan JACI Non-Investment Grade Index	86,03 %	109,37 %	96,86 %	88,69 %
Asia Strategic Interest Bond Fund	Relativ	JPMorgan Asia Credit Index	91,44 %	106,49 %	99,71 %	94,95 %
PIMCO Capital Securities Fund	Absolut	n. z.	4,38 %	11,46 %	8,28 %	8,49 %
PIMCO Climate Bond Fund	Absolut	n. z.	2,13 %	4,93 %	3,81 %	4,03 %
Commodity Real Return Fund	Relativ	Bloomberg Commodity Index Total Return	100,90 %	112,80 %	105,31 %	108,93 %
PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	Absolut	n. z.	2,06 %	5,50 %	3,99 %	4,51 %
Diversified Income Fund	Relativ	jeweils 1/3 Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets (USD Hedged), ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index (USD Hedged) und JPMorgan EMBI Global (USD Hedged).	96,68 %	132,63 %	110,21 %	98,82 %
Diversified Income Duration Hedged Fund	Absolut	n. z.	5,07 %	9,35 %	7,23 %	5,76 %
Diversified Income ESG Fund	Relativ	jeweils 1/3 Bloomberg Global Aggregate Credit ex-Emerging Markets, ICE BofAML BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained ESG Tilt Index und JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index Global Diversified	101,85 %	109,31 %	104,88 %	102,63 %
Dynamic Bond Fund	Absolut	n. z.	2,61 %	5,75 %	4,52 %	4,17 %
Dynamic Multi-Asset Fund	Absolut	n. z.	3,85 %	7,74 %	5,08 %	5,84 %

werden mit dem parametrischen delta-normalen oder Faktormodellansatz berechnet. Der VaR wird automatisch jeden Tag anhand der Schlusskurse und Marktinformationen des vorhergehenden Geschäftstags berechnet und berichtet. In Abhängigkeit von der Anwendung der Risikostatistiken könnten verschiedene Konfidenzniveaus (z. B. 99 %) und Zeithorizonte (Wochen oder Monate) ausgewählt werden.

Stresstests werden in Bezug auf das VaR-Modell für jeden Fonds monatlich durchgeführt. Die PIMCO Risk Group überwacht die Zusammensetzung der Stresstests und nimmt die entsprechenden Änderungen vor, wenn dies aufgrund der Marktbedingungen und Zusammensetzung des jeweiligen Fonds angebracht ist. Mit den Stresstests werden potenzielle Gewinne oder Verluste aufgrund von Schocks bei finanziellen Variablen geschätzt, wie unter anderem Nominalzinsen für Staatsanleihen, Nominalzinsen für Swaps, Realzinsen, Credit-Spreads, Aktienbewertungen, Rohstoffwerten, Wechselkurse und implizierte Volatilitäten. Abgesehen von den monatlich durchgeführten Stresstests werden drei zusätzliche Arten von Stresstests durchgeführt, von denen einige täglich und einige interaktiv für Analysen verwendet werden. Der erste Test umfasst einen Szenario-Auswirkungs-Test, der die Auswirkungen von unerwarteten Ertragsbewegungen im Markt auf den Wert des Portfolios ermittelt. Diese Durationen werden an jedem Geschäftstag berechnet. Der zweite Test legt eine Datenbank historischer Krisenszenarien zugrunde und untersucht die Reaktionen auf solche Krisen. Die historischen Krisenszenarien enthalten viele unerwartete Veränderungen der Marktbedingungen und Korrelationsmatrizen. Der dritte Test enthält Korrelationsmatrizen, die manuell verändert werden können, um in der Zukunft mögliche Bedingungen zu simulieren, die bisher allerdings noch nicht eingetreten sind.

Berechnungen werden allgemein mithilfe automatischer Simulationsmethoden durchgeführt. Allerdings sind auch Methoden zur manuellen Überprüfung von Änderungen an den Korrelationsmatrizen vorhanden, die sich auf die Portfolios in erheblichem Umfang negativ auswirken würden. Diese Korrelationsänderungen können dann analysiert werden und mögliche, tatsächlich vorkommende Ereignisse, durch die solche Änderungen verursacht werden, können zugeordnet werden.

Natürlich kann nicht ausgeschlossen werden, dass sich tatsächliche wirtschaftliche Ergebnisse von den manuellen und automatischen Szenarios unterscheiden.

Die täglich ermittelten VaR-Kennzahlen sind eine Schätzung des Portfolioverlustes innerhalb des nächsten Einmonatszeitraums, der in 99 % der Zeit nicht überschritten wird, abhängig von den Annahmen des VaR-Modells.

Nicht alle Risiken, denen das Portfolio ausgesetzt sein konnte, sollen durch den VaR wiedergegeben werden; vor allem beabsichtigt das Rahmenkonzept nicht, Liquiditätsrisiken, Kontrahentenrisiken oder extreme Kreditereignisse wie den Ausfall eines Emittenten zu berücksichtigen. In der Praxis werden die tatsächlichen Handlungsergebnisse vom VaR abweichen und bieten unter Umständen keinen aussagekräftigen Hinweis auf die Gewinne und Verluste unter angespannten Marktbedingungen. Zur Bestimmung der Verlässlichkeit der VaR-Modelle werden die tatsächlichen Ergebnisse überwacht, um die Stichhaltigkeit der für die VaR-Berechnung verwendeten Annahmen und Parameter zu überwachen. Marktrisikopositionen werden ebenfalls regelmäßigen Stresstests unterzogen, um sicherzustellen, dass die einzelnen Fonds einem extremen Marktereignis standhalten können.

Fonds	Methode	Vergleichsindex	31. Dez. 2022			
			Min.	Max.	Durchschnitt	Jahresende
Emerging Local Bond Fund	Relativ	JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (Unhedged)	94,06 %	106,90 %	102,72 %	102,61 %
Emerging Local Bond ESG Fund	Relativ	JPMorgan ESG Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index	92,69 %	108,54 %	97,67 %	99,38 %
Emerging Markets Bond Fund	Relativ	JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global	97,07 %	110,86 %	104,27 %	102,74 %
Emerging Markets Bond ESG Fund	Relativ	JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified	98,21 %	112,18 %	105,42 %	100,17 %
Emerging Markets Corporate Bond Fund	Relativ	JPMorgan Corporate Emerging Markets Bond Index Diversified (CEMBI)	94,77 %	125,73 %	109,89 %	98,72 %
PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	Relativ	50 % JPMorgan EMBI Global Index / 50 % JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (USD Unhedged)	35,81 %	87,96 %	56,92 %	55,69 %
Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	Relativ	JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (Unhedged)	84,87 %	113,34 %	104,07 %	109,06 %
PIMCO ESG Income Fund	Absolut	n. z.	1,77 %	4,63 %	3,24 %	3,81 %
Euro Bond Fund	Relativ	FTSE Euro Broad Investment-Grade Index	91,45 %	107,79 %	101,40 %	102,69 %
Euro Credit Fund	Relativ	Bloomberg Euro-Aggregate Credit Index	102,32 %	122,65 %	110,14 %	104,97 %
Euro Income Bond Fund	Absolut	n. z.	2,86 %	7,88 %	5,99 %	5,55 %
Euro Long Average Duration Fund	Relativ	Bloomberg Euro Government (Germany, France, Netherlands) over 15 years Index	94,30 %	102,20 %	99,42 %	100,39 %
Euro Short-Term Fund	Absolut	n. z.	0,66 %	2,13 %	1,56 %	1,43 %
PIMCO European High Yield Bond Fund	Relativ	ICE BofA Merrill Lynch BB-B European Currency High Yield Constrained Index	90,65 %	106,11 %	99,81 %	101,48 %
PIMCO European Short-Term Opportunities Fund	Absolut	n. z.	2,42 %	4,11 %	3,18 %	3,32 %
Global Advantage Fund	Relativ	PIMCO Global Advantage Bond Index (GLADI) (London Close)	98,46 %	115,01 %	106,86 %	102,35 %
Global Bond Fund	Relativ	Bloomberg Global Aggregate (USD Hedged) Index	86,07 %	112,02 %	101,52 %	102,14 %
Global Bond ESG Fund	Relativ	Bloomberg Global Aggregate (USD Hedged) Index	86,26 %	111,08 %	101,39 %	101,93 %
Global Bond Ex-US Fund	Relativ	Bloomberg Global Aggregate ex-USD (USD Hedged) Index	82,61 %	114,31 %	102,72 %	103,34 %
PIMCO Global Core Asset Allocation Fund	Relativ	60 % MSCI All Country World Index/40 % Bloomberg Global Aggregate USD Hedged	90,26 %	127,43 %	103,81 %	93,05 %
Global High Yield Bond Fund	Relativ	ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index Hedged into USD	96,87 %	122,97 %	105,69 %	100,40 %
Global Investment Grade Credit Fund	Relativ	Bloomberg Global Aggregate Credit Index (USD Hedged)	97,59 %	116,74 %	105,84 %	101,83 %
Global Investment Grade Credit ESG Fund	Relativ	Bloomberg Global Aggregate Credit Index (USD Hedged)	97,83 %	113,48 %	105,86 %	101,23 %
Global Low Duration Real Return Fund	Relativ	Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond 1-5 Year Index (USD Hedged)	89,75 %	119,66 %	104,44 %	110,21 %
Global Real Return Fund	Relativ	Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond USD Hedged Index	92,16 %	107,84 %	100,44 %	103,88 %
Income Fund	Absolut	n. z.	3,83 %	8,45 %	6,51 %	7,34 %
Income Fund II	Absolut	n. z.	1,92 %	5,97 %	4,25 %	5,62 %
Inflation Multi-Asset Fund	Absolut	n. z.	6,06 %	9,75 %	7,46 %	8,71 %
Low Average Duration Fund	Absolut	n. z.	1,57 %	3,31 %	2,68 %	3,00 %
Low Duration Global Investment Grade Credit Fund	Relativ	Bloomberg Global Aggregate Credit 1-5 Years Index (USD Hedged)	82,83 %	112,84 %	101,24 %	102,69 %
Low Duration Income Fund	Absolut	n. z.	2,98 %	6,99 %	5,29 %	5,80 %
Low Duration Opportunities Fund	Absolut	n. z.	1,82 %	5,47 %	3,70 %	3,23 %
Low Duration Opportunities ESG Fund	Absolut	n. z.	0,96 %	2,14 %	1,77 %	1,76 %
PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	Relativ	Alerian MLP Index	92,23 %	109,76 %	102,35 %	108,22 %
Mortgage Opportunities Fund	Absolut	n. z.	2,75 %	8,49 %	6,19 %	6,01 %
StocksPLUS™ Fund	Relativ	S&P 500 Index (nach Abzug der Quellensteuer auf Dividenden)	97,48 %	106,40 %	101,95 %	101,54 %
PIMCO StocksPLUS™ AR Fund	Relativ	S&P 500 Index (nach Abzug der Quellensteuer auf Dividenden)	101,28 %	112,10 %	107,00 %	107,82 %
Strategic Income Fund	Relativ	75 % Bloomberg U.S. Aggregate Bond Index/25 % MSCI ACWI High Dividend Yield Index	106,90 %	144,99 %	119,86 %	125,90 %
Total Return Bond Fund	Relativ	Bloomberg U.S. Aggregate Index	95,33 %	113,77 %	103,98 %	100,51 %
PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	Absolut	n. z.	1,91 %	11,57 %	6,10 %	2,57 %
UK Corporate Bond Fund	Relativ	ICE BofA Merrill Lynch Sterling Non-Gilts Index	97,22 %	110,46 %	104,62 %	105,19 %
UK Long Term Corporate Bond Fund	Relativ	ICE BofA Merrill Lynch Sterling Non-Gilts 10+ Index	95,87 %	110,22 %	100,56 %	102,14 %
US High Yield Bond Fund	Relativ	ICE BofA Merrill Lynch US High Yield Constrained Index	96,48 %	122,58 %	104,73 %	100,25 %

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)

Fonds	Methode	Vergleichsindex	31. Dez. 2022			
			Min.	Max.	Durchschnitt	Jahresende
US Investment Grade Corporate Bond Fund	Relativ	Bloomberg U.S. Credit Index	94,56 %	112,79 %	102,51 %	95,83 %
US Short-Term Fund	Absolut	n. z.	0,67 %	1,58 %	1,13 %	1,08 %

Fonds	Methode	Vergleichsindex	31. Dez. 2021			
			Min.	Max.	Durchschnitt	Jahresende
PIMCO Asia High Yield Bond Fund	Relativ	J.P. Morgan JACI Non-Investment Grade Index	91,93 %	109,27 %	100,96 %	94,51 %
Asia Strategic Interest Bond Fund	Relativ	J.P. Morgan Asia Credit Index	82,05 %	121,37 %	109,16 %	96,23 %
PIMCO Capital Securities Fund	Absolut	n. z.	3,97 %	7,53 %	4,96 %	4,48 %
PIMCO Climate Bond Fund	Absolut	n. z.	1,70 %	2,47 %	2,13 %	2,26 %
Commodity Real Return Fund	Relativ	Bloomberg Commodity Index Total Return	96,26 %	117,60 %	106,74 %	104,19 %
PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	Absolut	n. z.	2,32 %	11,10 %	2,88 %	2,41 %
Diversified Income Fund	Relativ	jeweils 1/3 Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets, USD Hedged, ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index, USD Hedged, und JPMorgan EMBI Global, USD Hedged	98,55 %	107,94 %	103,05 %	102,79 %
Diversified Income Duration Hedged Fund	Absolut	n. z.	4,77 %	7,60 %	5,67 %	5,23 %
Dynamic Bond Fund	Absolut	n. z.	1,73 %	3,11 %	2,23 %	2,72 %
Dynamic Multi-Asset Fund	Absolut	n. z.	4,74 %	9,51 %	6,27 %	5,59 %
Emerging Local Bond Fund	Relativ	JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (Unhedged)	94,11 %	110,67 %	105,05 %	94,11 %
Emerging Markets Bond Fund	Relativ	JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global	106,90 %	114,19 %	110,28 %	107,17 %
Emerging Markets Bond ESG Fund	Relativ	JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified	103,52 %	111,23 %	108,03 %	106,41 %
Emerging Markets Corporate Bond Fund	Relativ	JPMorgan Corporate Emerging Markets Bond Index Diversified (CEMBI)	106,41 %	120,75 %	113,09 %	111,22 %
PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	Relativ	50 % JPMorgan EMBI Global Index /50 % JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (USD Unhedged)	46,26 %	75,87 %	63,77 %	54,78 %
Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	Relativ	JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (Unhedged)	90,59 %	123,04 %	108,80 %	92,20 %
PIMCO ESG Income Fund	Absolut	n. z.	0,32 %	1,87 %	1,46 %	1,77 %
Euro Bond Fund	Relativ	FTSE Euro Broad Investment-Grade Index	99,37 %	120,35 %	108,31 %	101,36 %
Euro Credit Fund	Relativ	Bloomberg Euro-Aggregate Credit Index	98,09 %	111,31 %	105,31 %	104,06 %
Euro Income Bond Fund	Absolut	n. z.	2,57 %	3,88 %	3,12 %	2,91 %
Euro Long Average Duration Fund	Relativ	Bloomberg Euro Government (Germany, France, Netherlands) over 15 years Index	96,67 %	104,01 %	99,96 %	98,33 %
Euro Short-Term Fund	Absolut	n. z.	0,51 %	0,89 %	0,65 %	0,68 %
PIMCO European High Yield Bond Fund	Relativ	ICE BofA Merrill Lynch BB-B European Currency High Yield Constrained Index	88,35 %	100,64 %	94,40 %	91,94 %
PIMCO European Short-Term Opportunities Fund	Absolut	n. z.	1,91 %	2,80 %	2,34 %	2,63 %
Global Advantage Fund	Relativ	PIMCO Global Advantage Bond Index (GLADI) (London Close)	97,53 %	126,44 %	110,80 %	103,88 %
Global Bond Fund	Relativ	Bloomberg Global Aggregate (USD Hedged) Index	80,34 %	114,27 %	93,99 %	86,27 %
Global Bond ESG Fund	Relativ	Bloomberg Global Aggregate (USD Hedged) Index	80,89 %	111,03 %	93,22 %	89,27 %
Global Bond Ex-US Fund	Relativ	Bloomberg Global Aggregate ex-USD (USD Hedged) Index	78,38 %	126,22 %	94,84 %	84,52 %
PIMCO Global Core Asset Allocation Fund	Relativ	60 % MSCI All Country World Index/40 % Bloomberg Global Aggregate USD Hedged	115,77 %	137,13 %	127,83 %	119,70 %
Global High Yield Bond Fund	Relativ	ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index Hedged into USD	92,27 %	117,02 %	103,43 %	105,07 %
Global Investment Grade Credit Fund	Relativ	Bloomberg Global Aggregate Credit Index (USD Hedged)	94,57 %	110,53 %	102,31 %	98,87 %
Global Investment Grade Credit ESG Fund	Relativ	Bloomberg Global Aggregate Credit Index (USD Hedged)	97,63 %	109,78 %	102,98 %	100,08 %
Global Low Duration Real Return Fund	Relativ	Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond 1-5 Year Index (USD Hedged)	107,97 %	131,84 %	119,54 %	113,96 %
Global Real Return Fund	Relativ	Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond USD Hedged Index	96,46 %	109,06 %	102,26 %	97,35 %
Income Fund	Absolut	n. z.	3,33 %	5,18 %	4,03 %	3,87 %
Income Fund II	Absolut	n. z.	0,43 %	2,74 %	2,14 %	2,06 %
Inflation Multi-Asset Fund	Absolut	n. z.	6,22 %	11,55 %	8,04 %	6,26 %
Low Average Duration Fund	Absolut	n. z.	0,49 %	2,01 %	0,91 %	1,61 %
Low Duration Global Investment Grade Credit Fund	Relativ	Bloomberg Global Aggregate Credit 1-5 Years Index (USD Hedged)	98,11 %	144,31 %	118,98 %	98,11 %

Fonds	Methode	Vergleichsindex	31. Dez. 2021			
			Min.	Max.	Durchschnitt	Jahresende
Low Duration Income Fund	Absolut	n. z.	2,73 %	4,12 %	3,23 %	3,03 %
Low Duration Opportunities Fund	Absolut	n. z.	1,22 %	2,13 %	1,52 %	1,94 %
PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	Relativ	Alerian MLP Index	88,39 %	102,56 %	93,90 %	94,52 %
Mortgage Opportunities Fund	Absolut	n. z.	2,37 %	4,31 %	3,08 %	2,98 %
StocksPLUS [™] Fund	Relativ	S&P 500 Index (nach Abzug der Quellensteuer auf Dividenden)	94,94 %	108,47 %	101,66 %	99,96 %
PIMCO StocksPLUS [™] AR Fund	Relativ	S&P 500 Index (nach Abzug der Quellensteuer auf Dividenden)	97,64 %	113,30 %	103,74 %	101,67 %
Strategic Income Fund	Relativ	75 % Bloomberg Global Aggregate USD Hedged/25 % MSCI World Value Index	121,10 %	189,50 %	149,77 %	132,34 %
Total Return Bond Fund	Relativ	Bloomberg U.S. Aggregate Index	89,59 %	110,10 %	99,19 %	100,60 %
PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	Absolut	n. z.	3,62 %	7,36 %	5,41 %	4,68 %
UK Corporate Bond Fund	Relativ	ICE BofA Merrill Lynch Sterling Non-Gilts Index	97,78 %	111,79 %	102,43 %	97,78 %
UK Long Term Corporate Bond Fund	Relativ	ICE BofA Merrill Lynch Sterling Non-Gilts 10+ Index	95,90 %	106,08 %	99,11 %	96,62 %
US High Yield Bond Fund	Relativ	ICE BofA Merrill Lynch US High Yield Constrained Index	92,05 %	112,68 %	104,14 %	103,58 %
US Investment Grade Corporate Bond Fund	Relativ	Bloomberg U.S. Credit Index	94,70 %	106,14 %	99,91 %	95,52 %
US Short-Term Fund	Absolut	n. z.	0,41 %	0,90 %	0,65 %	0,74 %

Die Zentralbank verlangt, dass alle Fonds ein Maß für die Fremdfinanzierung offenlegen, das aufgrund eines nominellen Brutto-Engagements berechnet wird. Die Höhe des nominellen Bruttoengagements wird, wie von der Zentralbank gefordert, mithilfe der Summe der absoluten Werte der Nominalwerte der eingesetzten Derivate berechnet (wobei davon ausgegangen wird, dass bestimmte Terminkontrakte enthalten sind) und berücksichtigt daher keine vom Fonds eingegangenen Netting- und Absicherungsvereinbarungen. Der Einsatz von Derivaten (ob für Absicherungs- oder Anlagezwecke) kann zu einem höheren nominellen Brutto-Engagement führen. Es wird erwartet, dass das nominelle Brutto-Engagement der Fonds auf höhere Werte ansteigt, wenn es die Anlageberatungsgesellschaften beispielsweise für angemessen halten, Derivate zur Änderung des Zinssatzes, des Währungs- oder Kreditengagements des Fonds einzusetzen.

In der folgenden Tabelle werden die durchschnittlichen nominellen Brutto-Engagements für die Fonds für die Geschäftsjahre zum 31. Dezember 2022 und 31. Dezember 2021 aufgeführt:

Fonds	31. Dez. 2022	31. Dez. 2021
PIMCO Asia High Yield Bond Fund	46 %	42 %
Asia Strategic Interest Bond Fund	47 %	42 %
PIMCO Capital Securities Fund	104 %	93 %
PIMCO Climate Bond Fund	81 %	69 %
Commodity Real Return Fund	258 %	263 %
PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	145 %	185 %
Diversified Income Fund	118 %	105 %
Diversified Income Duration Hedged Fund	119 %	127 %
Diversified Income ESG Fund	79 % ⁽¹⁾	k. A.
Dynamic Bond Fund	232 %	150 %
Dynamic Multi-Asset Fund	229 %	118 %
Emerging Local Bond Fund	500 %	500 %
Emerging Local Bond ESG Fund	123 % ⁽¹⁾	k. A.
Emerging Markets Bond Fund	80 %	49 %
Emerging Markets Bond ESG Fund	61 %	41 %
Emerging Markets Corporate Bond Fund	46 %	34 %
PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	461 %	463 %
Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	465 %	384 %
PIMCO ESG Income Fund	120 %	80 % ⁽²⁾
Euro Bond Fund	227 %	211 %
Euro Credit Fund	118 %	112 %
Euro Income Bond Fund	177 %	143 %
Euro Long Average Duration Fund	265 %	261 %
Euro Short-Term Fund	124 %	81 %
PIMCO European High Yield Bond Fund	58 %	50 %
PIMCO European Short-Term Opportunities Fund	302 %	269 %
Global Advantage Fund	398 %	314 %
Global Bond Fund	404 %	338 %
Global Bond ESG Fund	321 %	237 %

Fonds	31. Dez. 2022	31. Dez. 2021
Global Bond Ex-US Fund	454 %	367 %
PIMCO Global Core Asset Allocation Fund	267 %	329 %
Global High Yield Bond Fund	30 %	29 %
Global Investment Grade Credit Fund	127 %	107 %
Global Investment Grade Credit ESG Fund	76 %	66 %
Global Low Duration Real Return Fund	198 %	202 %
Global Real Return Fund	232 %	207 %
Income Fund	243 %	162 %
Income Fund II	84 %	45 % ⁽²⁾
Inflation Multi-Asset Fund	185 %	283 %
Low Average Duration Fund	147 %	116 %
Low Duration Global Investment Grade Credit Fund	105 %	80 %
Low Duration Income Fund	249 %	162 %
Low Duration Opportunities Fund	252 %	133 %
Low Duration Opportunities ESG Fund	87 % ⁽¹⁾	k. A.
PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	49 %	68 %
Mortgage Opportunities Fund	569 %	484 %
StocksPLUS [™] Fund	201 %	216 %
PIMCO StocksPLUS [™] AR Fund	262 %	253 %
Strategic Income Fund	264 %	181 %
Total Return Bond Fund	181 %	116 %
PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	818 %	722 %
UK Corporate Bond Fund	79 %	88 %
UK Long Term Corporate Bond Fund	90 %	99 %
US High Yield Bond Fund	6 %	8 %
US Investment Grade Corporate Bond Fund	111 %	75 %
US Short-Term Fund	87 %	88 %

⁽¹⁾ Die Fonds wurden während des Geschäftsjahres zum 31. Dezember 2022 aufgelegt.
⁽²⁾ Die Fonds wurden während des Geschäftsjahres zum 31. Dezember 2021 aufgelegt.

(b) Devisenrisiko

Legen die Fonds direkt in Fremdwährungen oder Wertpapiere an, die in Fremdwährungen gehandelt werden und Einnahmen davon erhalten, oder in Finanzderivaten, die Beteiligungen an Fremdwährungen bieten, unterliegen sie dem Risiko, dass der Wert dieser Währungen im Verhältnis zur Funktionswährung der Fonds fällt, oder, im Fall von Absicherungspositionen, dass der Wert der Funktionswährung der Fonds im Verhältnis zur abgesicherten Währung fällt. Devisenkurse im Ausland können innerhalb kurzer Zeiträume aus einer Reihe von Gründen erheblich schwanken. Dazu zählen Änderungen der Zinssätze, Interventionen (oder das verpasste Intervenieren) seitens der US- oder ausländischer Regierungen, Zentralbanken oder supranationaler Organisationen wie dem Internationalen Währungsfonds, oder auferlegte Währungskontrollen oder sonstige politische Entwicklungen in oder außerhalb der USA. Im Ergebnis können die Anlagen der Fonds in auf ausländische Währungen lautenden Wertpapieren die Erträge der Fonds schmälern.

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)

Die Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund, PIMCO Climate Bond Fund, Diversified Income ESG Fund, PIMCO ESG Income Fund, Low Average Duration Fund, Low Duration Income Fund, Low Duration Opportunities ESG Fund, PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund, PIMCO StocksPLUS™ AR Fund, UK Corporate Bond Fund und UK Long Term Corporate Bond Fund wiesen zum 31. Dezember 2022 bzw. 31. Dezember 2021 kein wesentliches Fremdwährungsrisiko auf. Die folgenden Tabellen zeigen das Gesamtengagement des Fremdwährungsrisikos bei Währungen, bei denen das Fremdwährungsengagement für wesentlich gehalten wird (d. h. bei denen unter Konstanzhaltung aller anderen Variablen die Auswirkungen einer vernünftigerweise möglichen Entwicklung des Wechselkurses zu einer deutlichen Schwankung des Nettovermögens führen würden) (Angaben in Tausend):

	Asia Strategic Interest Bond Fund					
	Zum 31. Dez. 2022			Zum 31. Dez. 2021		
	Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
Chinesischer Renminbi (Ausland)	\$ 5	\$ (604)	\$ (599)	\$ 2	\$ (8.200)	\$ (8.198)
Euro	2.881	(2.766)	115	9.816	(19.663)	(9.847)
	\$ 2.886	\$ (3.370)	\$ (484)	\$ 9.818	\$ (27.863)	\$ (18.045)
	PIMCO Capital Securities Fund					
	Zum 31. Dez. 2022			Zum 31. Dez. 2021		
	Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
Euro	\$ 2.368.944	\$ (2.418.200)	\$ (49.256)	\$ 3.794.319	\$ (7.699.654)	\$ (3.905.335)
	Commodity Real Return Fund					
	Zum 31. Dez. 2022			Zum 31. Dez. 2021		
	Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
Britisches Pfund Sterling	\$ 118.131	\$ (121.922)	\$ (3.791)	\$ 96.133	\$ (170.205)	\$ (74.072)
Euro	305.284	(295.912)	9.372	299.802	(595.364)	(295.562)
	\$ 423.415	\$ (417.834)	\$ 5.581	\$ 395.935	\$ (765.569)	\$ (369.634)
	PIMCO Credit Opportunities Bond Fund					
	Zum 31. Dez. 2022			Zum 31. Dez. 2021		
	Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
Britisches Pfund Sterling	\$ 760	\$ (891)	\$ (131)	\$ 3.564	\$ (6.910)	\$ (3.346)
Euro	2.169	(2.277)	(108)	4.412	(8.672)	(4.260)
	\$ 2.929	\$ (3.168)	\$ (239)	\$ 7.976	\$ (15.582)	\$ (7.606)
	Diversified Income Fund					
	Zum 31. Dez. 2022			Zum 31. Dez. 2021		
	Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
Euro	\$ 2.279.091	\$ (2.378.287)	\$ (99.196)	\$ 4.085.864	\$ (8.143.940)	\$ (4.058.076)
	Diversified Income Duration Hedged Fund					
	Zum 31. Dez. 2022			Zum 31. Dez. 2021		
	Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
Britisches Pfund Sterling	\$ 18.549	\$ (18.696)	\$ (147)	\$ 56.167	\$ (128.378)	\$ (72.211)
Euro	126.256	(132.486)	(6.230)	302.487	(608.636)	(306.149)
	\$ 144.805	\$ (151.182)	\$ (6.377)	\$ 358.654	\$ (737.014)	\$ (378.360)
	Dynamic Bond Fund					
	Zum 31. Dez. 2022			Zum 31. Dez. 2021		
	Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
Britisches Pfund Sterling	\$ 191.450	\$ (170.852)	\$ 20.598	\$ 217.367	\$ (409.767)	\$ (192.400)
Euro	538.295	(598.546)	(60.251)	577.398	(1.214.842)	(637.444)
	\$ 729.745	\$ (769.398)	\$ (39.653)	\$ 794.765	\$ (1.624.609)	\$ (829.844)
	Dynamic Multi-Asset Fund					
	Zum 31. Dez. 2022			Zum 31. Dez. 2021		
	Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
Brasilianischer Real	€ 0	€ 114.243	€ 114.243	€ 10	€ (10.814)	€ (10.804)
Britisches Pfund Sterling	72.902	(195.150)	(122.248)	81.843	(311.743)	(229.900)
Kanadischer Dollar	68.142	42.315	110.457	105.550	(117.973)	(12.423)
Chilenischer Peso	0	119.441	119.441	0	146.325	146.325
Hongkong-Dollar	57.660	(102.774)	(45.114)	250.979	(60.596)	190.383
Ungarischer Forint	0	144.948	144.948	0	(165)	(165)
Indische Rupie	0	123.814	123.814	0	0	0
Israelischer Schekel	25.085	(170.811)	(145.726)	101.411	(182.073)	(80.662)
Norwegische Krone	25.356	110.729	136.085	41.600	146.849	188.449
Südkoreanischer Won	118.056	(109.869)	8.187	100.074	54.667	154.741
Taiwan-Dollar	172.004	(366.954)	(194.950)	420.503	(45.754)	374.749
US-Dollar	1.313.859	(1.521.877)	(208.018)	1.907.323	(4.354.224)	(2.446.901)
	€ 1.853.064	€ (1.811.945)	€ 41.119	€ 3.009.293	€ (4.735.501)	€ (1.726.208)

Emerging Local Bond Fund

	Zum 31. Dez. 2022			Zum 31. Dez. 2021		
	Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
Brasilianischer Real	\$ 72.605	\$ 116.650	\$ 189.255	\$ 80.167	\$ 35.216	\$ 115.383
Chilenischer Peso	48.276	(5.534)	42.742	108.086	(65.106)	42.980
Chinesischer Renminbi (Festland)	111.344	54.864	166.208	316.213	(119.112)	197.101
Kolumbianischer Peso	92.165	(2.600)	89.565	147.850	(32.217)	115.633
Tschechische Krone	56.636	47.780	104.416	4.586	114.536	119.122
Euro	65.535	(36.905)	28.630	67.300	(147.920)	(80.620)
Ungarischer Forint	61.026	(734)	60.292	(559)	73.557	72.998
Indonesische Rupiah	166.739	39.786	206.525	247.590	2.480	250.070
Malaysischer Ringgit	176.652	11.634	188.286	181.227	25.707	206.934
Mexikanischer Peso	144.527	33.144	177.671	70.617	94.521	165.138
Peruanischer Nuevo Sol	46.699	(3.191)	43.508	73.627	(30.071)	43.556
Polnischer Zloty	8.441	107.423	115.864	39.567	113.012	152.579
Rumänischer Leu	76.773	(15.089)	61.684	66.381	(1.976)	64.405
Russischer Rubel	6.084	0	6.084	126.359	21.766	148.125
Südafrikanischer Rand	257.451	(84.444)	173.007	194.231	(12.664)	181.567
Thailändischer Baht	80.943	110.257	191.200	125.564	67.387	192.951
	\$ 1.471.896	\$ 373.041	\$ 1.844.937	\$ 1.848.806	\$ 139.116	\$ 1.987.922

Emerging Local Bond ESG Fund

	Zum 31. Dez. 2022			Zum 31. Dez. 2021		
	Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
Brasilianischer Real	\$ 251	\$ 361	\$ 612	\$ k. A.	\$ k. A.	\$ k. A.
Chilenischer Peso	140	54	194	k. A.	k. A.	k. A.
Kolumbianischer Peso	233	(20)	213	k. A.	k. A.	k. A.
Tschechische Krone	453	128	581	k. A.	k. A.	k. A.
Ungarischer Forint	260	(13)	247	k. A.	k. A.	k. A.
Indonesische Rupiah	671	4	675	k. A.	k. A.	k. A.
Malaysischer Ringgit	588	159	747	k. A.	k. A.	k. A.
Mexikanischer Peso	545	96	641	k. A.	k. A.	k. A.
Peruanischer Nuevo Sol	146	3	149	k. A.	k. A.	k. A.
Polnischer Zloty	371	168	539	k. A.	k. A.	k. A.
Rumänischer Leu	290	(15)	275	k. A.	k. A.	k. A.
Südafrikanischer Rand	823	(230)	593	k. A.	k. A.	k. A.
Thailändischer Baht	283	346	629	k. A.	k. A.	k. A.
	\$ 5.054	\$ 1.041	\$ 6.095	\$ k. A.	\$ k. A.	\$ k. A.

Emerging Markets Bond Fund

	Zum 31. Dez. 2022			Zum 31. Dez. 2021		
	Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
Euro	\$ 235.241	\$ (239.027)	\$ (3.786)	\$ 265.938	\$ (527.161)	\$ (261.223)

Emerging Markets Bond ESG Fund

	Zum 31. Dez. 2022			Zum 31. Dez. 2021		
	Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
Euro	\$ 190.204	\$ (201.086)	\$ (10.882)	\$ 203.590	\$ (404.170)	\$ (200.580)

Emerging Markets Corporate Bond Fund

	Zum 31. Dez. 2022			Zum 31. Dez. 2021		
	Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
Euro	\$ 5.840	\$ (5.703)	\$ 137	\$ 9.899	\$ (19.830)	\$ (9.931)

PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund

	Zum 31. Dez. 2022			Zum 31. Dez. 2021		
	Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
Australischer Dollar	\$ 91	\$ (37)	\$ 54	\$ 55	\$ (6.709)	\$ (6.654)
Brasilianischer Real	5.017	5.180	10.197	3.146	(1.182)	1.964
Kanadischer Dollar	0	(89)	(89)	0	(10.370)	(10.370)
Chilenischer Peso	208	5.420	5.628	12.087	(9.165)	2.922
Chinesischer Renminbi (Festland)	377	8.175	8.552	457	2.355	2.812
Euro	11.804	(15.001)	(3.197)	27.730	(50.263)	(22.533)
Indonesische Rupiah	0	15.191	15.191	0	16.979	16.979
Malaysischer Ringgit	(37)	7.337	7.300	24	5.491	5.515
Südafrikanischer Rand	10.393	(4.989)	5.404	14.068	(12.625)	1.443
Thailändischer Baht	246	4.183	4.429	(144)	4.068	3.924
Türkische Lira	2	(5.829)	(5.827)	85	(3.100)	(3.015)
	\$ 28.101	\$ 19.541	\$ 47.642	\$ 57.508	\$ (64.521)	\$ (7.013)

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)

Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund						
Zum 31. Dez. 2022			Zum 31. Dez. 2021			
	Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
Brasilianischer Real	\$ 577	\$ 558	\$ 1.135	\$ 591	\$ 1.449	\$ 2.040
Chinesischer Renminbi (Festland)	24	1.897	1.921	18	2.460	2.478
Tschechische Krone	193	702	895	13	1.479	1.492
Euro	582	(306)	276	854	(3.860)	(3.006)
Ungarischer Forint	648	(22)	626	0	743	743
Indische Rupie	0	1.657	1.657	0	2.373	2.373
Indonesische Rupiah	1	945	946	0	1.645	1.645
Malaysischer Ringgit	76	926	1.002	193	1.519	1.712
Mexikanischer Peso	361	1.674	2.035	266	2.147	2.413
Polnischer Zloty	82	1.074	1.156	22	1.608	1.630
Rumänischer Leu	0	425	425	0	532	532
Russischer Rubel	14	0	14	439	1.449	1.888
Singapur-Dollar	1	1.580	1.581	75	2.104	2.179
Südkoreanischer Won	5	2.240	2.245	(3)	3.004	3.001
Taiwan-Dollar	0	1.325	1.325	0	1.801	1.801
Thailändischer Baht	(1)	1.084	1.083	2	1.489	1.491
Türkische Lira	0	766	766	0	375	375
	\$ 2.563	\$ 16.525	\$ 19.088	\$ 2.470	\$ 22.317	\$ 24.787

Euro Bond Fund						
Zum 31. Dez. 2022			Zum 31. Dez. 2021			
	Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
US-Dollar	€ 271.900	€ (176.499)	€ 95.401	€ 275.761	€ (582.374)	€ (306.613)

Euro Credit Fund						
Zum 31. Dez. 2022			Zum 31. Dez. 2021			
	Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
US-Dollar	€ 89.377	€ (81.174)	€ 8.203	€ 171.927	€ (351.213)	€ (179.286)

Euro Income Bond Fund						
Zum 31. Dez. 2022			Zum 31. Dez. 2021			
	Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
US-Dollar	€ 292.182	€ (272.298)	€ 19.884	€ 515.062	€ (1.049.158)	€ (534.096)

Euro Long Average Duration Fund						
Zum 31. Dez. 2022			Zum 31. Dez. 2021			
	Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
US-Dollar	€ 9.930	€ (6.060)	€ 3.870	€ 10.188	€ (9.351)	€ 837

Euro Short-Term Fund						
Zum 31. Dez. 2022			Zum 31. Dez. 2021			
	Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
US-Dollar	€ 21.084	€ (19.481)	€ 1.603	€ 51.541	€ (112.233)	€ (60.692)

PIMCO European High Yield Bond Fund						
Zum 31. Dez. 2022			Zum 31. Dez. 2021			
	Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
US-Dollar	€ 13.984	€ (14.202)	€ (218)	€ 15.971	€ (32.259)	€ (16.288)

PIMCO European Short-Term Opportunities Fund						
Zum 31. Dez. 2022			Zum 31. Dez. 2021			
	Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
US-Dollar	€ 26.301	€ (15.271)	€ 11.030	€ 32.169	€ (68.648)	€ (36.479)

Global Advantage Fund						
Zum 31. Dez. 2022			Zum 31. Dez. 2021			
	Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
Australischer Dollar	\$ 17.341	\$ 2.048	\$ 19.389	\$ 26.322	\$ (4.726)	\$ 21.596
Britisches Pfund Sterling	32.405	(19.088)	13.317	45.652	(56.347)	(10.695)
Kanadischer Dollar	2.065	6.250	8.315	3.280	2.740	6.020
Chinesischer Renminbi (Festland)	443	35.354	35.797	26.147	2.616	28.763
Chinesischer Renminbi (Ausland)	2	9.188	9.190	0	25.769	25.769
Euro	100.213	(17.702)	82.511	96.022	3.483	99.505
Indische Rupie	2.953	11.479	14.432	3.629	15.027	18.656
Japanischer Yen	13.430	17.993	31.423	37.820	2.114	39.934
	\$ 168.852	\$ 45.522	\$ 214.374	\$ 238.872	\$ (9.324)	\$ 229.548

Global Bond Fund						
Zum 31. Dez. 2022			Zum 31. Dez. 2021			
	Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
Australischer Dollar	\$ 493.730	\$ (113.174)	\$ 380.556	\$ 616.757	\$ (233.570)	\$ 383.187
Chinesischer Renminbi (Festland)	(623)	2.413	1.790	912.493	(38.983)	873.510
Chinesischer Renminbi (Ausland)	1	(7.989)	(7.988)	0	(898.717)	(898.717)
Euro	2.371.161	(2.500.605)	(129.444)	2.980.153	(6.052.965)	(3.072.812)
	\$ 2.864.269	\$ (2.619.355)	\$ 244.914	\$ 4.509.403	\$ (7.224.235)	\$ (2.714.832)

Global Bond ESG Fund						
Zum 31. Dez. 2022			Zum 31. Dez. 2021			
	Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
Britisches Pfund Sterling	\$ 126.350	\$ (152.475)	\$ (26.125)	\$ 171.272	\$ (352.664)	\$ (181.392)
Chinesischer Renminbi (Festland)	295	(1.744)	(1.449)	150.102	(2.496)	147.606
Chinesischer Renminbi (Ausland)	0	2.180	2.180	16	(141.142)	(141.126)
Euro	508.092	(541.044)	(32.952)	571.408	(1.150.456)	(579.048)
	\$ 634.737	\$ (693.083)	\$ (58.346)	\$ 892.798	\$ (1.646.758)	\$ (753.960)

Global Bond Ex-US Fund						
Zum 31. Dez. 2022			Zum 31. Dez. 2021			
	Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
Australischer Dollar	\$ 34.822	\$ (13.053)	\$ 21.769	\$ 44.170	\$ (21.814)	\$ 22.356
Britisches Pfund Sterling	50.859	(55.195)	(4.336)	60.394	(125.767)	(65.373)
Chinesischer Renminbi (Festland)	15.260	0	15.260	119.557	(17.860)	101.697
Chinesischer Renminbi (Ausland)	0	(21.272)	(21.272)	9	(104.968)	(104.959)
Euro	142.277	(152.540)	(10.263)	155.400	(313.264)	(157.864)
Japanischer Yen	158.896	(154.003)	4.893	135.665	(173.243)	(37.578)
	\$ 402.114	\$ (396.063)	\$ 6.051	\$ 515.195	\$ (756.916)	\$ (241.721)

PIMCO Global Core Asset Allocation Fund						
Zum 31. Dez. 2022			Zum 31. Dez. 2021			
	Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
Australischer Dollar	\$ 1.028	\$ 15.689	\$ 16.717	\$ 1.621	\$ 12.176	\$ 13.797
Kanadischer Dollar	1.362	11.361	12.723	3.825	17.651	21.476
Chinesischer Renminbi (Festland)	21.768	117	21.885	47.330	(37.828)	9.502
Chinesischer Renminbi (Ausland)	0	(22.761)	(22.761)	0	(17.507)	(17.507)
Euro	20.531	49.355	69.886	17.076	123.241	140.317
Japanischer Yen	161.033	(134.205)	26.828	117.040	(46.706)	70.334
	\$ 205.722	\$ (80.444)	\$ 125.278	\$ 186.892	\$ 51.027	\$ 237.919

Global High Yield Bond Fund						
Zum 31. Dez. 2022			Zum 31. Dez. 2021			
	Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
Euro	\$ 762.654	\$ (777.633)	\$ (14.979)	\$ 1.132.339	\$ (2.266.185)	\$ (1.133.846)

Global Investment Grade Credit Fund						
Zum 31. Dez. 2022			Zum 31. Dez. 2021			
	Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
Britisches Pfund Sterling	\$ 397.802	\$ (406.970)	\$ (9.168)	\$ 915.032	\$ (1.362.914)	\$ (447.882)
Euro	1.501.589	(1.570.568)	(68.979)	3.149.786	(6.443.260)	(3.293.474)
	\$ 1.899.391	\$ (1.977.538)	\$ (78.147)	\$ 4.064.818	\$ (7.806.174)	\$ (3.741.356)

Global Investment Grade Credit ESG Fund						
Zum 31. Dez. 2022			Zum 31. Dez. 2021			
	Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
Euro	\$ 320.958	\$ (322.879)	\$ (1.921)	\$ 301.207	\$ (602.013)	\$ (300.806)

Global Low Duration Real Return Fund						
Zum 31. Dez. 2022			Zum 31. Dez. 2021			
	Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
Britisches Pfund Sterling	\$ 197.996	\$ (192.629)	\$ 5.367	\$ 133.465	\$ (259.877)	\$ (126.412)
Euro	288.416	(264.829)	23.587	275.351	(551.540)	(276.189)
Japanischer Yen	69.215	(69.878)	(663)	59.833	(88.605)	(28.772)
	\$ 555.627	\$ (527.336)	\$ 28.291	\$ 468.649	\$ (900.022)	\$ (431.373)

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)

Global Real Return Fund						
Zum 31. Dez. 2022			Zum 31. Dez. 2021			
	Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
Euro	\$ 681.331	\$ (709.530)	\$ (28.199)	\$ 1.054.070	\$ (2.105.992)	\$ (1.051.922)
Income Fund						
Zum 31. Dez. 2022			Zum 31. Dez. 2021			
	Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
Japanischer Yen	\$ 2.979.968	\$ (1.651.362)	\$ 1.328.606	\$ 2.058	\$ (46.036)	\$ (43.978)
Russischer Rubel	198.869	0	198.869	613.726	1.084.368	1.698.094
	\$ 3.178.837	\$ (1.651.362)	\$ 1.527.475	\$ 615.784	\$ 1.038.332	\$ 1.654.116
Income Fund II						
Zum 31. Dez. 2022			Zum 31. Dez. 2021			
	Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
Mexikanischer Peso	\$ 514	\$ 19	\$ 533	\$ 549	\$ 38	\$ 587
Russischer Rubel	0	0	0	0	604	604
	\$ 514	\$ 19	\$ 533	\$ 549	\$ 642	\$ 1.191
Inflation Multi-Asset Fund						
Zum 31. Dez. 2022			Zum 31. Dez. 2021			
	Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
Brasilianischer Real	\$ 10	\$ 2.746	\$ 2.756	\$ (1.243)	\$ 19.794	\$ 18.551
Mexikanischer Peso	0	5.993	5.993	3.909	402	4.311
	\$ 10	\$ 8.739	\$ 8.749	\$ 2.666	\$ 20.196	\$ 22.862
Low Duration Global Investment Grade Credit Fund						
Zum 31. Dez. 2022			Zum 31. Dez. 2021			
	Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
Euro	\$ 154.878	\$ (155.538)	\$ (660)	\$ 166.379	\$ (335.731)	\$ (169.352)
Low Duration Opportunities Fund						
Zum 31. Dez. 2022			Zum 31. Dez. 2021			
	Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
Britisches Pfund Sterling	\$ 104.327	\$ (95.964)	\$ 8.363	\$ 212.256	\$ (401.285)	\$ (189.029)
Euro	197.537	(226.587)	(29.050)	436.395	(935.342)	(498.947)
	\$ 301.864	\$ (322.551)	\$ (20.687)	\$ 648.651	\$ (1.336.627)	\$ (687.976)
Mortgage Opportunities Fund						
Zum 31. Dez. 2022			Zum 31. Dez. 2021			
	Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
Britisches Pfund Sterling	\$ 132.300	\$ (132.680)	\$ (380)	\$ 173.358	\$ (172.739)	\$ 619
Euro	24.115	(25.159)	(1.044)	189.084	(191.731)	(2.647)
	\$ 156.415	\$ (157.839)	\$ (1.424)	\$ 362.442	\$ (364.470)	\$ (2.028)
StocksPLUS [™] Fund						
Zum 31. Dez. 2022			Zum 31. Dez. 2021			
	Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
Britisches Pfund Sterling	\$ 35.643	\$ (35.399)	\$ 244	\$ 218.048	\$ (427.660)	\$ (209.612)
Euro	174.882	(176.960)	(2.078)	376.244	(750.405)	(374.161)
	\$ 210.525	\$ (212.359)	\$ (1.834)	\$ 594.292	\$ (1.178.065)	\$ (583.773)
Strategic Income Fund						
Zum 31. Dez. 2022			Zum 31. Dez. 2021			
	Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
Australischer Dollar	\$ 5.676	\$ 6.403	\$ 12.079	\$ 10.948	\$ (1.729)	\$ 9.219
Brasilianischer Real	2.987	6.021	9.008	(819)	14.800	13.981
Britisches Pfund Sterling	15.253	(8.998)	6.265	37.849	(51.698)	(13.849)
Euro	15.965	(9.432)	6.533	51.763	(41.206)	10.557
Japanischer Yen	6.770	7.884	14.654	24.809	(1.851)	22.958
	\$ 46.651	\$ 1.888	\$ 48.539	\$ 124.550	\$ (81.684)	\$ 42.866

Total Return Bond Fund						
Zum 31. Dez. 2022			Zum 31. Dez. 2021			
	Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
Britisches Pfund Sterling	\$ 270.559	\$ (270.912)	\$ (353)	\$ 500.686	\$ (1.037.747)	\$ (537.061)
Euro	844.203	(834.837)	9.366	1.178.687	(2.379.067)	(1.200.380)
	\$ 1.114.762	\$ (1.105.749)	\$ 9.013	\$ 1.679.373	\$ (3.416.814)	\$ (1.737.441)
PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund						
Zum 31. Dez. 2022			Zum 31. Dez. 2021			
	Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
Australischer Dollar	\$ 5.583	\$ (5.848)	\$ (265)	\$ 757	\$ (5.238)	\$ (4.481)
Brasilianischer Real	264	13.022	13.286	807	(1.609)	(802)
Britisches Pfund Sterling	123	5.593	5.716	1.598	(17.303)	(15.705)
Kanadischer Dollar	16.561	(23.692)	(7.131)	282	(13.050)	(12.768)
Chilenischer Peso	(737)	14.132	13.395	504	(2.102)	(1.598)
Chinesischer Renminbi (Ausland)	0	(2.252)	(2.252)	208	5.850	6.058
Kolumbianischer Peso	25	(5.782)	(5.757)	176	(2.568)	(2.392)
Euro	398	15	413	1.414	(9.442)	(8.028)
Ungarischer Forint	564	10.036	10.600	238	(1.822)	(1.584)
Indische Rupie	(1.228)	(31.304)	(32.532)	(27)	(129)	(156)
Indonesische Rupiah	0	(20.219)	(20.219)	0	3.771	3.771
Israelischer Schekel	8.144	(35.304)	(27.160)	2.014	1.124	3.138
Japanischer Yen	64.494	(68.674)	(4.180)	16	(10.004)	(9.988)
Malaysischer Ringgit	348	3.776	4.124	114	(2.337)	(2.223)
Mexikanischer Peso	(52)	7.371	7.319	10	2.114	2.124
Neuseeland-Dollar	0	10.948	10.948	0	(7.797)	(7.797)
Norwegische Krone	0	(6)	(6)	0	(3.420)	(3.420)
Peruanischer Nuevo Sol	0	15.806	15.806	0	(773)	(773)
Rumänischer Leu	0	17.909	17.909	0	(3.158)	(3.158)
Singapur-Dollar	(482)	9.478	8.996	47	(1.033)	(986)
Südafrikanischer Rand	(194)	3.508	3.314	(51)	(2.079)	(2.130)
Südkoreanischer Won	137	3.438	3.575	120	(2.406)	(2.286)
Schwedische Krone	98	852	950	21	(5.215)	(5.194)
Schweizer Franken	45	9.471	9.516	134	(1.901)	(1.767)
Thailändischer Baht	116	(18.208)	(18.092)	(8)	(4.053)	(4.061)
	\$ 94.207	\$ (85.934)	\$ 8.273	\$ 8.374	\$ (84.580)	\$ (76.206)
US High Yield Bond Fund						
Zum 31. Dez. 2022			Zum 31. Dez. 2021			
	Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
Euro	\$ 48.285	\$ (47.578)	\$ 707	\$ 100.205	\$ (203.852)	\$ (103.647)
US Investment Grade Corporate Bond Fund						
Zum 31. Dez. 2022			Zum 31. Dez. 2021			
	Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
Euro	\$ 3.409	\$ (5.473)	\$ (2.064)	\$ 32.955	\$ (66.261)	\$ (33.306)
US Short-Term Fund						
Zum 31. Dez. 2022			Zum 31. Dez. 2021			
	Summe	Hedging	Netto	Summe	Hedging	Netto
Britisches Pfund Sterling	\$ 80.120	\$ (79.551)	\$ 569	\$ 157.500	\$ (327.608)	\$ (170.108)
Euro	92.035	(94.533)	(2.498)	108.302	(214.719)	(106.417)
	\$ 172.155	\$ (174.084)	\$ (1.929)	\$ 265.802	\$ (542.327)	\$ (276.525)

(c) Zinsrisiko

Das Zinsrisiko ist das Risiko, dass der Wert von Rentenwerten aufgrund veränderter Zinssätze sinkt. Bei einem Anstieg des Nominalzinssatzes sinkt voraussichtlich der Wert bestimmter, von den Fonds gehaltener Rentenwerte. Der Nominalzinssatz lässt sich als Summe des realen Zinssatzes und der voraussichtlichen Inflationsrate beschreiben. Rentenwerte mit längeren Laufzeiten reagieren eher empfindlich auf Änderungen der Zinssätze, was sie volatil macht als Wertpapiere mit kürzeren Laufzeiten. Die Duration dient hauptsächlich als Maß für die Sensitivität des Marktpreises eines Rentenpapiers gegenüber Zinssatzschwankungen (d. h. Renditeschwankungen).

Alle übrigen Fonds sind vornehmlich in Rentenwerten investiert und somit den Risiken ausgesetzt, die mit den Auswirkungen der Schwankungen der geltenden Marktzinsen auf ihre Finanzpositionen und Cashflows zusammenhängen. Diese Anlagen sind in der Aufstellung der Wertpapieranlagen ausgewiesen. Überschüssige Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente werden zu kurzfristigen Marktzinsen investiert.

Die Sensitivität der Exponierung der Gesellschaft gegenüber dem Zinsrisiko ist in den VaR-Gesamtberechnungen in Erläuterung 16 (a) angegeben.

(d) Liquiditätsrisiko

Das Liquiditätsrisiko eines Fonds wird hauptsächlich durch die Rücknahme von Anteilen ausgeübt. Inhaber gewinnberechtigter Anteile können einen Teil oder alle ihrer im Umlauf befindlichen Anteile gemäß den Bestimmungen des Prospekts zurückgeben. Rückgabeberechtigte Anteile werden auf Ansuchen des Anteilinhabers zurückgenommen und in der Vermögensaufstellung ausgewiesen. Die Vermögenswerte des Fonds bestehen hauptsächlich aus jederzeit veräußerbaren Wertpapieren, die umgehend verkauft werden können, um Rücknahmen von Anteilinhabern in Übereinstimmung mit dem Prospekt ausführen zu können. Ein Liquiditätsrisiko liegt vor, wenn sich bestimmte Anlagen schwer kaufen oder verkaufen lassen. Auch kann es bei illiquiden Wertpapieren die Bewertung schwieriger werden, insbesondere bei wechselhaften Märkten. Die Anlagen eines Fonds in illiquiden Wertpapieren können die Erträge des Fonds schmälern, da dieser eventuell nicht in der Lage ist, die illiquiden Wertpapiere zu einer günstigen Zeit oder einem günstigen Kurs zu veräußern. Fonds mit Kapitalanlagestrategien, die Devisen, Derivate oder Wertpapiere mit beträchtlichen Markt- und/oder Kreditrisiken enthalten, neigen dazu, am anfälligsten für Liquiditätsrisiken zu sein.

Darüber hinaus kann der Markt für bestimmte Anlagen bei widrigen Markt- oder Wirtschaftsbedingungen illiquide werden, unabhängig von individuellen ungünstigen Veränderungen der Lage eines bestimmten Emittenten. In diesen Fällen kann ein Fonds aufgrund von Beschränkungen bei der Anlage in illiquiden Wertpapieren und der Schwierigkeit, solche Wertpapiere oder Instrumente zu kaufen und zu verkaufen, nicht in der Lage sein, das gewünschte Maß an Engagement in einem bestimmten Sektor zu erreichen. Soweit die Hauptanlagestrategien eines Fonds Wertpapiere von Unternehmen mit geringeren Marktkapitalisierungen, ausländischen Wertpapieren, illiquiden Sektoren festverzinslicher Wertpapiere oder Wertpapiere mit erheblichem Markt- und/oder Kreditrisiko umfassen, weist der Fonds tendenziell ein höheres Engagement im Liquiditätsrisiko auf. Ferner könnten festverzinsliche Wertpapiere mit längeren Laufzeiten einem erhöhten Liquiditätsrisiko im Vergleich zu festverzinslichen Wertpapieren mit kürzeren Laufzeiten ausgesetzt sein.

Und schließlich bezieht sich das Liquiditätsrisiko auch auf das Risiko ungewöhnlich umfangreicher Rücknahmeanträge oder sonstiger ungewöhnlicher Marktbedingungen, die es einem Fonds erschweren können, Rücknahmeanträge innerhalb des zulässigen Zeitraums vollständig auszuführen. Die Erfüllung solcher Rücknahmeanträge könnte es erforderlich machen, dass ein Fonds Wertpapiere zu niedrigeren Kursen oder unter ungünstigen Bedingungen verkauft, was den Wert des Fonds verringern würde. Es kann auch der Fall sein, dass andere Marktteilnehmer versuchen, festverzinsliche Positionen zur gleichen Zeit wie ein Fonds zu liquidieren, was zu einem erhöhten Angebot auf dem Markt führen und zu Liquiditätsrisiko und Abwärtspreisdruk beitragen kann.

Für alle Fonds ist die Gesellschaft berechtigt, die Anzahl der Anteile eines Fonds, die an einem Geschäftstag zurückgegeben werden können, auf 10 % der Gesamtzahl der ausgegebenen Anteile dieses Fonds zu beschränken. In diesem Fall wird die Gesellschaft alle

Rücknahmeanträge an diesem Handelstag anteilig verringern und die Rücknahmeanträge so behandeln, als wären sie am jeweils nächsten Handelstag eingegangen, bis alle Anteile, auf die sich der ursprüngliche Antrag bezog, zurückgenommen wurden.

Die Satzung enthält besondere Bestimmungen für den Fall, dass infolge des Rücknahmeantrags eines Anteilinhabers Anteile in Höhe von mehr als 5 % des NIW der Anteile eines Fonds an einem Handelstag durch die Gesellschaft zurückgenommen würden. In einem solchen Fall kann die Gesellschaft in ihrem alleinigen Ermessen (soweit nicht anders in der maßgeblichen Fondsergänzung beschrieben) den Rücknahmeantrag durch die Übertragung von Vermögenswerten des jeweiligen Fonds an den Anteilinhaber in Sachwerten (in Wertpapieren) erfüllen, deren Wert dem Rücknahmepreis der zurückgenommenen Anteile entspricht, als würden die Rücknahmeerlöse in bar abzüglich etwaiger Rücknahmegebühren und sonstiger Übertragungskosten gezahlt, sofern eine solche Auszahlung den Interessen der verbleibenden Anteilinhaber dieses Fonds nicht abträglich ist. Wenn der Anteilinhaber, der eine solche Rücknahme beantragt, über die Absicht der Gesellschaft benachrichtigt wird, den Rücknahmeantrag durch eine solche Auszahlung von Vermögenswerten zu erfüllen, kann dieser Anteilinhaber von der Gesellschaft verlangen, anstelle der Übertragung dieser Vermögenswerte deren Verkauf zu arrangieren und die Erlöse des Verkaufs an diesen Anteilinhaber zu zahlen, wobei die anfallenden Kosten durch den jeweiligen Anteilinhaber getragen werden.

Um die Auswirkungen der Verwässerung zu verringern, kann der Verwaltungsrat nach eigenem Ermessen eine Swing-Pricing-Anpassung des Nettoinventarwerts je Anteil vornehmen.

Die derzeit bekannten Verbindlichkeiten der Fonds sind im Finanzstatus ausgewiesen. Der Großteil dieser Verbindlichkeiten ist innerhalb von drei Monaten zahlbar. Hiervon ausgenommen sind Verbindlichkeiten aus Finanzderivaten und leerverkauften Wertpapieren. Die frühesten vertraglichen Fälligkeitstermine für Verbindlichkeiten aus Finanzderivaten sind in der Aufstellung der Wertpapieranlagen angegeben.

Derivative Finanzinstrumente bestehen aus dem Marktwert von Devisenterminkontrakten, Terminkontrakten, Optionskontrakten und Swaps zum Ende des Geschäftsjahres. Derivative Finanzinstrumente sind finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten, die zu Handelszwecken gehalten werden, und werden hauptsächlich zur kurzfristigen Veräußerung erworben. Da nicht davon auszugehen ist, dass die Instrumente bis zur Fälligkeit oder Beendigung gehalten werden, stellt der aktuelle Marktwert den geschätzten Kapitalfluss dar, der erforderlich sein kann, um die Positionen zu veräußern. Zukünftige Kapitalflüsse der Fonds und realisierte Verbindlichkeiten können von den kurzfristigen Verbindlichkeiten aufgrund veränderter Marktbedingungen abweichen.

Die Anlageberatungsgesellschaften verwalten das Liquiditätsrisiko, indem sie die Portfolios überwachen und Anlagen prüfen, die als illiquide oder nicht jederzeit und sofort verkäuflich gelten, um sicherzustellen, dass ausreichend liquide Vermögenswerte vorhanden sind, um die ausstehenden Verbindlichkeiten der Fonds zu begleichen.

Einige Fonds können eine konzentrierte Anteilinhaberbasis aufweisen, wenn große institutionelle Anteilinhaber einen erheblichen Anteil am Nettovermögen eines Fonds halten. Dies setzt die anderen Anteilinhaber des Fonds gewissen Risiken aus. Zu diesen Risiken zählt das Risiko, dass an einem beliebigen Tag ein großer Teil der Vermögenswerte eines Fonds zurückgenommen werden kann, was die allgemeine Wirtschaftlichkeit des Fonds oder die Fähigkeit anderer Anteilinhaber beeinträchtigen könnte, die an diesem Tag keine Rücknahmeanträge gestellt haben, Rücknahmen beim Fonds zu beantragen, wenn es beispielsweise erforderlich werden kann, eine eingeschränkte Bearbeitung der Rücknahmeanträge zu veranlassen. Die nachfolgend aufgeführten Fonds sind einem erheblichen Konzentrationsrisiko ausgesetzt, da sie Anteilinhaber haben, die mehr als 20 % des Nettovermögens des Fonds halten. Eine solche Konzentration der Anteilinhaberbeteiligungen könnte wesentliche Auswirkungen auf den Fonds haben, sollte einer dieser Anteilinhaber die Rückzahlung erheblicher Kapitalbeträge beantragen. Der prozentuale Anteilsbesitz der Allianz-Gruppe, von Fonds der Gesellschaft, von mit der Gesellschaft verbundenen Fonds und von Mitarbeitern der Anlageberatungsgesellschaften wird nachstehend nicht angegeben, da dieser separat in Erläuterung 14 ausgewiesen wird.

Fondsbezeichnung	31. Dez. 2022		31. Dez. 2021	
	Name des Anteilinhabers	Beteiligung in %	Name des Anteilinhabers	Beteiligung in %
PIMCO Asia High Yield Bond Fund	Anteilinhaber C	k. A.	Anteilinhaber C	23,29
PIMCO Climate Bond Fund	Anteilinhaber R	k. A.	Anteilinhaber R	23,81
Commodity Real Return Fund	Anteilinhaber A	21,10	Anteilinhaber A	23,58
Diversified Income Duration Hedged Fund	Anteilinhaber B	22,79	Anteilinhaber B	k. A.
Dynamic Bond Fund	Anteilinhaber F	34,98	Anteilinhaber F	k. A.
Emerging Markets Corporate Bond Fund	Anteilinhaber O	54,14	Anteilinhaber O	54,07
PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	Anteilinhaber R	31,08	Anteilinhaber R	77,69

Fondsbezeichnung	31. Dez. 2022		31. Dez. 2021	
	Name des Anteilinhabers	Beteiligung in %	Name des Anteilinhabers	Beteiligung in %
Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	Anteilinhaber E	k. A.	Anteilinhaber E	25,68
Euro Bond Fund	Anteilinhaber J	22,29	Anteilinhaber J	k. A.
Euro Credit Fund	Anteilinhaber K	20,35	Anteilinhaber K	k. A.
Euro Long Average Duration Fund	Anteilinhabern M	36,92	Anteilinhabern M	39,37
Euro Short-Term Fund	Anteilinhaber L	20,79	Anteilinhaber L	k. A.
Euro Short-Term Fund	Anteilinhaber Q	k. A.	Anteilinhaber Q	20,50
Euro Short-Term Fund	Anteilinhaber W	24,59	Anteilinhaber W	k. A.
PIMCO European Short-Term Opportunities Fund	Anteilinhaber D	27,37	Anteilinhaber D	29,26
Global Advantage Fund	Anteilinhaber N	29,19	Anteilinhaber N	27,92
PIMCO Global Core Asset Allocation Fund	Anteilinhaber T	30,91	Anteilinhaber T	32,42
Global Investment Grade Credit ESG Fund	Anteilinhaber S	20,85	Anteilinhaber S	k. A.
Income Fund II	Anteilinhaber U	46,97	Anteilinhaber U	k. A.
Low Duration Global Investment Grade Credit Fund	Anteilinhaber I	k. A.	Anteilinhaber I	43,67
Low Duration Global Investment Grade Credit Fund	Anteilinhaber Y	46,86	Anteilinhaber Y	k. A.
Low Duration Income Fund	Anteilinhaber I	k. A.	Anteilinhaber I	49,78
Low Duration Income Fund	Anteilinhaber Y	54,34	Anteilinhaber Y	k. A.
PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	Anteilinhaber P	k. A.	Anteilinhaber P	24,33
PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	Anteilinhaber AA	34,76	Anteilinhaber AA	k. A.
Mortgage Opportunities Fund	Anteilinhaber V	k. A.	Anteilinhaber V	23,24
PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	Anteilinhaber X	k. A.	Anteilinhaber X	52,54
UK Corporate Bond Fund	Anteilinhaber G	k. A.	Anteilinhaber G	32,69
UK Long Term Corporate Bond Fund	Anteilinhaber H	44,00	Anteilinhaber H	35,82
US Investment Grade Corporate Bond Fund	Anteilinhaber Z	k. A.	Anteilinhaber Z	34,45

(e) Kredit- und Kontrahentenrisiken

Die Fonds setzen sich gegenüber Parteien, mit denen sie Geschäfte tätigen, einem Kreditrisiko aus. Hinzu kommt das Risiko eines Zahlungsausfalls. Die Fonds handeln mit Kontrahenten, die derzeit ein Mindestrating von BBB/Baa2 halten. Die Fonds minimieren die Konzentration des Kreditrisikos, indem sie Transaktionen gegebenenfalls mit einer Vielzahl von Kunden und Kontrahenten an anerkannten und renommierten Börsen durchführen. OTC-Derivatgeschäfte sind dem Risiko ausgesetzt, dass der Kontrahent der Transaktion seinen vertraglichen Verpflichtungen gegenüber der jeweils anderen Partei nicht nachkommt, da viele der im Rahmen zentral abgerechneter Derivattransaktionen geltenden Schutzmechanismen für OTC-Derivatgeschäfte gegebenenfalls nicht zur Verfügung stehen. Für derivative Finanzinstrumente, die an Börsen oder über Clearingstellen gehandelt werden, betrifft das primäre Kreditrisiko die Bonität des Clearing-Brokers des Fonds bzw. der Börse oder Clearingstelle selbst. Die Fonds können Geld verlieren, wenn der Emittent oder Garant eines Rentenwerts oder der Kontrahent eines Finanzderivats, Pensionsgeschäfts oder eines Darlehens von Portfoliowertpapieren nicht in der Lage oder nicht bereit ist, Kapital- und/oder Zinszahlungen rechtzeitig vorzunehmen oder anderweitig seinen Verpflichtungen nachzukommen. Wertpapiere und Finanzderivate unterliegen Kreditrisiken unterschiedlichen Grades, die sich oft in den Bonitätsbewertungen widerspiegeln.

Wie beim Kreditrisiko können die Fonds dem Kontrahentenrisiko oder dem Risiko ausgesetzt sein, dass eine Organisation oder eine andere Einheit, mit der die Fonds unbeglichene oder offene Transaktionen haben, säumig wird. PIMCO und die Anlageberatungsgesellschaften minimieren die Kontrahentenrisiken der Fonds auf mehrere Arten. Vor Abschluss einer Transaktion mit einem neuen Kontrahenten führt das Counterparty Risk Committee (Ausschuss für Kontrahentenrisiken) von PIMCO eine umfassende Bonitätsprüfung des Kontrahenten durch und muss die Verwendung des betreffenden vorab Kontrahenten genehmigen. Darüber hinaus gilt gemäß den Bestimmungen des zugrunde liegenden Vertrags: Wenn nicht eingezahlte Beträge, die einem Fonds geschuldet werden, eine vorab festgelegte Schwelle überschreiten, muss dieser Kontrahent dem Fonds Sicherheiten in Form von Barmitteln oder Wertpapieren in der Höhe vorschließen, die dem Wert des nicht eingezahlten und dem Fonds geschuldeten Betrags entsprechen. Der Fonds darf diese Sicherheiten in Wertpapieren oder andere Instrumente anlegen und zahlt dem Kontrahenten gewöhnlich Zinsen auf die erhaltenen Sicherheiten. Verringert sich der einem jeden Fonds geschuldete Betrag teilweise an den Kontrahenten zurückzugeben.

Alle Geschäfte mit notierten Wertpapieren werden bei Lieferung durch zugelassene Kontrahenten abgewickelt/bezahlt. Das Zahlungsunfähigkeitsrisiko gilt als minimal, da die Lieferung der verkauften Wertpapiere ausschließlich erfolgt, wenn die Fonds die Zahlung erhalten haben. Die Zahlung für einen Kauf erfolgt, sobald der Kontrahent die Wertpapiere geliefert hat. Das Geschäft schlägt fehl, wenn eine der Parteien ihre Verpflichtungen nicht erfüllt.

Rahmenaufrechnungsverträge Bestimmte Fonds unterliegen gegebenenfalls unterschiedlichen Rahmenaufrechnungsvereinbarungen („Rahmenverträge“) mit ausgewählten Kontrahenten. Die Rahmenverträge legen die Bedingungen bestimmter Transaktionen fest und verringern das Kontrahentenrisiko, das mit den jeweiligen Transaktionen verbunden ist, indem Schutzmechanismen für die Kreditsicherheit sowie Standardisierungen eingesetzt werden, die die rechtliche Sicherheit erhöhen. Jede Art

von Rahmenvertrag regelt bestimmte Arten von Transaktionen. Verschiedene Arten von Transaktionen können von verschiedenen Körperschaften oder verbundenen Parteien einer bestimmten Organisation gehandelt werden, was zur Folge hat, dass mit ein und demselben Kontrahenten mehrere Vereinbarungen notwendig sind. Da die Rahmenverträge für individuelle Aspekte unterschiedlicher Vermögensarten spezifisch sind, ist den Fonds im Verzugsfall hinsichtlich aller einem einzigen Rahmenvertrag mit einem Kontrahenten unterliegenden Transaktionen eine Glattstellung und Aufrechnung des Gesamtengagements bei einem Kontrahenten möglich. Für Zwecke der Finanzberichterstattung werden derivative Vermögenswerte und Verbindlichkeiten im Finanzstatus grundsätzlich auf Bruttobasis ausgewiesen, was die vollständigen Risiken und Engagements vor Saldierung abbildet.

Rahmenverträge können zu einer Verringerung des Kontrahentenrisikos beitragen, indem Vereinbarungen über das Stellen von Sicherheiten bei vorher festgelegten Risikoniveaus vorgegeben werden. Laut den meisten Rahmenverträgen werden Sicherheiten routinemäßig übertragen, wenn das Nettoengagement insgesamt bei bestimmten Transaktionen (ohne die bereits bestehenden Sicherheiten), die dem betreffenden Rahmenvertrag mit einem Kontrahenten unterliegen, in einem bestimmten Konto über eine bestimmte Schwelle hinausgeht, die normalerweise zwischen null und 250.000 USD liegt, je nach dem Kontrahenten und der Art des Rahmenvertrags. United States Treasury Bills und Barmittel in US-Dollar sind im Allgemeinen die bevorzugten Formen von Sicherheiten, obwohl in Abhängigkeit von den im jeweiligen Rahmenvertrag festgelegten Bedingungen auch andere Formen von mit AAA bewerteten Wertpapieren verwendet werden können. Wertpapiere und Barmittel, die als Sicherheiten verwendet werden, werden im Finanzstatus als Vermögenswerte entweder als eine Komponente in dem ergebniswirksam zum Marktwert bewerteten Finanzvermögen (übertragbare Wertpapiere) oder als Einlagen bei Kontrahenten (Barmittel) ausgewiesen. Erhaltene Barsicherheiten werden üblicherweise nicht in einem gesonderten Konto gehalten und werden somit im Finanzstatus als Verbindlichkeit als Einlagen von Kontrahenten ausgewiesen. Der Marktwert von als Sicherheiten erhaltenen Wertpapieren wird nicht als Komponente des NIW ausgewiesen. Das allgemeine Kontrahentenrisiko für die Fonds kann sich innerhalb kurzer Zeit erheblich ändern, da es sich mit jeder Transaktion gemäß dem jeweiligen Rahmenvertrag ändert.

Rahmenverträge für Pensionsgeschäfte und globale Rahmenverträge für Pensionsgeschäfte (einzeln und zusammen „Rahmenverträge für Pensionsgeschäfte“) regeln Pensionsgeschäfte, umgekehrte Pensionsgeschäfte und Sale-Buyback-Geschäfte zwischen den Fonds und ausgewählten Kontrahenten. Die Rahmenverträge für Pensionsgeschäfte enthalten unter anderem Bestimmungen für den Abschluss, Ertragszahlungen, Verzugsereignisse sowie die Bereitstellung von Sicherheiten. Der Marktwert von Transaktionen gemäß dem Rahmenvertrag für Pensionsgeschäfte, die verpfändeten oder erhaltenen Sicherheiten und das Nettoengagement je Kontrahent zum Ende des Geschäftsjahres sind in den Erläuterungen zur Aufstellung der Wertpapieranlagen ausgewiesen.

Rahmenverträge für Wertpapier-Termingeschäfte („Rahmenverträge für Termingeschäfte“) regeln bestimmte in der Zukunft liegende Abwicklungen, wie TBA-, Delayed-Delivery- oder Sale-Buyback-Geschäfte zwischen den Fonds und ausgewählten Kontrahenten. Die Rahmenterminverträge enthalten Bestimmungen u. a.

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)

für Aktivierung und Bestätigung, Zahlung und Übertragung, Verzugsfälle, Kündigung und Halten von Sicherheiten. Der Marktwert von Transaktionen mit in der Zukunft liegender Abwicklungen, die verpfändeten oder erhaltenen Sicherheiten und das Nettoengagement je Kontrahent zum Ende des Geschäftsjahres sind in den Erläuterungen zur Aufstellung der Wertpapieranlagen ausgewiesen.

Die Rahmenverträge und Besicherungsanhänge (Credit Support Annexes) der International Swaps and Derivatives Association, Inc. („ISDA-Rahmenverträge“) regeln OTC-Derivatgeschäfte zwischen den Fonds und ausgewählten Kontrahenten. Die ISDA-Rahmenverträge enthalten Bestimmungen zu allgemeinen Verpflichtungen, Zusicherungen, Vereinbarungen, Sicherheiten und Säumigkeit bzw. Auflösung. Ereignisse, die zur Kündigung des Vertrags führen, umfassen Umstände, die Kontrahenten dazu ermächtigen können, den Vertrag vorzeitig zu beenden und die Begleichung aller ausstehenden Transaktionen nach dem geltenden ISDA-Rahmenvertrag einzuleiten. Eine Entscheidung, den Vertrag vorzeitig zu beenden, könnte sich wesentlich auf den Abschluss auswirken. Unter bestimmten Umständen kann der ISDA-Rahmenvertrag weitere

Bestimmungen enthalten, wodurch zusätzlicher Kontrahentenschutz entsteht, der über den Schutz des täglich vorhandenen Risikos hinausgeht, wenn sich die Kreditqualität des Kontrahenten unter ein vorab festgelegtes Niveau verringert. Diese etwaigen Beträge können (oder müssen, falls gesetzlich vorgeschrieben) bei einer dritten Verwahrstelle gesondert gehalten werden. Der Marktwert von OTC-Finanzderivaten, die erhaltenen oder verpfändeten Sicherheiten und das Nettoengagement je Kontrahent zum Ende des Geschäftsjahres sind in den Erläuterungen zur Aufstellung der Wertpapieranlagen ausgewiesen. Die Anlageberatungsgesellschaft führt umfangreiche Recherchen und Analysen durch, um das Kreditrisiko der Fonds zu bestimmen und zu messen. Die Anlageberatungsgesellschaft überprüft ständig das Kreditrisiko der Fonds, um Erträge zu erzielen, indem Anlagen entweder vorgenommen oder gemieden werden. Die Wertpapiere sind in unterschiedlichem Umfang Kreditrisiken ausgesetzt, was sich häufig in den Bonitätsratings widerspiegelt. Die Tabelle unten fasst die Gestaltung der Bonität des Nettovermögens der einzelnen Fonds zusammen.

	PIMCO Asia High Yield Bond Fund		Asia Strategic Interest Bond Fund		PIMCO Capital Securities Fund	
	31. Dez. 2022	31. Dez. 2021	31. Dez. 2022	31. Dez. 2021	31. Dez. 2022	31. Dez. 2021
Investment Grade	34 %	39 %	70 %	65 %	76 %	72 %
Non-Investment Grade	66 %	61 %	30 %	35 %	24 %	28 %
Nicht bewertet	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %
	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %

	PIMCO Climate Bond Fund		Commodity Real Return Fund		PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	
	31. Dez. 2022	31. Dez. 2021	31. Dez. 2022	31. Dez. 2021	31. Dez. 2022	31. Dez. 2021
Investment Grade	91 %	82 %	99 %	98 %	68 %	41 %
Non-Investment Grade	9 %	18 %	1 %	2 %	32 %	59 %
Nicht bewertet	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %
	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %

	Diversified Income Fund		Diversified Income Duration Hedged Fund		Diversified Income ESG Fund	
	31. Dez. 2022	31. Dez. 2021	31. Dez. 2022	31. Dez. 2021	31. Dez. 2022	31. Dez. 2021
Investment Grade	79 %	73 %	71 %	65 %	69 %	k. A.
Non-Investment Grade	21 %	27 %	29 %	35 %	31 %	k. A.
Nicht bewertet	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %	k. A.
	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %	k. A.

	Dynamic Bond Fund		Dynamic Multi-Asset Fund		Emerging Local Bond Fund	
	31. Dez. 2022	31. Dez. 2021	31. Dez. 2022	31. Dez. 2021	31. Dez. 2022	31. Dez. 2021
Investment Grade	87 %	78 %	96 %	94 %	75 %	76 %
Non-Investment Grade	13 %	22 %	4 %	6 %	25 %	24 %
Nicht bewertet	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %
	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %

	Emerging Local Bond ESG Fund		Emerging Markets Bond Fund		Emerging Markets Bond ESG Fund	
	31. Dez. 2022	31. Dez. 2021	31. Dez. 2022	31. Dez. 2021	31. Dez. 2022	31. Dez. 2021
Investment Grade	87 %	k. A.	67 %	58 %	66 %	57 %
Non-Investment Grade	13 %	k. A.	33 %	42 %	34 %	43 %
Nicht bewertet	0 %	k. A.	0 %	0 %	0 %	0 %
	100 %	k. A.	100 %	100 %	100 %	100 %

	Emerging Markets Corporate Bond Fund		PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund		Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	
	31. Dez. 2022	31. Dez. 2021	31. Dez. 2022	31. Dez. 2021	31. Dez. 2022	31. Dez. 2021
Investment Grade	75 %	59 %	84 %	63 %	83 %	82 %
Non-Investment Grade	25 %	41 %	16 %	37 %	17 %	18 %
Nicht bewertet	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %
	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %

	PIMCO ESG Income Fund		Euro Bond Fund		Euro Credit Fund	
	31. Dez. 2022	31. Dez. 2021	31. Dez. 2022	31. Dez. 2021	31. Dez. 2022	31. Dez. 2021
Investment Grade	88 %	70 %	97 %	96 %	97 %	97 %
Non-Investment Grade	12 %	30 %	3 %	4 %	3 %	3 %
Nicht bewertet	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %
	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %

	Euro Income Bond Fund		Euro Long Average Duration Fund		Euro Short-Term Fund	
	31. Dez. 2022	31. Dez. 2021	31. Dez. 2022	31. Dez. 2021	31. Dez. 2022	31. Dez. 2021
Investment Grade	82 %	74 %	100 %	96 %	97 %	92 %
Non-Investment Grade	18 %	26 %	0 %	4 %	3 %	8 %
Nicht bewertet	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %
	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %

	PIMCO European High Yield Bond Fund		PIMCO European Short-Term Opportunities Fund		Global Advantage Fund	
	31. Dez. 2022	31. Dez. 2021	31. Dez. 2022	31. Dez. 2021	31. Dez. 2022	31. Dez. 2021
Investment Grade	44 %	29 %	95 %	93 %	90 %	89 %
Non-Investment Grade	56 %	71 %	5 %	7 %	10 %	11 %
Nicht bewertet	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %
	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %
	Global Bond Fund		Global Bond ESG Fund		Global Bond Ex-US Fund	
	31. Dez. 2022	31. Dez. 2021	31. Dez. 2022	31. Dez. 2021	31. Dez. 2022	31. Dez. 2021
Investment Grade	96 %	94 %	97 %	91 %	93 %	92 %
Non-Investment Grade	4 %	6 %	3 %	9 %	7 %	8 %
Nicht bewertet	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %
	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %
	PIMCO Global Core Asset Allocation Fund		Global High Yield Bond Fund		Global Investment Grade Credit Fund	
	31. Dez. 2022	31. Dez. 2021	31. Dez. 2022	31. Dez. 2021	31. Dez. 2022	31. Dez. 2021
Investment Grade	93 %	93 %	22 %	15 %	90 %	89 %
Non-Investment Grade	7 %	7 %	78 %	85 %	10 %	11 %
Nicht bewertet	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %
	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %
	Global Investment Grade Credit ESG Fund		Global Low Duration Real Return Fund		Global Real Return Fund	
	31. Dez. 2022	31. Dez. 2021	31. Dez. 2022	31. Dez. 2021	31. Dez. 2022	31. Dez. 2021
Investment Grade	94 %	87 %	100 %	100 %	99 %	99 %
Non-Investment Grade	6 %	13 %	0 %	0 %	1 %	1 %
Nicht bewertet	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %
	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %
	Income Fund		Income Fund II		Inflation Multi-Asset Fund	
	31. Dez. 2022	31. Dez. 2021	31. Dez. 2022	31. Dez. 2021	31. Dez. 2022	31. Dez. 2021
Investment Grade	77 %	72 %	70 %	67 %	97 %	97 %
Non-Investment Grade	23 %	28 %	30 %	33 %	3 %	3 %
Nicht bewertet	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %
	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %
	Low Average Duration Fund		Low Duration Global Investment Grade Credit Fund		Low Duration Income Fund	
	31. Dez. 2022	31. Dez. 2021	31. Dez. 2022	31. Dez. 2021	31. Dez. 2022	31. Dez. 2021
Investment Grade	99 %	97 %	93 %	91 %	80 %	69 %
Non-Investment Grade	1 %	3 %	7 %	9 %	20 %	31 %
Nicht bewertet	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %
	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %
	Low Duration Opportunities Fund		Low Duration Opportunities ESG Fund		PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	
	31. Dez. 2022	31. Dez. 2021	31. Dez. 2022	31. Dez. 2021	31. Dez. 2022	31. Dez. 2021
Investment Grade	87 %	89 %	97 %	k. A.	100 %	100 %
Non-Investment Grade	13 %	11 %	3 %	k. A.	0 %	0 %
Nicht bewertet	0 %	0 %	0 %	k. A.	0 %	0 %
	100 %	100 %	100 %	k. A.	100 %	100 %
	Mortgage Opportunities Fund		StocksPLUS™ Fund		PIMCO StocksPLUS™ AR Fund	
	31. Dez. 2022	31. Dez. 2021	31. Dez. 2022	31. Dez. 2021	31. Dez. 2022	31. Dez. 2021
Investment Grade	71 %	80 %	85 %	95 %	94 %	91 %
Non-Investment Grade	29 %	20 %	15 %	5 %	6 %	9 %
Nicht bewertet	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %
	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %
	Strategic Income Fund		Total Return Bond Fund		PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	
	31. Dez. 2022	31. Dez. 2021	31. Dez. 2022	31. Dez. 2021	31. Dez. 2022	31. Dez. 2021
Investment Grade	76 %	69 %	96 %	93 %	95 %	93 %
Non-Investment Grade	24 %	31 %	4 %	7 %	5 %	7 %
Nicht bewertet	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %
	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)

	UK Corporate Bond Fund		UK Long Term Corporate Bond Fund		US High Yield Bond Fund	
	31. Dez. 2022	31. Dez. 2021	31. Dez. 2022	31. Dez. 2021	31. Dez. 2022	31. Dez. 2021
Investment Grade	98 %	95 %	97 %	94 %	20 %	12 %
Non-Investment Grade	2 %	5 %	3 %	6 %	80 %	88 %
Nicht bewertet	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %
	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %

	US Investment Grade Corporate Bond Fund		US Short-Term Fund	
	31. Dez. 2022	31. Dez. 2021	31. Dez. 2022	31. Dez. 2021
Investment Grade	95 %	89 %	99 %	98 %
Non-Investment Grade	5 %	11 %	1 %	2 %
Nicht bewertet	0 %	0 %	0 %	0 %
	100 %	100 %	100 %	100 %

Im Wesentlichen werden alle Wertpapiere der Gesellschaft zum 31. Dezember 2022 und zum 31. Dezember 2021 von State Street Custodial Services (Ireland) Limited (die „Verwahrstelle“) treuhänderisch gehalten. Diese Vermögenswerte werden in gesonderten Konten für jeden Fonds (in Übereinstimmung mit den OGAW-Richtlinien der Zentralbank) gehalten, was das Ausfallrisiko für den Besitz der aufbewahrten Vermögenswerte reduziert. Die Gesellschaft ist jedoch dem Kreditrisiko eines Kreditinstituts ausgesetzt, das ihre Einlagen hält.

Das langfristige Bonitätsrating der State Street Corporation, der obersten Muttergesellschaft der Verwahrstelle, war zum 31. Dezember 2022 AA- (31. Dezember 2021: AA-), ausgestellt von der Ratingagentur Fitch.

Folgende Transaktionen wurden in den Geschäftsjahren zum 31. Dezember 2022 und 31. Dezember 2021 über einen Broker ausgeführt, bei dem es sich um eine verbundene Person der Verwaltungsgesellschaft, der Anlageberatungsgesellschaften und/oder der Unter-Anlageberatungsgesellschaften, der Verwahrstelle und der Verwaltungsratsmitglieder der Gesellschaft handelt:

Fonds	31. Dez. 2022		31. Dez. 2021	
	Summe Käufe und Verkäufe ('000)	% Summe Käufe und Verkäufe	Summe Käufe und Verkäufe ('000)	% Summe Käufe und Verkäufe
PIMCO Asia High Yield Bond Fund	\$ 22.258.882	32,25	\$ 7.611.856	19,11
Asia Strategic Interest Bond Fund	730.951	15,06	318.589	10,42
Commodity Real Return Fund	3.040.615	4,33	1.137.728	2,70
Diversified Income Fund	17.399.378	4,21	11.383.813	2,83
Emerging Local Bond Fund	1.659.744	2,12	3.857.507	5,00
Emerging Markets Bond Fund	3.169.131	7,60	1.724.699	5,25
Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	74.306	4,64	83.567	4,29
Global Bond Fund	9.557.901	1,81	7.593.412	1,63
Global High Yield Bond Fund	4.538.756	6,31	1.186.592	2,05
Global Investment Grade Credit Fund	3.450.967	2,04	4.221.083	1,35
Global Real Return Fund	1.300.718	1,03	2.790.010	1,76
Income Fund	349.874.783	11,02	31.143.041	1,62
Income Fund II	644	0,07	2.799	0,42
Low Average Duration Fund	2.519.168	3,60	319.689	1,56
Total Return Bond Fund	9.037.904	5,40	1.717.179	1,39
US High Yield Bond Fund	5.136.959	14,37	1.135.147	5,59

Es wurde in den Geschäftsjahren zum 31. Dezember 2022 und 31. Dezember 2021 keine Provision für die Transaktionen in der vorstehenden Tabelle erhoben.

Einzelheiten zu Aktien, die in den Geschäftsjahren zum 31. Dezember 2022 und 31. Dezember 2021 durch Verwaltungsratsmitglieder der Gesellschaft in durch die SFC zugelassenen Fonds gehalten wurden, sind Erläuterung 14 zu entnehmen. Einzelheiten zu Gebühren, die in den Geschäftsjahren zum 31. Dezember 2022 und 31. Dezember 2021 an Verwaltungsratsmitglieder der Gesellschaft gezahlt wurden, sind Erläuterung 13 zu entnehmen.

Einzelheiten zum Wert der umlaufenden Anteile, die in den Geschäftsjahren zum 31. Dezember 2022 und 31. Dezember 2021 durch verbundene Personen der Verwaltungsgesellschaft, der Anlageberatungsgesellschaften und/oder der Unter-Anlageberatungsgesellschaften gehalten wurden und über 20 % des Nettovermögens von durch die SFC zugelassenen Fonds betragen, sind Erläuterung 14 zu entnehmen. Einzelheiten zu Gebühren, die an die Verwaltungsgesellschaft, die Anlageberatungsgesellschaften und/oder Unter-Anlageberatungsgesellschaften gezahlt wurden, sind Erläuterung 13 und der Betriebsergebnisrechnung zu entnehmen.

17. TRANSAKTIONEN MIT VERBUNDENEN PERSONEN FÜR DIE IN HONGKONG VERTRIEBENEN FONDS

Verbundene Personen der Verwaltungsgesellschaft, der Anlageberatungsgesellschaften und/oder der Unter-Anlageberatungsgesellschaften, der Verwahrstelle und der Verwaltungsratsmitglieder der Gesellschaft sind jene, die im Code on Unit Trusts and Mutual Funds der Securities and Futures Commission of Hong Kong (der „SFC-Code“) definiert sind. Alle Transaktionen, die während des Geschäftsjahres zwischen den durch die SFC zugelassenen Fonds („durch die SFC zugelassene Fonds“), wie im Abschnitt zu den allgemeinen Merkmalen des Jahresberichts beschrieben, und der Verwaltungsgesellschaft, den Anlageberatungsgesellschaften und/oder den Unter-Anlageberatungsgesellschaften, der Verwahrstelle und den Verwaltungsratsmitglieder der Gesellschaft sowie deren jeweiligen verbundenen Personen eingegangen wurden, wurden im Rahmen der normalen Geschäftstätigkeit und zu den üblichen Geschäftsbedingungen abgeschlossen.

Verwaltungsratsmitglieder und leitende Angestellte der Verwahrstelle hielten in den Geschäftsjahren zum 31. Dezember 2022 und 31. Dezember 2021 keine Anteile der durch die SFC zugelassenen Fonds. Wie in Erläuterung 13 angegeben, wurden die Gebühren und Aufwendungen der Verwahrstelle durch die Verwaltungsgesellschaft aus der Verwaltungsgebühr oder durch die Anlageberatungsgesellschaften gezahlt. Wie in Erläuterung 4 angegeben, wurden alle Bankguthaben der durch die SFC zugelassenen Fonds entweder von State Street Bank and Trust Co. in ihrer Eigenschaft als Vertreterin der Verwahrstelle oder direkt bei einer Unterverwahrstelle gehalten. Gegebenenfalls wurden den durch die SFC zugelassenen Fonds durch die Verwahrstelle Zinsen auf diese Barsalden gezahlt oder berechnet.

18. GRUNDKAPITAL (a) Genehmigte Anteile

Das genehmigte Grundkapital der Gesellschaft beträgt 38.092 EUR und ist in 30.000 Zeichneranteile zu je 1,27 EUR und 500.000.000.000 gewinnberechtigende Anteile ohne Nennwert aufgeteilt, die ursprünglich als „nicht klassifizierte Anteile“ bezeichnet wurden.

(b) Zeichneranteile

Bis auf sieben sind die ursprünglichen 30.000 Zeichneranteile zurückgenommen worden. Die Zeichneranteile sind nicht Bestandteil des NIW der Gesellschaft und werden daher im Abschluss nur in Form dieser Erläuterung erwähnt. Diese Offenlegung spiegelt nach Ansicht des Verwaltungsrats das Wesen der Geschäftstätigkeit der Gesellschaft als Investmentfonds wider.

(c) Rückgabe- und gewinnberechtigte Anteile

Das ausgegebene gewinnberechtigte Grundkapital entspricht jederzeit dem NIW der Fonds. Rückgabe- und gewinnberechtigte Anteile werden auf Antrag des Anteilnehmers zurückgenommen und sind als Finanzverbindlichkeiten klassifiziert. Die Anzahl der gewinnberechtigten Anteile hat sich während der zum 31. Dezember 2022 und 31. Dezember 2021 endenden Geschäftsjahre wie folgt verändert (Angaben in Tausend):

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
PIMCO Asia High Yield Bond Fund		
Institutional:		
thesaurierend		
Begeben	147.409	125.307
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(90.909)	(30.398)
	56.500	94.909
Erträge		
Begeben	2.322	27.748
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	26	18
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(14.441)	(3.804)
	(12.093)	23.962
Institutional AUD (Hedged):		
thesaurierend		
Begeben	26.623	1
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	1.749	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1)	0
	28.371	1
Institutional CHF (Hedged):		
thesaurierend		
Begeben	56	3.788
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(3.326)	(577)
	(3.270)	3.211
Erträge		
Begeben	64	580
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(374)	(72)
	(310)	508
Institutional EUR (Hedged):		
thesaurierend		
Begeben	42.800	78.754
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(49.261)	(12.216)
	(6.461)	66.538
Erträge		
Begeben	10.911	9.985
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	50	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(15.600)	(2.410)
	(4.639)	7.575
Institutional GBP (Hedged):		
thesaurierend		
Begeben	942	2.205
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.102)	(209)
	(160)	1.996
Erträge		
Begeben	1.996	9.212
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	1	1
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(5.990)	(2.152)
	(3.993)	7.061

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
PIMCO Asia High Yield Bond Fund (Fortsetzung)		
Institutional RMB (Hedged):		
Erträge		
Begeben	0	1
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1)	0
	(1)	1
Institutional SGD (Hedged):		
Erträge		
Begeben	52	9
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	1	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(9)	0
	44	9
Investor:		
thesaurierend		
Begeben	471	2.262
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.508)	(61)
	(1.037)	2.201
Erträge		
Begeben	1.782	29.267
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(23.044)	(4.207)
	(21.262)	25.060
Investor AUD (Hedged):		
Erträge		
Begeben	14	542
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	3	2
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(39)	0
	(22)	544
Investor EUR (Hedged):		
Erträge		
Begeben	36	85
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	4	3
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(20)	0
	20	88
Investor RMB (Hedged):		
Erträge		
Begeben	0	193
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	1	1
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(94)	0
	(93)	194
Investor SGD (Hedged):		
Erträge		
Begeben	94	746
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(256)	(108)
	(162)	638
Administrative:		
Erträge		
Begeben	1.522	6.792
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.214)	(3.895)
	(692)	2.897
Class E:		
thesaurierend		
Begeben	2.822	8.784
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(3.457)	(1.233)
	(635)	7.551

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
PIMCO Asia High Yield Bond Fund (Fortsetzung)		
Erträge		
Begeben	1.198	10.389
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	74	48
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(4.616)	(1.552)
	(3.344)	8.885
Class E CHF (Hedged): thesaurierend		
Begeben	143	140
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(148)	(11)
	(5)	129
Erträge		
Begeben	4	29
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	0
	4	29
Class E EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	1.933	6.849
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.255)	(2.100)
	(322)	4.749
Erträge		
Begeben	384	1.241
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	12	5
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(333)	(191)
	63	1.055
Class E HKD (Unhedged): Erträge		
Begeben	408	3.909
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	3	2
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(30)	(3.634)
	381	277
Class E SGD (Hedged): Erträge		
Begeben	283	2.097
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	26	22
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.065)	(406)
	(756)	1.713
H Institutional: thesaurierend		
Begeben	152	46
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	(26)
	152	20
Erträge		
Begeben	0	934
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	5	19
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(6)	(873)
	(1)	80
M Retail: ausschüttend II		
Begeben	403	1.877
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	27	20
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(477)	(432)
	(47)	1.465

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
PIMCO Asia High Yield Bond Fund (Fortsetzung)		
M Retail HKD (Unhedged): ausschüttend II		
Begeben	339	723
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	2	3
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(842)	(112)
	(501)	614
M Retail SGD (Hedged): ausschüttend II		
Begeben	43	788
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	16	11
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(89)	(135)
	(30)	664
Class Z: thesaurierend		
Begeben	1.622	2.405
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(4.918)	(2.948)
	(3.296)	(543)
Asia Strategic Interest Bond Fund		
Institutional: Erträge		
Begeben	6.037	7.171
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	90	7
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(6.309)	(582)
	(182)	6.596
Institutional EUR (Hedged): Erträge		
Begeben	4.068	12.724
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.641)	(1.656)
	1.427	11.068
Institutional GBP (Hedged): Erträge		
Begeben	6	19
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	1	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	0
	7	19
Institutional SGD (Hedged): Erträge		
Begeben	2	158
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(101)	(4)
	(99)	154
Class E: thesaurierend		
Begeben	97	35
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(4)	(35)
	93	0
Erträge		
Begeben	1.119	1.467
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	3	3
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(687)	(1.060)
	435	410
Class E EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	217	546
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(69)	(14)
	148	532

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
Asia Strategic Interest Bond Fund (Fortsetzung)		
Class E EUR (Unhedged): thesaurierend		
Begeben	146	1.066
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(349)	(339)
	(203)	727
Class E HKD (Unhedged): Erträge		
Begeben	0	351
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	5	3
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	0
	5	354
Class E SGD (Hedged): Erträge		
Begeben	0	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	1	1
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	0
	1	1
M Retail HKD (Unhedged): Erträge		
Begeben	66	589
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(432)	(1.347)
	(366)	(758)
Class Z: thesaurierend		
Begeben	0	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(609)	(1)
	(609)	(1)
PIMCO Capital Securities Fund		
Institutional: thesaurierend		
Begeben	26.728	64.372
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(61.431)	(54.821)
	(34.703)	9.551
Erträge		
Begeben	7.801	32.356
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	18	16
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(30.396)	(7.962)
	(22.577)	24.410
Institutional AUD (Hedged): Erträge		
Begeben	0	1
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1)	0
	(1)	1
Institutional BRL (Hedged): thesaurierend		
Begeben	626	5.434
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(3.441)	(658)
	(2.815)	4.776

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
PIMCO Capital Securities Fund (Fortsetzung)		
Institutional CHF (Hedged): thesaurierend		
Begeben	862	5.244
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(4.292)	(1.400)
	(3.430)	3.844
Institutional EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	40.278	70.147
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(71.053)	(61.487)
	(30.775)	8.660
Erträge		
Begeben	796	6.944
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	20	6
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.261)	(7.772)
	(1.445)	(822)
ausschüttend II		
Begeben	134	1.843
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(489)	(269)
	(355)	1.574
Institutional GBP (Hedged): thesaurierend		
Begeben	743	1.214
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(921)	(973)
	(178)	241
Erträge		
Begeben	1.859	3.221
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	6	39
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(3.868)	(4.998)
	(2.003)	(1.738)
Institutional RMB (Hedged): Erträge		
Begeben	0	1
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1)	0
	(1)	1
Institutional SGD (Hedged): Erträge		
Begeben	17	6
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	(2)
	17	4
Investor: thesaurierend		
Begeben	1.648	10.726
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(8.354)	(4.328)
	(6.706)	6.398
Erträge		
Begeben	1.282	8.050
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(15.075)	(4.600)
	(13.793)	3.450

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
PIMCO Capital Securities Fund (Fortsetzung)		
Investor AUD (Hedged): Erträge		
Begeben	1.565	151
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.624)	(122)
	(1.059)	29
Investor CAD (Hedged): Erträge		
Begeben	0	380
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	1	1
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	0
	1	381
Investor EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	397	1.174
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.020)	(421)
	(1.623)	753
Investor GBP (Hedged): Erträge		
Begeben	61	192
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(86)	(59)
	(25)	133
Investor RMB (Hedged): Erträge		
Begeben	0	95
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(17)	(92)
	(17)	3
Investor SGD (Hedged): Erträge		
Begeben	320	113
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(174)	(67)
	146	46
Administrative: thesaurierend		
Begeben	2.926	2.064
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.384)	(4.581)
	542	(2.517)
Erträge		
Begeben	527	2.650
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	13	2
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.116)	(2.612)
	(1.576)	40
ausschüttend II		
Begeben	1	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
	1	k. A.
Administrative EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	62	173
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(243)	(299)
	(181)	(126)

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
PIMCO Capital Securities Fund (Fortsetzung)		
Administrative SGD (Hedged): ausschüttend II		
Begeben	1	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
	1	k. A.
Class E: thesaurierend		
Begeben	4.440	11.374
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(7.660)	(9.488)
	(3.220)	1.886
Erträge		
Begeben	1.173	3.409
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	15	24
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(3.171)	(2.320)
	(1.983)	1.113
Class E CHF (Hedged): thesaurierend		
Begeben	100	223
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(247)	(79)
	(147)	144
Class E EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	4.671	10.196
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(6.757)	(8.929)
	(2.086)	1.267
Erträge		
Begeben	1.329	2.340
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	2	1
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.068)	(1.418)
	263	923
M Retail: ausschüttend II		
Begeben	6.498	15.117
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	43	21
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(10.686)	(6.859)
	(4.145)	8.279
M Retail HKD (Unhedged): Erträge		
Begeben	0	63
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.913)	0
	(1.913)	63
M Retail SGD (Hedged): ausschüttend II		
Begeben	2.290	8.570
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	23	13
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(4.641)	(1.135)
	(2.328)	7.448
Class R: Erträge		
Begeben	64	95
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(89)	(83)
	(25)	12

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021		Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
PIMCO Capital Securities Fund (Fortsetzung)			PIMCO Climate Bond Fund (Fortsetzung)		
Class R EUR (Hedged): Erträge			Institutional GBP (Hedged): thesaurierend		
Begeben	23	679	Begeben	1.673	3.175
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(811)	(416)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(752)	(545)
	(788)	263		921	2.630
Class R GBP (Hedged): Erträge			Erträge		
Begeben	29	49	Begeben	4.497	85
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	2	6	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	11	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(280)	(94)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.602)	(13)
	(249)	(39)		2.906	72
Class T: Erträge			Institutional SEK (Hedged): thesaurierend		
Begeben	199	284	Begeben	496	2.939
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	7	5	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(333)	(256)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(29)	0
	(127)	33		467	2.939
Class T EUR (Hedged): thesaurierend			Institutional SGD (Hedged): thesaurierend		
Begeben	641	2.313	Begeben	203	626
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.335)	(1.186)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(109)	(85)
	(694)	1.127		94	541
Class Z: Erträge			Investor: thesaurierend		
Begeben	95	4.184	Begeben	5	321
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	463	308	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(3.061)	(495)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(326)	0
	(2.503)	3.997		(321)	321
Class Z AUD (Hedged): Erträge			Investor EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	1.779	2.551	Begeben	0	1
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	578	458	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.578)	(2.967)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1)	0
	(221)	42		(1)	1
PIMCO Climate Bond Fund			Administrative SEK (Hedged): thesaurierend		
Institutional: thesaurierend			Begeben	0	1
Begeben	1.367	1.726	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(359)	(67)		0	1
	1.008	1.659	Class E EUR (Hedged): thesaurierend		
Institutional CHF (Hedged): thesaurierend			Begeben	629	1.976
Begeben	7	89	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(438)	(308)
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(6)	(1)		191	1.668
	1	88	Class Z: thesaurierend		
Institutional EUR (Hedged): thesaurierend			Begeben	0	0
Begeben	4.564	8.199	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(5.279)	(1.779)		0	0
	(715)	6.420	Commodity Real Return Fund		
Erträge			Institutional: thesaurierend		
Begeben	154	4.381	Begeben	40.486	63.143
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.564)	(12)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(66.747)	(20.339)
	(1.410)	4.369		(26.261)	42.804

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021		Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
	Commodity Real Return Fund (Fortsetzung)			PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	
Institutional EUR (Hedged): thesaurierend			Institutional: thesaurierend		
Begeben	27.911	21.162	Begeben	191	449
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(20.593)	(9.207)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(218)	(412)
	7.318	11.955		(27)	37
Institutional EUR (Unhedged): thesaurierend			Institutional CHF (Hedged): thesaurierend		
Begeben	3.509	4.815	Begeben	0	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.319)	(478)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(560)	(24)
	2.190	4.337		(560)	(24)
Institutional GBP (Hedged): thesaurierend			Institutional EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	2.237	1.894	Begeben	235	385
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.286)	(479)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.059)	(569)
	(49)	1.415		(1.824)	(184)
Institutional GBP (Unhedged): Erträge			Class E: thesaurierend		
Begeben	1.888	k. A.	Begeben	231	439
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(7)	k. A.	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(259)	(334)
	1.881	k. A.		(28)	105
Investor: thesaurierend			Class E EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	5.082	8.596	Begeben	65	434
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(7.606)	(1.901)	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(248)	(355)
	(2.524)	6.695		(183)	79
Class E: thesaurierend				Diversified Income Fund	
Begeben	25.761	32.792	Institutional: thesaurierend		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Begeben	3.884	20.143
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(28.579)	(8.651)	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
	(2.818)	24.141	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(13.073)	(13.814)
Class E EUR (Hedged): thesaurierend				(9.189)	6.329
Begeben	38.450	38.799	Erträge		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Begeben	1.885	12.723
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(40.323)	(7.876)	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	574	449
	(1.873)	30.923	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(18.694)	(20.355)
Class E SGD (Hedged): thesaurierend				(16.235)	(7.183)
Begeben	1.644	34	Institutional CAD (Hedged): thesaurierend		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0	Begeben	1.524	18.814
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.495)	0	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
	149	34	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(5.130)	(6.141)
H Institutional: thesaurierend				(3.606)	12.673
Begeben	428	k. A.	Institutional CHF (Hedged): thesaurierend		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.	Begeben	212	638
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1)	k. A.	Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
	427	k. A.	Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(284)	(589)
				(72)	49
			Erträge		
			Begeben	193	230
			Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
			Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(494)	(832)
				(301)	(602)

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
Institutional EUR (Hedged):		
thesaurierend		
Begeben	15.813	42.609
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(41.537)	(41.453)
	(25.724)	1.156
Erträge		
Begeben	25.908	22.120
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	342	312
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(69.909)	(26.928)
	(43.659)	(4.496)
Institutional GBP (Hedged):		
thesaurierend		
Begeben	1.458	22.532
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(37.733)	(46.646)
	(36.275)	(24.114)
Erträge		
Begeben	16.091	46.897
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	512	502
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(30.848)	(99.522)
	(14.245)	(52.123)
Institutional MXN (Hedged):		
thesaurierend		
Begeben	3.007	2.778
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.975)	0
	32	2.778
Institutional SEK (Hedged):		
thesaurierend		
Begeben	1	17
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	(285)
	1	(268)
Institutional SGD (Hedged):		
Erträge		
Begeben	1.322	7.284
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	2
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(3.829)	(2.359)
	(2.507)	4.927
Investor:		
thesaurierend		
Begeben	1.949	2.281
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(3.263)	(915)
	(1.314)	1.366
Erträge		
Begeben	9.350	4.515
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	16	19
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(5.393)	(1.998)
	3.973	2.536
Investor EUR (Hedged):		
thesaurierend		
Begeben	177	1.193
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(660)	(851)
	(483)	342

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
Erträge		
Begeben	317	472
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(202)	(117)
	115	355
Administrative:		
Erträge		
Begeben	1.604	5.187
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	25	25
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(4.583)	(4.950)
	(2.954)	262
Administrative AUD (Hedged):		
Erträge		
Begeben	14	153
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	1
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(43)	(197)
	(29)	(43)
Administrative EUR (Hedged):		
thesaurierend		
Begeben	46	110
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(315)	(242)
	(269)	(132)
Administrative GBP (Hedged):		
Erträge		
Begeben	50	494
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(246)	(374)
	(196)	120
Administrative JPY (Hedged):		
thesaurierend		
Begeben	391	47
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	0
	391	47
Administrative SEK (Hedged):		
thesaurierend		
Begeben	0	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	0
	0	0
Administrative SGD (Hedged):		
Erträge		
Begeben	640	6.067
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	23	18
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(3.780)	(9.019)
	(3.117)	(2.934)
BM Retail:		
ausschüttend II		
Begeben	1	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
	1	k. A.
BN Retail:		
ausschüttend II		
Begeben	1	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
	1	k. A.

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
	Diversified Income Fund (Fortsetzung)		Diversified Income Fund (Fortsetzung)	
Class E:				
thesaurierend				
Begeben	4.099	15.575		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(17.311)	(29.090)		
	(13.212)	(13.515)		
Erträge				
Begeben	5.389	14.608		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	93	87		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(17.485)	(25.632)		
	(12.003)	(10.937)		
Class E CHF (Hedged):				
thesaurierend				
Begeben	65	416		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(86)	(198)		
	(21)	218		
Class E EUR (Hedged):				
thesaurierend				
Begeben	15.932	40.481		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(33.142)	(33.558)		
	(17.210)	6.923		
Erträge				
Begeben	4.672	17.811		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	2	3		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(37.797)	(36.241)		
	(33.123)	(18.427)		
Class E SGD (Hedged):				
Erträge				
Begeben	22	2.333		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	1	0		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.940)	(5.636)		
	(1.917)	(3.303)		
H Institutional:				
thesaurierend				
Begeben	17.461	27.554		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(66.418)	(18.300)		
	(48.957)	9.254		
Erträge				
Begeben	13	0		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1)	0		
	12	0		
M Retail:				
Erträge				
Begeben	1.664	5.152		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	38	52		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(6.706)	(12.877)		
	(5.004)	(7.673)		
ausschüttend II				
Begeben	9.583	20.918		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	2	19		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(17.798)	(33.216)		
	(8.213)	(12.279)		
M Retail AUD (Hedged):				
Erträge				
Begeben	942	1.690		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	1	4		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.811)	(7.103)		
	(1.868)	(5.409)		
M Retail SGD (Hedged):				
ausschüttend II				
Begeben	0	1		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1)	0		
	(1)	1		
N Retail:				
ausschüttend II				
Begeben	0	0		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	0		
	0	0		
Class T:				
thesaurierend				
Begeben	175	1.980		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(943)	(1.276)		
	(768)	704		
Erträge				
Begeben	44	271		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	5	3		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(154)	(215)		
	(105)	59		
Class T EUR (Hedged):				
thesaurierend				
Begeben	337	1.306		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.070)	(1.442)		
	(733)	(136)		
Erträge				
Begeben	129	449		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(490)	(1.012)		
	(361)	(563)		
Class W:				
thesaurierend				
Begeben	1.342	8.978		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(5.541)	(1.852)		
	(4.199)	7.126		
Erträge				
Begeben	393	13.392		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(8.527)	(3.141)		
	(8.134)	10.251		
Class W CAD (Hedged):				
thesaurierend				
Begeben	0	0		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1)	0		
	(1)	0		

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
Diversified Income Fund (Fortsetzung)			Diversified Income Duration Hedged Fund (Fortsetzung)	
Class W CHF (Hedged): thesaurierend				
Begeben	456	544		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(478)	(434)		
	(22)	110		
Erträge				
Begeben	82	161		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(153)	0		
	(71)	161		
Class W EUR (Hedged): thesaurierend				
Begeben	607	706		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(675)	(246)		
	(68)	460		
Erträge				
Begeben	146	254		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(393)	(325)		
	(247)	(71)		
Class W GBP (Hedged): thesaurierend				
Begeben	82	301		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(68)	(112)		
	14	189		
Erträge				
Begeben	109	313		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(100)	(30)		
	9	283		
Class W SGD (Hedged): Erträge				
Begeben	165	500		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(257)	(353)		
	(92)	147		
Diversified Income Duration Hedged Fund				
Institutional: thesaurierend				
Begeben	129	4.012		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.800)	(1.797)		
	(2.671)	2.215		
Erträge				
Begeben	0	132		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(326)	(18)		
	(326)	114		
Institutional EUR (Hedged): thesaurierend				
Begeben	2.538	7.118		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(7.903)	(2.109)		
	(5.365)	5.009		
			Diversified Income ESG Fund	
ausschüttend II				
Begeben	22	1.046		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(3.662)	(1.079)		
	(3.640)	(33)		
Institutional GBP (Hedged): thesaurierend				
Begeben	272	2.889		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(8.534)	(12.541)		
	(8.262)	(9.652)		
Erträge				
Begeben	92	593		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(12.053)	(7.348)		
	(11.961)	(6.755)		
Investor: thesaurierend				
Begeben	4	1.278		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(454)	(1.280)		
	(450)	(2)		
Class E: thesaurierend				
Begeben	632	1.935		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.383)	(1.275)		
	(1.751)	660		
Erträge				
Begeben	436	1.927		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	4	2		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(669)	(906)		
	(229)	1.023		
Class E EUR (Hedged): thesaurierend				
Begeben	1.162	9.045		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(11.254)	(9.193)		
	(10.092)	(148)		
Erträge				
Begeben	99	324		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.054)	(1.536)		
	(955)	(1.212)		
Institutional: thesaurierend				
Begeben	947	k. A.		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.		
	947	k. A.		
Institutional EUR (Hedged): thesaurierend				
Begeben	23	k. A.		
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.		
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.		
	23	k. A.		

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
Diversified Income ESG Fund (Fortsetzung)		
Institutional GBP (Hedged): thesaurierend		
Begeben	19	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
	19	k. A.
Class E: thesaurierend		
Begeben	1	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
	1	k. A.
Class E EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	1	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
	1	k. A.
Dynamic Bond Fund		
Institutional: thesaurierend		
Begeben	3.696	16.167
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(11.498)	(9.947)
	(7.802)	6.220
Erträge		
Begeben	229	10.029
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	3	1
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.057)	(5.577)
	(825)	4.453
Institutional CAD (Hedged): thesaurierend		
Begeben	0	1
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(212)	(238)
	(212)	(237)
Institutional CHF (Hedged): thesaurierend		
Begeben	1.034	1.764
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.834)	(339)
	(800)	1.425
Institutional EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	11.147	22.189
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(21.791)	(30.976)
	(10.644)	(8.787)
Erträge		
Begeben	570	428
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(559)	(130)
	11	298
Institutional GBP (Hedged): thesaurierend		
Begeben	100.815	25.423
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(15.420)	(20.841)
	85.395	4.582

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
Dynamic Bond Fund (Fortsetzung)		
Erträge		
Begeben	1.066	4.284
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	56	66
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(16.302)	(2.771)
	(15.180)	1.579
Institutional NOK (Hedged): thesaurierend		
Begeben	6	18
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(9.634)	(481)
	(9.628)	(463)
Institutional SEK (Hedged): thesaurierend		
Begeben	1	126
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(238)	(4.650)
	(237)	(4.524)
Investor: thesaurierend		
Begeben	483	1.586
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(951)	(1.248)
	(468)	338
Erträge		
Begeben	11	378
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	6	4
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(94)	(285)
	(77)	97
Investor EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	0	573
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(312)	(359)
	(312)	214
Administrative: thesaurierend		
Begeben	61	297
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(530)	(411)
	(469)	(114)
Administrative EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	7	161
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(197)	(245)
	(190)	(84)
Administrative SEK (Hedged): thesaurierend		
Begeben	18	20
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(139)	(140)
	(121)	(120)
Class E: thesaurierend		
Begeben	1.408	3.663
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.734)	(2.075)
	(1.326)	1.588

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
Dynamic Bond Fund (Fortsetzung)		
Erträge		
Begeben	218	493
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	8	4
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(473)	(501)
	(247)	(4)
Class E CHF (Hedged): thesaurierend		
Begeben	99	72
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(177)	(158)
	(78)	(86)
Class E EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	412	9.438
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(5.226)	(6.436)
	(4.814)	3.002
Class E GBP (Hedged): thesaurierend		
Begeben	21	52
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(31)	(60)
	(10)	(8)
G Retail EUR (Hedged): Erträge		
Begeben	12	56
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(108)	(238)
	(96)	(182)
H Institutional: thesaurierend		
Begeben	730	2.355
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.272)	(1.118)
	(542)	1.237
Erträge		
Begeben	0	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	0
	0	0
Class R: thesaurierend		
Begeben	38	87
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(103)	(134)
	(65)	(47)
Class Z: thesaurierend		
Begeben	0	1.001
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(276)	0
	(276)	1.001
Class Z AUD (Hedged): Erträge		
Begeben	145	683
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	101	92
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(821)	(538)
	(575)	237

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
Dynamic Multi-Asset Fund		
Institutional: thesaurierend		
Begeben	16.762	105.022
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(78.040)	(59.899)
	(61.278)	45.123
ausschüttend II		
Begeben	971	4.840
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(4.764)	(5.591)
	(3.793)	(751)
Institutional CHF (Hedged): thesaurierend		
Begeben	4	183
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(145)	(118)
	(141)	65
Institutional GBP (Hedged): thesaurierend		
Begeben	13.616	29.871
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(9.604)	(5.172)
	4.012	24.699
Erträge		
Begeben	2.347	1.304
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(659)	(15)
	1.688	1.289
Institutional ILS (Hedged): thesaurierend		
Begeben	423	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
	423	k. A.
Institutional SGD (Hedged): thesaurierend		
Begeben	9.784	2.702
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	0
	9.784	2.702
Institutional USD (Hedged): thesaurierend		
Begeben	2.374	13.743
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(9.023)	(7.054)
	(6.649)	6.689
ausschüttend II		
Begeben	20	512
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1)	0
	19	512
Investor: thesaurierend		
Begeben	131	461
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(4)	(37)
	127	424

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
Dynamic Multi-Asset Fund (Fortsetzung)		
Investor USD (Hedged): thesaurierend		
Begeben	0	1
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	0
	0	1
BM Retail AUD (Hedged): ausschüttend II		
Begeben	1	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
	1	k. A.
BM Retail USD (Hedged): ausschüttend II		
Begeben	1	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
	1	k. A.
Class E: thesaurierend		
Begeben	17.931	148.575
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(71.978)	(73.501)
	(54.047)	75.074
Erträge		
Begeben	67	585
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(78)	(165)
	(11)	420
Class E USD (Hedged): thesaurierend		
Begeben	2.719	25.775
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(6.818)	(14.814)
	(4.099)	10.961
Erträge		
Begeben	3	1
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	0
	3	1
ausschüttend II		
Begeben	0	1
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	0
	0	1
H Institutional USD (Hedged): thesaurierend		
Begeben	1.976	4.628
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.546)	(10.316)
	(570)	(5.688)
M Retail AUD (Hedged): ausschüttend II		
Begeben	13	65
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	1	1
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(32)	(9)
	(18)	57

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
Dynamic Multi-Asset Fund (Fortsetzung)		
M Retail SGD (Hedged): ausschüttend II		
Begeben	93	3.755
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	6	4
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(234)	(2.120)
	(135)	1.639
M Retail USD (Hedged): ausschüttend II		
Begeben	1.806	13.972
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	5	6
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(5.705)	(10.358)
	(3.894)	3.620
Class T: thesaurierend		
Begeben	616	7.194
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.236)	(2.049)
	(1.620)	5.145
Class T USD (Hedged): thesaurierend		
Begeben	349	63
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(13)	0
	336	63
Class Z: thesaurierend		
Begeben	17	10.201
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.434)	(951)
	(1.417)	9.250
Emerging Local Bond Fund		
Institutional: thesaurierend		
Begeben	44.501	56.697
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(46.912)	(84.013)
	(2.411)	(27.316)
Erträge		
Begeben	152	1.474
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(456)	(2.209)
	(304)	(735)
Institutional CHF (Unhedged): thesaurierend		
Begeben	0	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(44)	(7)
	(44)	(7)
Institutional EUR (Unhedged): thesaurierend		
Begeben	7.070	13.694
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(12.977)	(7.064)
	(5.907)	6.630
Erträge		
Begeben	6.133	8.745
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(3.859)	(30.055)
	2.274	(21.310)

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
	Emerging Local Bond Fund (Fortsetzung)	
Institutional GBP (Unhedged): thesaurierend		
Begeben	141	13
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(78)	(30)
	63	(17)
Investor: thesaurierend		
Begeben	232	1.946
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.010)	(326)
	(1.778)	1.620
Investor EUR (Unhedged): thesaurierend		
Begeben	21	6
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(276)	(1)
	(255)	5
Class E: thesaurierend		
Begeben	2.431	601
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.501)	(1.352)
	(70)	(751)
Erträge		
Begeben	191	240
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	1	2
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(418)	(762)
	(226)	(520)
Class E EUR (Unhedged): thesaurierend		
Begeben	625	939
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.405)	(2.554)
	(780)	(1.615)
Erträge		
Begeben	7	3
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(28)	(16)
	(21)	(13)
H Institutional: thesaurierend		
Begeben	5.708	597
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(293)	(596)
	5.415	1
Class Z: Erträge		
Begeben	0	2.561
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	277	227
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	(178)
	277	2.610
	Emerging Local Bond ESG Fund	
Institutional: thesaurierend		
Begeben	489	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
	489	k. A.

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
	Emerging Local Bond ESG Fund (Fortsetzung)	
Erträge		
Begeben	1	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
	1	k. A.
Institutional EUR (Unhedged): thesaurierend		
Begeben	1	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
	1	k. A.
Erträge		
Begeben	1	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
	1	k. A.
Investor: thesaurierend		
Begeben	1	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
	1	k. A.
Erträge		
Begeben	1	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
	1	k. A.
Investor EUR (Unhedged): thesaurierend		
Begeben	1	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
	1	k. A.
Erträge		
Begeben	1	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
	1	k. A.
Class E: thesaurierend		
Begeben	1	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
	1	k. A.
Erträge		
Begeben	1	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
	1	k. A.
Class E EUR (Unhedged): thesaurierend		
Begeben	1	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
	1	k. A.
Erträge		
Begeben	1	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
	1	k. A.

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
Emerging Local Bond ESG Fund (Fortsetzung)		
Class Z: thesaurierend		
Begeben	123	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
	123	k. A.
Emerging Markets Bond Fund		
Institutional: thesaurierend		
Begeben	10.925	13.727
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(15.619)	(18.027)
	(4.694)	(4.300)
Erträge		
Begeben	688	3.350
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	85	75
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.874)	(2.448)
	(1.101)	977
Institutional CHF (Hedged): Erträge		
Begeben	232	213
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(57)	(18)
	175	195
Institutional EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	12.568	9.857
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(8.822)	(10.055)
	3.746	(198)
Erträge		
Begeben	31.500	55.939
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	90	87
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(68.483)	(40.673)
	(36.893)	15.353
Institutional EUR (Unhedged): thesaurierend		
Begeben	5.590	2.721
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(6.467)	(2.712)
	(877)	9
Institutional GBP (Hedged): thesaurierend		
Begeben	235	551
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(160)	(71)
	75	480
Erträge		
Begeben	2.143	4.560
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	133	98
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(3.367)	(9.388)
	(1.091)	(4.730)
Institutional PLN (Hedged): Erträge		
Begeben	0	9.925
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	1	2
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(9.928)	0
	(9.927)	9.927

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
Emerging Markets Bond Fund (Fortsetzung)		
Institutional SGD (Hedged): thesaurierend		
Begeben	1.303	2.117
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(828)	(754)
	475	1.363
Investor: thesaurierend		
Begeben	7	33
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(54)	(38)
	(47)	(5)
Investor EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	0	17
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(8)	(1)
	(8)	16
Administrative: thesaurierend		
Begeben	82	167
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(215)	(144)
	(133)	23
BM Retail: ausschüttend II		
Begeben	1	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
	1	k. A.
Class E: thesaurierend		
Begeben	847	1.400
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.406)	(1.701)
	(559)	(301)
Erträge		
Begeben	7.933	12.615
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	12	28
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(10.704)	(15.526)
	(2.759)	(2.883)
Class E EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	541	1.493
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.372)	(1.497)
	(831)	(4)
Class E SGD (Hedged): thesaurierend		
Begeben	79	64
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(70)	(75)
	9	(11)
H Institutional: thesaurierend		
Begeben	7.545	5.633
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(6.018)	(7.656)
	1.527	(2.023)

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
Emerging Markets Bond Fund (Fortsetzung)		
Erträge		
Begeben	0	28
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	0
	0	28
M Retail:		
Erträge		
Begeben	112	530
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	5	10
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(246)	(705)
	(129)	(165)
ausschüttend II		
Begeben	16.994	16.287
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	2
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(16.949)	(16.554)
	45	(265)
M Retail AUD (Hedged):		
Erträge		
Begeben	12	615
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	2
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(587)	(769)
	(575)	(152)
Class Z:		
Erträge		
Begeben	0	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	31	25
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	(2)
	31	23
Emerging Markets Bond ESG Fund		
Institutional:		
thesaurierend		
Begeben	19.358	18.751
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(11.060)	(8.390)
	8.298	10.361
Erträge		
Begeben	13.168	30.080
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	178	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(3.833)	(720)
	9.513	29.360
Institutional CHF (Hedged):		
thesaurierend		
Begeben	1.769	5.067
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(11)	0
	1.758	5.067
Institutional EUR (Hedged):		
thesaurierend		
Begeben	56.354	60.012
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(32.858)	(23.346)
	23.496	36.666
Erträge		
Begeben	30.800	26.606
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	114	3
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(32.730)	(16.503)
	(1.816)	10.106

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
Emerging Markets Bond ESG Fund (Fortsetzung)		
Institutional GBP (Hedged):		
Erträge		
Begeben	16.488	8.744
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	2	1
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.491)	(607)
	13.999	8.138
Institutional GBP (Unhedged):		
Erträge		
Begeben	239	410
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(138)	(13)
	101	397
Investor NOK (Hedged):		
thesaurierend		
Begeben	0	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	(8)
	0	(8)
Investor SEK (Hedged):		
thesaurierend		
Begeben	308	38
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(105)	(49)
	203	(11)
Administrative:		
thesaurierend		
Begeben	0	42
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(22)	(85)
	(22)	(43)
Erträge		
Begeben	0	74
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(6)	(1)
	(6)	73
Administrative SEK (Hedged):		
thesaurierend		
Begeben	4	1
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(4)	0
	0	1
Class E:		
thesaurierend		
Begeben	27	172
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(65)	(14)
	(38)	158
Erträge		
Begeben	32	104
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(30)	(12)
	2	92
Class E EUR (Hedged):		
thesaurierend		
Begeben	4.801	14.828
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(9.874)	(10.227)
	(5.073)	4.601

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
Emerging Markets Corporate Bond Fund		
Institutional: thesaurierend		
Begeben	792	1.234
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(789)	(1.830)
	3	(596)
Institutional EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	814	588
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(325)	(1.362)
	489	(774)
Class E: thesaurierend		
Begeben	192	329
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(518)	(268)
	(326)	61
Class E CHF (Hedged): thesaurierend		
Begeben	2	20
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(189)	(195)
	(187)	(175)
Class E EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	59	264
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(352)	(521)
	(293)	(257)
PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund		
Institutional: thesaurierend		
Begeben	2.229	3.974
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(4.163)	(805)
	(1.934)	3.169
Institutional EUR (Partially Hedged): thesaurierend		
Begeben	1.044	8.768
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(13.456)	(4.238)
	(12.412)	4.530
Institutional GBP (Partially Hedged): Erträge		
Begeben	79	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	2	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
	81	k. A.
Class E EUR (Partially Hedged): thesaurierend		
Begeben	1	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
	1	k. A.

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund		
Class Z: thesaurierend		
Begeben	13.622	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(3.520)	k. A.
	10.102	k. A.
Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund		
Institutional: thesaurierend		
Begeben	0	151
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(8)	(153)
	(8)	(2)
Institutional EUR (Unhedged): thesaurierend		
Begeben	451	1.460
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(757)	(1.255)
	(306)	205
Class E: thesaurierend		
Begeben	36	27
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(82)	(84)
	(46)	(57)
Class E EUR (Unhedged): thesaurierend		
Begeben	63	42
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(215)	(316)
	(152)	(274)
PIMCO ESG Income Fund		
Institutional: thesaurierend		
Begeben	2.231	547
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(286)	(6)
	1.945	541
Erträge		
Begeben	8	372
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	10	3
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	0
	18	375
Institutional AUD (Hedged): Erträge		
Begeben	6.278	1
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	59	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	0
	6.337	1
Institutional CHF (Hedged): thesaurierend		
Begeben	735	70
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1)	(1)
	734	69

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
	PIMCO ESG Income Fund (Fortsetzung)	
Institutional EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	7.700	7.363
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(3.366)	(188)
	4.334	7.175
Erträge		
Begeben	237	22
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(42)	0
	195	22
Institutional GBP (Hedged): Erträge		
Begeben	3	64
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(7)	(16)
	(4)	48
Institutional SEK (Hedged): thesaurierend		
Begeben	563	772
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	0
	563	772
Institutional SGD (Hedged): Erträge		
Begeben	3	36
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	1	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	0
	4	36
Administrative SEK (Hedged): thesaurierend		
Begeben	826	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(10)	k. A.
	816	k. A.
Class E: thesaurierend		
Begeben	176	29
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(49)	(1)
	127	28
Erträge		
Begeben	44	2
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(3)	0
	41	2
Class E CHF (Hedged): Erträge		
Begeben	0	1
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	0
	0	1
Class E EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	522	112
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(99)	0
	423	112

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
	PIMCO ESG Income Fund (Fortsetzung)	
Erträge		
Begeben	94	26
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(5)	0
	89	26
Class R AUD (Hedged): Erträge		
Begeben	556	3.171
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	1	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	(198)
	557	2.973
	Euro Bond Fund	
Institutional: thesaurierend		
Begeben	11.908	18.290
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(21.387)	(27.142)
	(9.479)	(8.852)
Erträge		
Begeben	651	617
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.169)	(16.561)
	(518)	(15.944)
Institutional CHF (Hedged): thesaurierend		
Begeben	901	1.598
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(59)	(52)
	842	1.546
Investor: thesaurierend		
Begeben	85	132
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(200)	(700)
	(115)	(568)
Erträge		
Begeben	0	2
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(15)	(27)
	(15)	(25)
Administrative: thesaurierend		
Begeben	0	8
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(110)	(113)
	(110)	(105)
Class E: thesaurierend		
Begeben	486	1.000
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.701)	(4.534)
	(1.215)	(3.534)
Erträge		
Begeben	120	393
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(929)	(1.843)
	(809)	(1.450)

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
Euro Credit Fund		
Institutional: thesaurierend		
Begeben	14.117	19.199
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(33.114)	(25.134)
	(18.997)	(5.935)
ausschüttend II		
Begeben	9.070	9.324
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	34	42
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(14.528)	(11.894)
	(5.424)	(2.528)
Class E:		
thesaurierend		
Begeben	47	206
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(399)	(655)
	(352)	(449)
H Institutional:		
thesaurierend		
Begeben	12.991	2.699
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.658)	(912)
	10.333	1.787
ausschüttend II		
Begeben	1	5
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(167)	(150)
	(166)	(145)
Euro Income Bond Fund		
Institutional: thesaurierend		
Begeben	8.116	31.776
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(40.863)	(31.035)
	(32.747)	741
Erträge		
Begeben	25.489	7.884
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	118	120
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(28.907)	(15.642)
	(3.300)	(7.638)
Investor:		
thesaurierend		
Begeben	31	1.027
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(283)	(254)
	(252)	773
Erträge		
Begeben	0	6
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	2	1
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(90)	(806)
	(88)	(799)
Class E:		
thesaurierend		
Begeben	2.777	6.760
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(19.331)	(34.517)
	(16.554)	(27.757)

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
Euro Income Bond Fund (Fortsetzung)		
Erträge		
Begeben	1.837	4.464
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	1
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(13.945)	(23.249)
	(12.108)	(18.784)
Ausschüttend Q		
Begeben	19	88
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(425)	(137)
	(406)	(49)
Class T:		
thesaurierend		
Begeben	268	539
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(638)	(1.259)
	(370)	(720)
Erträge		
Begeben	122	185
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(370)	(701)
	(248)	(516)
Euro Long Average Duration Fund		
Institutional: thesaurierend		
Begeben	1.625	1.886
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.265)	(2.116)
	360	(230)
Euro Short-Term Fund		
Institutional: thesaurierend		
Begeben	20.374	17.859
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(43.243)	(32.093)
	(22.869)	(14.234)
Class E:		
thesaurierend		
Begeben	920	411
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(809)	(851)
	111	(440)
PIMCO European High Yield Bond Fund		
Institutional: thesaurierend		
Begeben	3.858	753
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.638)	(512)
	2.220	241
Class E:		
thesaurierend		
Begeben	1	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
	1	k. A.

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
PIMCO European High Yield Bond Fund (Fortsetzung)		
Class Z: thesaurierend		
Begeben	0	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(200)	0
	(200)	0

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
PIMCO European Short-Term Opportunities Fund		
Institutional: thesaurierend		
Begeben	5.027	8.555
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(15.856)	(8.576)
	(10.829)	(21)

Class E: thesaurierend		
Begeben	520	77
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(141)	(253)
	379	(176)

H Institutional: thesaurierend		
Begeben	903	10.698
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(6.802)	(5.348)
	(5.899)	5.350

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
Global Advantage Fund		
Institutional: thesaurierend		
Begeben	36	11
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.084)	(451)
	(1.048)	(440)

Institutional CHF (Partially Hedged): Erträge		
Begeben	0	14
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(336)	0
	(336)	14

Institutional EUR (Partially Hedged): thesaurierend		
Begeben	1.723	3.814
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.551)	(2.407)
	(828)	1.407

Institutional GBP (Partially Hedged): thesaurierend		
Begeben	0	2
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(14)	0
	(14)	2

Institutional NOK (Partially Hedged): thesaurierend		
Begeben	6	631
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	0
	6	631

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
Global Advantage Fund (Fortsetzung)		
Class E EUR (Partially Hedged): thesaurierend		
Begeben	47	35
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(100)	(170)
	(53)	(135)

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
Global Bond Fund		
Institutional: thesaurierend		
Begeben	20.005	25.969
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(24.316)	(45.924)
	(4.311)	(19.955)

Erträge		
Begeben	1.853	3.978
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	52	33
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.143)	(5.560)
	(238)	(1.549)

Institutional (Currency Exposure): thesaurierend		
Begeben	3.622	3.757
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.873)	(5.657)
	1.749	(1.900)

Erträge		
Begeben	29	844
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(127)	(1.514)
	(98)	(670)

Institutional CAD (Hedged): thesaurierend		
Begeben	0	13
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(914)	(917)
	(914)	(904)

Institutional CHF (Hedged): thesaurierend		
Begeben	1.018	3.865
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.240)	(991)
	(1.222)	2.874

Erträge		
Begeben	190	1.482
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	1	1
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(741)	(791)
	(550)	692

Institutional EUR (Currency Exposure): thesaurierend		
Begeben	10.455	5.748
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(5.337)	(7.680)
	5.118	(1.932)

Institutional EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	19.257	32.376
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(25.423)	(31.725)
	(6.166)	651

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
	Global Bond Fund (Fortsetzung)	
Erträge		
Begeben	1.488	1.764
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	20	11
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.934)	(7.606)
	(1.426)	(5.831)
Institutional GBP (Currency Exposure): thesaurierend		
Begeben	16	51
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(22)	(109)
	(6)	(58)
Institutional GBP (Hedged): thesaurierend		
Begeben	2.464	5.102
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(3.014)	(3.376)
	(550)	1.726
Erträge		
Begeben	2.663	5.061
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	44	20
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(5.377)	(8.951)
	(2.670)	(3.870)
Institutional ILS (Hedged): thesaurierend		
Begeben	0	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(18)	(1)
	(18)	(1)
Institutional NOK (Hedged): thesaurierend		
Begeben	1.514	3.659
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(4.987)	(917)
	(3.473)	2.742
Institutional NZD (Hedged): Erträge		
Begeben	179	2.427
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	42	35
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.702)	(1.049)
	(2.481)	1.413
Institutional SEK (Hedged): thesaurierend		
Begeben	1.489	1.633
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.203)	(1.336)
	286	297
Institutional SGD (Hedged): thesaurierend		
Begeben	4.901	3.846
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.266)	(3.776)
	3.635	70
Investor: thesaurierend		
Begeben	654	327
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.502)	(2.036)
	(848)	(1.709)

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
	Global Bond Fund (Fortsetzung)	
Erträge		
Begeben	1.669	50
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	1	1
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(184)	(159)
	1.486	(108)
Investor (Currency Exposure): thesaurierend		
Begeben	0	2
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(71)	(89)
	(71)	(87)
Investor CHF (Hedged): thesaurierend		
Begeben	195	465
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.649)	(6.915)
	(1.454)	(6.450)
Investor EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	410	857
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(603)	(433)
	(193)	424
Investor GBP (Hedged): thesaurierend		
Begeben	25	62
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(9)	(67)
	16	(5)
Investor NOK (Hedged): thesaurierend		
Begeben	22	28
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(30)	(40)
	(8)	(12)
Administrative: thesaurierend		
Begeben	255	92
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(413)	(307)
	(158)	(215)
Administrative SEK (Hedged): thesaurierend		
Begeben	1.474	20
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(169)	0
	1.305	20
Class E: thesaurierend		
Begeben	2.644	4.275
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(5.612)	(6.673)
	(2.968)	(2.398)
Erträge		
Begeben	7.456	1.464
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	6	6
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(7.519)	(6.870)
	(57)	(5.400)

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
	Global Bond Fund (Fortsetzung)	
Class E (Currency Exposure): thesaurierend		
Begeben	386	838
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.781)	(2.148)
	(1.395)	(1.310)
Erträge		
Begeben	256	275
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(306)	(446)
	(50)	(171)
Class E CHF (Hedged): thesaurierend		
Begeben	26	25
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(37)	(43)
	(11)	(18)
Class E EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	5.158	9.663
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(11.634)	(16.500)
	(6.476)	(6.837)
Erträge		
Begeben	741	643
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.225)	(2.315)
	(484)	(1.672)
Class E NOK (Hedged): thesaurierend		
Begeben	0	1
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1)	0
	(1)	1
G Retail EUR (Hedged): Erträge		
Begeben	191	1.220
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(4.603)	(2.432)
	(4.412)	(1.212)
H Institutional: thesaurierend		
Begeben	34.334	12.078
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(33.907)	(15.084)
	427	(3.006)
Erträge		
Begeben	0	8
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(30)	(122)
	(30)	(114)
H Institutional (Currency Exposure): thesaurierend		
Begeben	71.651	78
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(33.844)	0
	37.807	78

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
	Global Bond Fund (Fortsetzung)	
M Retail: ausschüttend II		
Begeben	33	21
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(48)	(113)
	(15)	(92)
M Retail HKD (Unhedged): ausschüttend II		
Begeben	0	45
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(227)	(324)
	(227)	(279)
M Retail SEK (Hedged): thesaurierend		
Begeben	0	1
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1)	0
	(1)	1
Class R EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	161	200
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(159)	(87)
	2	113
Class R SEK (Hedged): thesaurierend		
Begeben	k. A.	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(1)
	k. A.	(1)
Class T: thesaurierend		
Begeben	187	333
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(863)	(1.566)
	(676)	(1.233)
Erträge		
Begeben	14	34
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	1	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(74)	(115)
	(59)	(81)
Class T EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	283	438
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(480)	(959)
	(197)	(521)
Class W: thesaurierend		
Begeben	1.762	3.255
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.003)	(2.363)
	(241)	892
Erträge		
Begeben	645	295
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(458)	(721)
	187	(426)

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
	Global Bond Fund (Fortsetzung)	
Class W (Currency Exposure): thesaurierend		
Begeben	0	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1)	0
	(1)	0
Erträge		
Begeben	0	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1)	0
	(1)	0
Class W CHF (Hedged): thesaurierend		
Begeben	502	827
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(970)	(983)
	(468)	(156)
Erträge		
Begeben	36	75
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(26)	0
	10	75
Class W EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	805	380
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.199)	(324)
	(394)	56
Erträge		
Begeben	159	162
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(107)	(103)
	52	59
Class W GBP (Hedged): thesaurierend		
Begeben	206	193
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(64)	(81)
	142	112
Erträge		
Begeben	249	90
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(478)	(32)
	(229)	58
Class W NOK (Hedged): thesaurierend		
Begeben	8	43
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	(5)
	8	38
Class W SEK (Hedged): thesaurierend		
Begeben	0	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1)	0
	(1)	0

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
	Global Bond ESG Fund	
Institutional: thesaurierend		
Begeben	19.756	17.719
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(10.249)	(5.282)
	9.507	12.437
Erträge		
Begeben	6.056	960
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	1	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.272)	(358)
	4.785	602
Institutional CHF (Hedged): thesaurierend		
Begeben	51.831	1.018
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(4.396)	(437)
	47.435	581
Institutional EUR (Currency Exposure): thesaurierend		
Begeben	1.418	86
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.060)	0
	358	86
Institutional EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	71.834	43.699
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(27.284)	(11.160)
	44.550	32.539
Erträge		
Begeben	3.526	5.828
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(3.843)	(10.631)
	(317)	(4.803)
Institutional GBP (Currency Exposure): Erträge		
Begeben	1	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
	1	k. A.
Institutional GBP (Hedged): thesaurierend		
Begeben	670	622
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.038)	(252)
	(1.368)	370
Erträge		
Begeben	4.565	5.597
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	3	1
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.443)	(2.518)
	2.125	3.080
Institutional GBP (Unhedged): Erträge		
Begeben	422	2.618
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(630)	(171)
	(208)	2.447

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
Institutional NOK (Hedged):		
thesaurierend		
Begeben	106.405	115.579
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(25.926)	(25.774)
	80.479	89.805
Institutional NZD (Hedged):		
Erträge		
Begeben	152	594
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	79	60
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(208)	0
	23	654
Institutional SEK (Hedged):		
thesaurierend		
Begeben	1.625	5.678
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.496)	0
	129	5.678
Investor:		
thesaurierend		
Begeben	569	429
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(813)	(974)
	(244)	(545)
Administrative:		
thesaurierend		
Begeben	5	222
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(213)	(15)
	(208)	207
Erträge		
Begeben	0	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1)	0
	(1)	0
Class E:		
Erträge		
Begeben	251	64
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(39)	(433)
	212	(369)
Class E CHF (Hedged):		
thesaurierend		
Begeben	8	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
	8	k. A.
Class E EUR (Hedged):		
thesaurierend		
Begeben	744	2.585
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.144)	(2.037)
	(400)	548
Class Z AUD (Hedged):		
Erträge		
Begeben	18.505	14.150
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	557	254
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(4.344)	(343)
	14.718	14.061

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
Institutional:		
thesaurierend		
Begeben	2.995	4.814
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(5.454)	(3.185)
	(2.459)	1.629
Erträge		
Begeben	31	727
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	36	37
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(978)	(299)
	(911)	465
Institutional EUR (Hedged):		
thesaurierend		
Begeben	1.935	4.021
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(434)	(4.604)
	1.501	(583)
Institutional GBP (Hedged):		
Erträge		
Begeben	k. A.	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(20)
	k. A.	(20)
Investor:		
thesaurierend		
Begeben	11	127
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(427)	(276)
	(416)	(149)
Administrative:		
thesaurierend		
Begeben	14	161
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(35)	(73)
	(21)	88
Class E:		
Erträge		
Begeben	6.630	3.203
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	8	11
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(8.332)	(2.671)
	(1.694)	543
Class E (Currency Exposure):		
Erträge		
Begeben	1.441	3.879
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.725)	(950)
	(284)	2.929
H Institutional:		
thesaurierend		
Begeben	8.239	1.164
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(7.676)	(7.488)
	563	(6.324)
Class Z:		
thesaurierend		
Begeben	0	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.092)	0
	(2.092)	0

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
PIMCO Global Core Asset Allocation Fund		
Institutional: thesaurierend		
Begeben	49	201
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(94)	(746)
	(45)	(545)
Institutional EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	3.042	12.653
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(7.884)	(2.648)
	(4.842)	10.005
Institutional GBP (Hedged): Erträge		
Begeben	10	7
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(24)	(11)
	(14)	(4)
Investor: thesaurierend		
Begeben	135	2
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2)	(4)
	133	(2)
Class E: thesaurierend		
Begeben	254	581
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(278)	(421)
	(24)	160
Erträge		
Begeben	520	631
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	1	1
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(245)	(209)
	276	423
Class E EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	5.168	2.786
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(3.215)	(2.570)
	1.953	216
Erträge		
Begeben	1.520	2.176
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.000)	(967)
	520	1.209
H Institutional: thesaurierend		
Begeben	1	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
	1	k. A.
Erträge		
Begeben	1	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
	1	k. A.

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
PIMCO Global Core Asset Allocation Fund (Fortsetzung)		
Class Z: thesaurierend		
Begeben	0	2.314
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(711)	(279)
	(711)	2.035
Global High Yield Bond Fund		
Institutional: thesaurierend		
Begeben	6.545	15.507
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(13.417)	(24.441)
	(6.872)	(8.934)
Erträge		
Begeben	966	16.960
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	51	90
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(14.027)	(4.620)
	(13.010)	12.430
Institutional CHF (Hedged): thesaurierend		
Begeben	31	60
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(681)	(236)
	(650)	(176)
Erträge		
Begeben	133	305
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.560)	(461)
	(1.427)	(156)
Institutional EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	7.994	30.775
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(24.025)	(28.676)
	(16.031)	2.099
Erträge		
Begeben	9.520	6.449
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	159	59
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(4.069)	(5.518)
	5.610	990
Institutional GBP (Hedged): thesaurierend		
Begeben	1.473	11.704
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(13.780)	(3.274)
	(12.307)	8.430
Erträge		
Begeben	22.851	35.263
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	46	88
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(59.227)	(49.041)
	(36.330)	(13.690)
Investor: thesaurierend		
Begeben	0	338
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(753)	(376)
	(753)	(38)

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
Global High Yield Bond Fund (Fortsetzung)		
Investor EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	899	128
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(550)	(33)
	349	95
Administrative: thesaurierend		
Begeben	105	309
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(710)	(230)
	(605)	79
Erträge		
Begeben	49	1.052
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(780)	(740)
	(731)	312
Administrative EUR (Hedged): Erträge		
Begeben	0	31
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	1	1
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(197)	(59)
	(196)	(27)
Administrative GBP (Hedged): Erträge		
Begeben	1	14
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(107)	(48)
	(106)	(34)
BM Retail: ausschüttend II		
Begeben	1	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
	1	k. A.
Class E: thesaurierend		
Begeben	1.171	2.149
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.802)	(3.300)
	(1.631)	(1.151)
Erträge		
Begeben	14.617	19.557
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	22	38
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(16.703)	(26.055)
	(2.064)	(6.460)
Class E EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	3.171	5.245
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(4.821)	(4.985)
	(1.650)	260
Erträge		
Begeben	290	628
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(810)	(1.096)
	(520)	(468)

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
Global High Yield Bond Fund (Fortsetzung)		
Class E GBP (Hedged): Erträge		
Begeben	6	198
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(29)	(186)
	(23)	12
Class E SGD (Hedged): Erträge		
Begeben	193	563
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	9	19
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(607)	(326)
	(405)	256
H Institutional: thesaurierend		
Begeben	11.210	577
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(5.391)	(6.559)
	5.819	(5.982)
Erträge		
Begeben	165	795
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(767)	(699)
	(602)	96
M Retail: Erträge		
Begeben	326	465
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	2	12
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(769)	(907)
	(441)	(430)
ausschüttend II		
Begeben	23.666	43.897
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	2
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(30.871)	(37.400)
	(7.205)	6.499
Class R: thesaurierend		
Begeben	834	1.898
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(5.248)	(2.079)
	(4.414)	(181)
Class T: thesaurierend		
Begeben	15	108
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(121)	(153)
	(106)	(45)
Erträge		
Begeben	15	85
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(42)	(115)
	(27)	(30)
Class T EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	0	29
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(130)	(31)
	(130)	(2)

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
	Global Investment Grade Credit Fund	
Institutional: thesaurierend		
Begeben	44.338	68.033
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(76.437)	(139.841)
	(32.099)	(71.808)
Erträge		
Begeben	7.013	26.790
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	125	153
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(16.764)	(59.200)
	(9.626)	(32.257)
Institutional (Currency Exposure): thesaurierend		
Begeben	3.744	969
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.549)	(3.630)
	2.195	(2.661)
Erträge		
Begeben	221	976
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(735)	(1.988)
	(514)	(1.012)
Institutional AUD (Hedged): Erträge		
Begeben	95	2.747
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(7.762)	(11.732)
	(7.667)	(8.985)
Institutional CAD (Hedged): Erträge		
Begeben	35	1
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	1	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(37)	0
	(1)	1
Institutional CHF (Hedged): thesaurierend		
Begeben	6.544	5.532
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(7.451)	(16.291)
	(907)	(10.759)
Erträge		
Begeben	521	724
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	1	2
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.364)	(2.072)
	(842)	(1.346)
Institutional CZK (Hedged): Erträge		
Begeben	0	1.275
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	1.556	4.623
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(176.854)	(21.104)
	(175.298)	(15.206)
Institutional EUR (Currency Exposure): thesaurierend		
Begeben	1.445	2.368
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(741)	(1.014)
	704	1.354

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
	Global Investment Grade Credit Fund (Fortsetzung)	
Institutional EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	28.528	59.639
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(58.533)	(137.154)
	(30.005)	(77.515)
Erträge		
Begeben	7.044	22.042
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	13	200
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(27.790)	(13.754)
	(20.733)	8.488
Institutional GBP (Hedged): thesaurierend		
Begeben	1.218	2.579
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(6.780)	(10.548)
	(5.562)	(7.969)
Erträge		
Begeben	12.235	42.221
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	31	24
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(66.400)	(193.097)
	(54.134)	(150.852)
Institutional HUF (Hedged): Erträge		
Begeben	509	1.973
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	3.701	28.468
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.029.911)	(38)
	(1.025.701)	30.403
Institutional ILS (Hedged): thesaurierend		
Begeben	0	169
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(531)	(13.032)
	(531)	(12.863)
Institutional NOK (Hedged): thesaurierend		
Begeben	146	167
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(898)	(277)
	(752)	(110)
Institutional PLN (Hedged): Erträge		
Begeben	0	9.639
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(11.435)	(461)
	(11.435)	9.178
Institutional SEK (Hedged): thesaurierend		
Begeben	1.808	7.545
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(37.339)	(24.846)
	(35.531)	(17.301)
Institutional SGD (Hedged): Erträge		
Begeben	938	284
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(396)	(4.362)
	542	(4.078)

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
Global Investment Grade Credit Fund (Fortsetzung)		
Investor: thesaurierend		
Begeben	24.529	46.612
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(43.856)	(75.537)
	(19.327)	(28.925)
Erträge		
Begeben	7.701	883
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	18	19
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.854)	(13.044)
	4.865	(12.142)
Investor AUD (Hedged): Erträge		
Begeben	824	206
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(133)	(443)
	691	(237)
Investor CAD (Hedged): Erträge		
Begeben	0	325
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	1
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(175)	(451)
	(175)	(125)
Investor CHF (Hedged): thesaurierend		
Begeben	11	47
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(94)	(81)
	(83)	(34)
Erträge		
Begeben	16	37
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(145)	(164)
	(129)	(127)
Investor EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	672	527
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.603)	(1.593)
	(931)	(1.066)
Erträge		
Begeben	18	234
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	2	2
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(218)	(193)
	(198)	43
Investor GBP (Hedged): Erträge		
Begeben	17	61
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(61)	(240)
	(44)	(179)
Investor RMB (Hedged): Erträge		
Begeben	0	10
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(30)	(47)
	(30)	(37)

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
Global Investment Grade Credit Fund (Fortsetzung)		
Investor SGD (Hedged): Erträge		
Begeben	288	282
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(151)	(1.456)
	137	(1.174)
Administrative: thesaurierend		
Begeben	272	808
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(6.285)	(1.832)
	(6.013)	(1.024)
Erträge		
Begeben	651	502
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	9	4
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(3.753)	(13.807)
	(3.093)	(13.301)
Administrative CHF (Hedged): thesaurierend		
Begeben	0	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(13)	(78)
	(13)	(78)
Administrative EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	215	18
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(235)	(660)
	(20)	(642)
Erträge		
Begeben	220	1
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(180)	(314)
	40	(313)
Administrative GBP (Hedged): Erträge		
Begeben	71	33
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	1	1
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(176)	(199)
	(104)	(165)
Administrative HKD (Unhedged): Erträge		
Begeben	4.427	2.219
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(4.427)	(4.812)
	0	(2.593)
Administrative SEK (Hedged): thesaurierend		
Begeben	72.625	29.416
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(59.977)	(49.738)
	12.648	(20.322)
Administrative SGD (Hedged): Erträge		
Begeben	9	199
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	2
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(197)	(4.256)
	(188)	(4.055)

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
Global Investment Grade Credit Fund (Fortsetzung)		
Class E: thesaurierend		
Begeben	9.251	8.525
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(13.142)	(33.255)
	(3.891)	(24.730)
Erträge		
Begeben	5.108	9.923
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	73	90
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(10.629)	(27.562)
	(5.448)	(17.549)
Class E CHF (Hedged): thesaurierend		
Begeben	265	1.147
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.399)	(1.678)
	(1.134)	(531)
Class E EUR (Currency Exposure) Erträge		
Begeben	0	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(140)	(153)
	(140)	(153)
Class E EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	12.147	14.083
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(16.618)	(20.477)
	(4.471)	(6.394)
Erträge		
Begeben	946	1.198
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	1	1
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(3.458)	(7.639)
	(2.511)	(6.440)
Class E GBP (Hedged): Erträge		
Begeben	134	321
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	3	3
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(535)	(1.135)
	(398)	(811)
Class E SGD (Hedged): Erträge		
Begeben	862	377
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	4	5
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(875)	(4.484)
	(9)	(4.102)
H Institutional: thesaurierend		
Begeben	21.140	3.728
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(13.895)	(11.759)
	7.245	(8.031)
Erträge		
Begeben	1.741	481
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	33	21
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.125)	(264)
	649	238

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
Global Investment Grade Credit Fund (Fortsetzung)		
H Institutional (Currency Exposure): thesaurierend		
Begeben	22.933	1.279
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(84)	(1.278)
	22.849	1
M Retail: Erträge		
Begeben	326	609
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	2	3
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.065)	(6.740)
	(1.737)	(6.128)
ausschüttend II		
Begeben	5.726	12.952
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	1	4
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(7.045)	(18.906)
	(1.318)	(5.950)
M Retail HKD (Unhedged): Erträge		
Begeben	103	1.063
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	(5.440)
	103	(4.377)
Class R: thesaurierend		
Begeben	143	492
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(790)	(1.143)
	(647)	(651)
Erträge		
Begeben	30	293
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(122)	(389)
	(92)	(96)
Class R EUR (Hedged): Erträge		
Begeben	3	31
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(275)	(363)
	(272)	(332)
Class R GBP (Hedged): Erträge		
Begeben	285	277
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(428)	(1.621)
	(143)	(1.344)
Class T: thesaurierend		
Begeben	333	712
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(985)	(2.144)
	(652)	(1.432)
Class T EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	58	53
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(111)	(276)
	(53)	(223)

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
	Global Investment Grade Credit Fund (Fortsetzung)	
Class W: thesaurierend		
Begeben	802	4.889
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(3.534)	(5.189)
	(2.732)	(300)
Erträge		
Begeben	600	2.963
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.279)	(3.843)
	(679)	(880)
Class W CHF (Hedged): thesaurierend		
Begeben	55	482
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(893)	(796)
	(838)	(314)
Class W EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	3.284	29.818
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(16.428)	(16.260)
	(13.144)	13.558
Erträge		
Begeben	32	118
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(116)	(153)
	(84)	(35)
Class W GBP (Hedged): thesaurierend		
Begeben	378	56
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(44)	(6)
	334	50
Erträge		
Begeben	94	1.111
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(881)	(964)
	(787)	147
Class W SGD (Hedged): Erträge		
Begeben	561	141
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(81)	(59)
	480	82
	Global Investment Grade Credit ESG Fund	
Institutional: thesaurierend		
Begeben	3.548	1.206
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(835)	(1.421)
	2.713	(215)
Erträge		
Begeben	582	1.084
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.240)	(1.965)
	(658)	(881)

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
	Global Investment Grade Credit ESG Fund (Fortsetzung)	
Institutional CHF (Hedged): thesaurierend		
Begeben	5.476	15.362
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.599)	(3.688)
	3.877	11.674
Erträge		
Begeben	3	296
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(54)	(11)
	(51)	285
Institutional EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	15.414	23.011
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(12.338)	(7.272)
	3.076	15.739
Erträge		
Begeben	46.158	7.007
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	40	49
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(10.802)	(4.993)
	35.396	2.063
Institutional GBP (Hedged): thesaurierend		
Begeben	2.854	5.957
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.656)	(136)
	198	5.821
Erträge		
Begeben	452	13.892
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(5.089)	(215)
	(4.637)	13.677
Institutional SEK (Hedged): thesaurierend		
Begeben	106	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
	106	k. A.
Investor: thesaurierend		
Begeben	11	14
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	0
	11	14
Administrative SEK (Hedged): thesaurierend		
Begeben	30.800	22.329
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(17.723)	(3.650)
	13.077	18.679
Class E: thesaurierend		
Begeben	44	147
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(216)	(786)
	(172)	(639)

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
Global Investment Grade Credit ESG Fund (Fortsetzung)		
Erträge		
Begeben	0	52
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(29)	(309)
	(29)	(257)
Class E CHF (Hedged): thesaurierend		
Begeben	47	23
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(6)	(193)
	41	(170)
Erträge		
Begeben	0	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	0
	0	0
Class E EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	60	535
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(363)	(468)
	(303)	67
Erträge		
Begeben	13	45
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(29)	(12)
	(16)	33
Class E GBP (Hedged): thesaurierend		
Begeben	0	5
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	(6)
	0	(1)
Erträge		
Begeben	0	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(10)	(1)
	(10)	(1)
Class Z: thesaurierend		
Begeben	0	1.406
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	0
	0	1.406
Global Low Duration Real Return Fund		
Institutional: thesaurierend		
Begeben	17.233	10.517
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(18.259)	(8.567)
	(1.026)	1.950
Institutional CHF (Hedged): thesaurierend		
Begeben	282	2.645
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.169)	(552)
	(887)	2.093

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
Global Low Duration Real Return Fund (Fortsetzung)		
Institutional EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	37.827	24.857
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(38.154)	(11.137)
	(327)	13.720
Erträge		
Begeben	67	1.155
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(841)	(527)
	(774)	628
Institutional GBP (Hedged): thesaurierend		
Begeben	3.306	3.977
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(3.949)	(1.231)
	(643)	2.746
Erträge		
Begeben	3.506	3.496
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.465)	(861)
	1.041	2.635
Institutional SGD (Hedged): thesaurierend		
Begeben	34.943	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
	34.943	k. A.
Investor: thesaurierend		
Begeben	344	122
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(196)	(18)
	148	104
Class E: thesaurierend		
Begeben	2.786	1.483
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.966)	(569)
	820	914
Class E EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	10.191	12.372
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(7.015)	(1.750)
	3.176	10.622
Global Real Return Fund		
Institutional: thesaurierend		
Begeben	4.831	11.978
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(6.987)	(6.198)
	(2.156)	5.780
Erträge		
Begeben	129	257
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	5	1
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(474)	(471)
	(340)	(213)

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
Institutional (Currency Exposure): thesaurierend		
Begeben	0	673
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(715)	(2.134)
	(715)	(1.461)
Institutional CHF (Hedged): thesaurierend		
Begeben	761	933
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(401)	(392)
	360	541
Erträge		
Begeben	634	382
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(174)	(172)
	460	210
Institutional EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	19.760	28.176
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(22.869)	(17.050)
	(3.109)	11.126
Erträge		
Begeben	400	1.324
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	187	90
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.252)	(2.194)
	(665)	(780)
Institutional GBP (Hedged): thesaurierend		
Begeben	1.338	2.279
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.217)	(1.586)
	121	693
Erträge		
Begeben	5.537	25.986
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	49	36
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(6.352)	(7.853)
	(766)	18.169
Institutional SGD (Hedged): thesaurierend		
Begeben	152	8.765
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.418)	(1.247)
	(1.266)	7.518
Investor: thesaurierend		
Begeben	900	1.561
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.580)	(773)
	(680)	788
Erträge		
Begeben	2	910
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	43	30
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.171)	(414)
	(1.126)	526

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
Investor CHF (Hedged): Erträge		
Begeben	7	137
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(135)	(75)
	(128)	62
Investor EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	84	1.141
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(489)	(152)
	(405)	989
Administrative: thesaurierend		
Begeben	382	730
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.192)	(414)
	(810)	316
Class E: thesaurierend		
Begeben	3.430	7.307
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(5.529)	(4.268)
	(2.099)	3.039
Erträge		
Begeben	1.089	1.985
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	57	18
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.375)	(714)
	(229)	1.289
Class E EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	3.812	8.455
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(5.495)	(3.422)
	(1.683)	5.033
Class E GBP (Hedged): Erträge		
Begeben	53	134
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	1	1
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(336)	(24)
	(282)	111
H Institutional: thesaurierend		
Begeben	2.482	4.492
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(4.207)	(552)
	(1.725)	3.940
Class R: thesaurierend		
Begeben	13	413
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(395)	(41)
	(382)	372
Class R GBP (Hedged): thesaurierend		
Begeben	178	286
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(375)	(411)
	(197)	(125)

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
	Income Fund	
Institutional:		
thesaurierend		
Begeben	205.515	280.834
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(266.612)	(241.043)
	(61.097)	39.791
Erträge		
Begeben	134.393	206.975
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	2.459	993
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(143.512)	(128.915)
	(6.660)	79.053
Institutional AUD (Hedged):		
thesaurierend		
Begeben	200	1.063
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(918)	(570)
	(718)	493
Erträge		
Begeben	123	1
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(124)	0
	(1)	1
Institutional BRL (Hedged):		
thesaurierend		
Begeben	1.312	6.235
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(24.928)	(8.888)
	(23.616)	(2.653)
Institutional CAD (Hedged):		
thesaurierend		
Begeben	352	232
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(937)	(1.455)
	(585)	(1.223)
Erträge		
Begeben	95	1.469
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	7	6
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(492)	(226)
	(390)	1.249
Institutional CHF (Hedged):		
thesaurierend		
Begeben	4.888	7.308
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(4.933)	(3.326)
	(45)	3.982
Erträge		
Begeben	2.143	5.466
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(4.171)	(5.504)
	(2.028)	(38)
Institutional EUR (Hedged):		
thesaurierend		
Begeben	305.996	445.245
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(373.923)	(474.365)
	(67.927)	(29.120)

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
	Income Fund (Fortsetzung)	
Erträge		
Begeben	28.529	57.671
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	264	143
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(49.457)	(31.092)
	(20.664)	26.722
ausschüttend II		
Begeben	768	1.354
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	9
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.351)	(4.975)
	(583)	(3.612)
Institutional GBP (Hedged):		
thesaurierend		
Begeben	2.926	19.942
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(5.345)	(1.397)
	(2.419)	18.545
Erträge		
Begeben	8.905	8.923
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	38	72
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(5.318)	(4.599)
	3.625	4.396
Institutional HKD (Unhedged):		
Erträge		
Begeben	7.384	7.104
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	17	14
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(33.765)	(6.571)
	(26.364)	547
Institutional JPY (Hedged):		
thesaurierend		
Begeben	123	69
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(352)	(21)
	(229)	48
Institutional NOK (Hedged):		
thesaurierend		
Begeben	4.029	2.065
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.602)	(2.257)
	1.427	(192)
Institutional RMB (Hedged):		
thesaurierend		
Begeben	0	1
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1)	0
	(1)	1
Institutional SGD (Hedged):		
thesaurierend		
Begeben	3.501	5.593
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.109)	(1.589)
	1.392	4.004
Erträge		
Begeben	7.373	9.167
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	65	133
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(8.523)	(8.499)
	(1.085)	801

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
	Income Fund (Fortsetzung)	
Investor:		
thesaurierend		
Begeben	21.157	95.403
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(74.160)	(40.915)
	(53.003)	54.488
Erträge		
Begeben	36.086	68.127
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	161	135
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(44.046)	(29.096)
	(7.799)	39.166
Investor AUD (Hedged):		
Erträge		
Begeben	1.063	3.049
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	1
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.007)	(814)
	56	2.236
Investor EUR (Hedged):		
thesaurierend		
Begeben	57.324	67.182
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(79.974)	(147.319)
	(22.650)	(80.137)
Erträge		
Begeben	1.522	6.631
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(3.390)	(1.493)
	(1.868)	5.138
ausschüttend A		
Begeben	161	348
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(540)	(452)
	(379)	(104)
Investor GBP (Hedged):		
Erträge		
Begeben	1.302	596
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(272)	(51)
	1.030	545
Investor RMB (Hedged):		
thesaurierend		
Begeben	0	734
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(415)	(1.857)
	(415)	(1.123)
Investor SGD (Hedged):		
thesaurierend		
Begeben	508	371
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(68)	(198)
	440	173
Erträge		
Begeben	2.208	3.753
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(3.473)	(778)
	(1.265)	2.975

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
	Income Fund (Fortsetzung)	
Administrative:		
thesaurierend		
Begeben	8.620	36.185
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(16.949)	(14.538)
	(8.329)	21.647
Erträge		
Begeben	66.046	98.909
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	410	332
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(96.953)	(69.234)
	(30.497)	30.007
Administrative AUD (Hedged):		
Erträge		
Begeben	5.920	3.417
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	74	56
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(4.398)	(6.578)
	1.596	(3.105)
Administrative EUR (Hedged):		
thesaurierend		
Begeben	16.413	4.326
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(23.680)	(8.652)
	(7.267)	(4.326)
Erträge		
Begeben	9.626	10.025
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(9.123)	(11.507)
	503	(1.482)
Administrative GBP (Hedged):		
Erträge		
Begeben	2.145	2.686
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	58	38
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(3.252)	(2.284)
	(1.049)	440
Administrative HKD (Unhedged):		
Erträge		
Begeben	102.825	242.800
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	36	51
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(201.758)	(96.356)
	(98.897)	146.495
Administrative JPY (Hedged):		
thesaurierend		
Begeben	713	1
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(714)	0
	(1)	1
Administrative SGD (Hedged):		
Erträge		
Begeben	19.561	20.372
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	312	221
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(16.816)	(15.212)
	3.057	5.381
Class E:		
thesaurierend		
Begeben	72.634	109.426
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(124.100)	(95.494)
	(51.466)	13.932

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
	Income Fund (Fortsetzung)	
Erträge		
Begeben	129.484	283.751
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	2.095	1.594
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(212.567)	(195.273)
	(80.988)	90.072
Ausschüttend Q		
Begeben	142	106
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(345)	(83)
	(203)	23
Class E AUD (Hedged): Erträge		
Begeben	9.508	18.516
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	317	234
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(10.371)	(15.777)
	(546)	2.973
Class E CHF (Hedged): thesaurierend		
Begeben	659	1.489
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.563)	(1.340)
	(904)	149
Erträge		
Begeben	2.434	1.801
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(4.987)	(4.019)
	(2.553)	(2.218)
Class E EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	69.869	119.154
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(84.120)	(101.651)
	(14.251)	17.503
Erträge		
Begeben	58.606	72.128
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	67	53
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(90.970)	(110.213)
	(32.297)	(38.032)
ausschüttend II		
Begeben	3.524	3.933
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.127)	(4.101)
	1.397	(168)
Ausschüttend II Q		
Begeben	911	3.124
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.774)	(1.352)
	(863)	1.772
Class E GBP (Hedged): Erträge		
Begeben	5.514	8.527
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	46	38
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(4.932)	(9.644)
	628	(1.079)

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
	Income Fund (Fortsetzung)	
Class E HKD (Unhedged): Erträge		
Begeben	68.787	77.394
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	267	157
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(142.484)	(152.376)
	(73.430)	(74.825)
Class E JPY (Hedged): thesaurierend		
Begeben	3.694	562
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(138)	(2.365)
	3.556	(1.803)
Erträge		
Begeben	1	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
	1	k. A.
Class E RMB (Hedged): Erträge		
Begeben	842	3.921
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	26	16
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.768)	(3.355)
	(900)	582
Class E SGD (Hedged): Erträge		
Begeben	71.590	79.819
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	1.221	862
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(58.744)	(66.148)
	14.067	14.533
G Retail EUR (Hedged): Erträge		
Begeben	291	380
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.161)	(918)
	(870)	(538)
G Retail EUR (Unhedged): Erträge		
Begeben	5	40
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(56)	(18)
	(51)	22
H Institutional: thesaurierend		
Begeben	21.920	40.755
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(25.642)	(24.565)
	(3.722)	16.190
Erträge		
Begeben	8.454	17.691
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	625	450
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(9.681)	(14.432)
	(602)	3.709
H Institutional EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	144	773
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(916)	(246)
	(772)	527

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
	Income Fund (Fortsetzung)	
Class R: thesaurierend		
Begeben	2.924	4.028
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.290)	(500)
	1.634	3.528
Erträge		
Begeben	491	2.279
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	33	19
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.911)	(861)
	(1.387)	1.437
Class R EUR (Hedged): Erträge		
Begeben	215	630
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	1	4
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(327)	(470)
	(111)	164
Class R GBP (Hedged): Erträge		
Begeben	925	1.256
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	2
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.828)	(1.013)
	(903)	245
Class T: thesaurierend		
Begeben	3.483	6.467
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(7.146)	(5.882)
	(3.663)	585
Erträge		
Begeben	745	2.853
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	119	90
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.127)	(2.645)
	(1.263)	298
Class T EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	2.767	3.695
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(4.018)	(4.848)
	(1.251)	(1.153)
Erträge		
Begeben	2.094	3.656
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(4.633)	(6.603)
	(2.539)	(2.947)
Class Z: thesaurierend		
Begeben	4.085	2.955
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	(255)
	4.085	2.700
Class Z AUD (Hedged): ausschüttend II		
Begeben	17.238	35.574
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	6.580	3.965
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(16.520)	(8.855)
	7.298	30.684

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
	Income Fund II	
Institutional: thesaurierend		
Begeben	0	2.396
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	0
	0	2.396
Erträge		
Begeben	0	1
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1)	0
	(1)	1
Class E: Erträge		
Begeben	2.007	173
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	1	1
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(113)	0
	1.895	174
Class E AUD (Hedged): Erträge		
Begeben	210	36
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	2	1
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	0
	212	37
Class E EUR (Hedged): Erträge		
Begeben	362	50
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	1	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(28)	0
	335	50
Class E GBP (Hedged): Erträge		
Begeben	332	20
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	1	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(24)	0
	309	20
Class E HKD (Unhedged): Erträge		
Begeben	8.423	246
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	11	1
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.455)	0
	6.979	247
Class E SGD (Hedged): Erträge		
Begeben	3	33
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	1	1
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(38)	0
	(34)	34
	Inflation Multi-Asset Fund	
Institutional: thesaurierend		
Begeben	3.039	2.300
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.334)	(1.765)
	1.705	535

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
Inflation Multi-Asset Fund (Fortsetzung)		
Institutional EUR (Partially Hedged): thesaurierend		
Begeben	11.234	477
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.993)	0
	8.241	477
Institutional GBP (Partially Hedged): thesaurierend		
Begeben	2.046	1.785
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(3.662)	(68)
	(1.616)	1.717
Administrative: ausschüttend II		
Begeben	334	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	5	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1)	k. A.
	338	k. A.
Administrative SGD (Hedged): ausschüttend II		
Begeben	3.086	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	28	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.917)	k. A.
	1.197	k. A.
Class E: thesaurierend		
Begeben	10.246	1.305
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.978)	(173)
	7.268	1.132
ausschüttend II		
Begeben	1	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
	1	k. A.
Class E AUD (Partially Hedged): thesaurierend		
Begeben	36	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
	36	k. A.
Class E EUR (Partially Hedged): thesaurierend		
Begeben	12.001	3.203
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(3.471)	(450)
	8.530	2.753
Erträge		
Begeben	1.435	535
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(731)	(64)
	704	471
Class E GBP (Partially Hedged): thesaurierend		
Begeben	1	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
	1	k. A.

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
Inflation Multi-Asset Fund (Fortsetzung)		
Class E SGD (Partially Hedged): thesaurierend		
Begeben	1	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
	1	k. A.
H Institutional: thesaurierend		
Begeben	1	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
	1	k. A.
M Retail: ausschüttend II		
Begeben	1	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
	1	k. A.
Low Average Duration Fund		
Institutional: thesaurierend		
Begeben	17.557	21.991
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(22.086)	(25.184)
	(4.529)	(3.193)
Erträge		
Begeben	3.385	343
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	24	3
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.191)	(687)
	2.218	(341)
Institutional EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	3.251	779
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.789)	(724)
	462	55
Erträge		
Begeben	416	875
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	1	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(449)	(714)
	(32)	161
Institutional GBP (Hedged): thesaurierend		
Begeben	534	1.360
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(133)	(634)
	401	726
Erträge		
Begeben	11	96
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	2	1
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(85)	(799)
	(72)	(702)
Investor: thesaurierend		
Begeben	1	4
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(229)	(590)
	(228)	(586)

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
Low Average Duration Fund (Fortsetzung)		
Erträge		
Begeben	33	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	1	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(590)	(140)
	(556)	(140)
Administrative: thesaurierend		
Begeben	203	29
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(181)	(310)
	22	(281)
Class E: thesaurierend		
Begeben	9.196	2.629
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(9.321)	(4.822)
	(125)	(2.193)
Erträge		
Begeben	60	210
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	1	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(154)	(840)
	(93)	(630)
Class E EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	1.475	737
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(446)	(775)
	1.029	(38)
H Institutional: thesaurierend		
Begeben	77.194	18.172
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(76.411)	(8.901)
	783	9.271
Erträge		
Begeben	97	860
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	3	4
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(686)	(796)
	(586)	68
Class R: thesaurierend		
Begeben	250	412
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(228)	(269)
	22	143
Low Duration Global Investment Grade Credit Fund		
Institutional: thesaurierend		
Begeben	8.468	5.684
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(5.711)	(5.451)
	2.757	233
Erträge		
Begeben	1.830	1
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	28	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	0
	1.858	1

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
Low Duration Global Investment Grade Credit Fund (Fortsetzung)		
Institutional EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	3.012	19.459
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(9.445)	(3.904)
	(6.433)	15.555
Erträge		
Begeben	2	95
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(82)	0
	(80)	95
Institutional GBP (Hedged): thesaurierend		
Begeben	263	1.089
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(166)	(1.232)
	97	(143)
Erträge		
Begeben	153	1.878
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.570)	(29)
	(1.417)	1.849
Institutional NOK (Hedged): thesaurierend		
Begeben	1.345	298
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(3.883)	(43)
	(2.538)	255
Class E EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	1.820	969
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(771)	(1.213)
	1.049	(244)
Low Duration Income Fund		
Institutional: thesaurierend		
Begeben	17.232	24.771
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(24.502)	(997)
	(7.270)	23.774
Erträge		
Begeben	401	1.281
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	2	2
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(479)	(174)
	(76)	1.109
Institutional CHF (Hedged): thesaurierend		
Begeben	16	206
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(194)	(67)
	(178)	139
Erträge		
Begeben	k. A.	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(1)
	k. A.	(1)

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
Low Duration Income Fund (Fortsetzung)		
Institutional EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	7.973	7.782
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(7.357)	(2.713)
	616	5.069
Erträge		
Begeben	5	6.036
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(6.040)	0
	(6.035)	6.036
Institutional GBP (Hedged): thesaurierend		
Begeben	10	298
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(169)	(13.944)
	(159)	(13.646)
Erträge		
Begeben	51	15.454
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(7.884)	(2.083)
	(7.833)	13.371
Institutional SGD (Hedged): thesaurierend		
Begeben	836	2.832
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.153)	(1.006)
	(317)	1.826
Investor EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	0	60
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(61)	0
	(61)	60
Erträge		
Begeben	0	47
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(48)	0
	(48)	47
Class E: thesaurierend		
Begeben	9.022	1.555
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(7.895)	(181)
	1.127	1.374
Erträge		
Begeben	496	963
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	4	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(519)	(161)
	(19)	802
Class E CHF (Hedged): thesaurierend		
Begeben	k. A.	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(1)
	k. A.	(1)

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
Low Duration Income Fund (Fortsetzung)		
Erträge		
Begeben	k. A.	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(1)
	k. A.	(1)
Class E EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	5.036	1.556
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(3.364)	(62)
	1.672	1.494
Erträge		
Begeben	291	124
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(78)	(43)
	213	81
Class E SGD (Hedged): Erträge		
Begeben	4	18
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	1	1
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(78)	(17)
	(73)	2
H Institutional: thesaurierend		
Begeben	14.535	348
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(8.743)	(5)
	5.792	343
Erträge		
Begeben	164	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(119)	k. A.
	45	k. A.
Class Z EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	0	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	0
	0	0
Low Duration Opportunities Fund		
Institutional: thesaurierend		
Begeben	15.819	10.426
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(22.277)	(6.509)
	(6.458)	3.917
Erträge		
Begeben	9	3.927
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(505)	(706)
	(496)	3.221
Institutional EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	1.940	2.661
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(3.402)	(3.829)
	(1.462)	(1.168)

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
Low Duration Opportunities Fund (Fortsetzung)		
Erträge		
Begeben	1.502	343
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	10	5
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.565)	(1.847)
	(53)	(1.499)
Institutional GBP (Hedged): thesaurierend		
Begeben	39.578	63.558
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(125.565)	(34.712)
	(85.987)	28.846
Erträge		
Begeben	7.687	26.846
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	71	43
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(20.525)	(16.871)
	(12.767)	10.018
Investor EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	15	382
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(336)	(612)
	(321)	(230)
Class E EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	67	101
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(160)	(224)
	(93)	(123)
Class Z: thesaurierend		
Begeben	0	301
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(135)	0
	(135)	301
Low Duration Opportunities ESG Fund		
Institutional: thesaurierend		
Begeben	446	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
	446	k. A.
Erträge		
Begeben	1	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
	1	k. A.
Institutional EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	23	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
	23	k. A.
Erträge		
Begeben	1	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
	1	k. A.

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
Low Duration Opportunities ESG Fund (Fortsetzung)		
Institutional GBP (Hedged): thesaurierend		
Begeben	20	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
	20	k. A.
Erträge		
Begeben	1	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
	1	k. A.
PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund		
Institutional: thesaurierend		
Begeben	1.904	2.566
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.448)	(3.977)
	(544)	(1.411)
Erträge		
Begeben	81	48
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(4.100)	(2.236)
	(4.019)	(2.188)
Institutional EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	3.125	1.766
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(995)	(675)
	2.130	1.091
Erträge		
Begeben	351	30
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(181)	(36)
	170	(6)
Institutional GBP (Hedged): thesaurierend		
Begeben	0	5
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(31)	(7)
	(31)	(2)
Erträge		
Begeben	0	5
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(5)	(30)
	(5)	(25)
Investor: thesaurierend		
Begeben	0	4
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(117)	(55)
	(117)	(51)
Erträge		
Begeben	k. A.	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(1)
	k. A.	(1)

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund (Fortsetzung)		
Investor EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	k. A.	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(4)
	k. A.	(4)
Class E:		
Erträge		
Begeben	5.241	1.631
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	1	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(3.306)	(712)
	1.936	919
Class Z:		
thesaurierend		
Begeben	0	296
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	(1)
	0	295
Mortgage Opportunities Fund		
Institutional: thesaurierend		
Begeben	25.921	23.801
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(35.398)	(18.996)
	(9.477)	4.805
Erträge		
Begeben	1.777	16.326
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	447	428
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(26.696)	(9.909)
	(24.472)	6.845
Institutional CAD (Hedged): thesaurierend		
Begeben	0	2.532
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	0
	0	2.532
Institutional CHF (Hedged): thesaurierend		
Begeben	53	42
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(263)	(180)
	(210)	(138)
Institutional EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	12.444	36.296
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(22.004)	(37.924)
	(9.560)	(1.628)
Erträge		
Begeben	134	2.122
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	43	4
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.207)	(214)
	(1.030)	1.912

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
Mortgage Opportunities Fund (Fortsetzung)		
Institutional GBP (Hedged): thesaurierend		
Begeben	35.235	4.017
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(36.241)	(3.014)
	(1.006)	1.003
Erträge		
Begeben	615	716
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(484)	(1.299)
	131	(583)
Investor: thesaurierend		
Begeben	155	829
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.077)	(2.443)
	(922)	(1.614)
Erträge		
Begeben	29	809
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	3	5
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.403)	(100)
	(1.371)	714
Administrative: Erträge		
Begeben	0	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(49)	0
	(49)	0
Class E:		
thesaurierend		
Begeben	1.235	1.440
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.163)	(2.086)
	(928)	(646)
Erträge		
Begeben	51	374
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	3	2
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(575)	(429)
	(521)	(53)
Class E CHF (Hedged):		
Erträge		
Begeben	0	3
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(14)	(5)
	(14)	(2)
Class E EUR (Hedged):		
thesaurierend		
Begeben	270	456
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(446)	(653)
	(176)	(197)
Erträge		
Begeben	0	3
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(17)	0
	(17)	3

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
Mortgage Opportunities Fund (Fortsetzung)		
Class E SGD (Hedged): thesaurierend		
Begeben	k. A.	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(1)
	k. A.	(1)
Erträge		
Begeben	0	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	1	1
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(169)	(50)
	(168)	(49)
H Institutional: thesaurierend		
Begeben	0	6
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(3)	0
	(3)	6
Class Z: thesaurierend		
Begeben	1	12.616
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(19.628)	0
	(19.627)	12.616
Class Z GBP (Hedged): thesaurierend		
Begeben	0	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(34.658)	0
	(34.658)	0
StocksPLUS™ Fund		
Institutional: thesaurierend		
Begeben	7.763	30.395
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(34.505)	(45.187)
	(26.742)	(14.792)
Erträge		
Begeben	1	59
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	6	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(186)	(465)
	(179)	(406)
Institutional EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	5.360	3.917
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(16.644)	(6.823)
	(11.284)	(2.906)
Erträge		
Begeben	0	5
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(68)	(5)
	(68)	0
Institutional GBP (Hedged): thesaurierend		
Begeben	461	18
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(23)	0
	438	18

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
StocksPLUS™ Fund (Fortsetzung)		
Institutional SGD (Hedged): thesaurierend		
Begeben	41	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(3)	k. A.
	38	k. A.
Investor: thesaurierend		
Begeben	260	62
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(191)	(101)
	69	(39)
BE Retail: thesaurierend		
Begeben	1	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
	1	k. A.
Class E: thesaurierend		
Begeben	1.702	2.404
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(970)	(1.259)
	732	1.145
Class E EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	4.253	293
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.398)	(184)
	1.855	109
H Institutional: thesaurierend		
Begeben	16.223	26.279
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(46.974)	(8.745)
	(30.751)	17.534
Class T: thesaurierend		
Begeben	0	34
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(124)	(50)
	(124)	(16)
PIMCO StocksPLUS™ AR Fund		
Institutional: thesaurierend		
Begeben	89	56
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(29)	(23)
	60	33
Institutional EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	2	1
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(26)	0
	(24)	1

Erläuterungen zum Abschluss (Fortsetzung)

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
PIMCO StocksPLUS[®] AR Fund (Fortsetzung)		
Institutional GBP (Hedged): thesaurierend		
Begeben	1	18
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	0
	1	18
Class E: thesaurierend		
Begeben	0	1
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2)	0
	(2)	1

	Strategic Income Fund	
Institutional: thesaurierend		
Begeben	74	436
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(889)	(800)
	(815)	(364)

Institutional EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	5.539	6.826
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(7.311)	(26.572)
	(1.772)	(19.746)

Institutional GBP (Hedged): Erträge		
Begeben	21	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
	21	k. A.

Class E: thesaurierend		
Begeben	1.152	735
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(875)	(667)
	277	68

ausschüttend II		
Begeben	760	363
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	1	1
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(600)	(384)
	161	(20)

Class E EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	4.473	2.264
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(3.943)	(3.158)
	530	(894)

ausschüttend II		
Begeben	1.437	1.767
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.014)	(2.755)
	(577)	(988)

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
Strategic Income Fund (Fortsetzung)		
Class T EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	210	341
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(264)	(381)
	(54)	(40)
Erträge		
Begeben	217	145
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(126)	(128)
	91	17

	Total Return Bond Fund	
Institutional: thesaurierend		
Begeben	14.515	20.002
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(12.236)	(29.064)
	2.279	(9.062)
Erträge		
Begeben	1.043	1.445
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	144	110
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(3.382)	(1.942)
	(2.195)	(387)

Institutional CAD (Hedged): Erträge		
Begeben	0	656
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	7	5
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(960)	(618)
	(953)	43

Institutional CHF (Hedged): thesaurierend		
Begeben	110	44
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(901)	(321)
	(791)	(277)

Institutional EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	11.822	11.374
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(7.110)	(16.801)
	4.712	(5.427)

Erträge		
Begeben	214	5.001
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	398	275
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(423)	(1.667)
	189	3.609

Institutional EUR (Unhedged): thesaurierend		
Begeben	1.047	1.364
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(799)	(2.078)
	248	(714)

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
	Total Return Bond Fund (Fortsetzung)	
Institutional GBP (Hedged): thesaurierend		
Begeben	89	7
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(172)	(286)
	(83)	(279)
ausschüttend		
Begeben	1.008	1.070
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	20	14
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.840)	(512)
	(812)	572
Institutional ILS (Hedged): thesaurierend		
Begeben	0	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(13)	(26)
	(13)	(26)
Institutional SGD (Hedged): thesaurierend		
Begeben	425	389
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.297)	(185)
	(872)	204
Investor: thesaurierend		
Begeben	6.860	2.569
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(3.170)	(8.776)
	3.690	(6.207)
ausschüttend		
Begeben	4.075	178
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	6	8
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.523)	(5.176)
	2.558	(4.990)
Investor CHF (Hedged): thesaurierend		
Begeben	28	20
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(138)	(135)
	(110)	(115)
Investor EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	441	14
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(277)	(341)
	164	(327)
Administrative: thesaurierend		
Begeben	1.321	262
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.487)	(1.094)
	(166)	(832)
ausschüttend		
Begeben	2.212	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.730)	k. A.
	482	k. A.

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
	Total Return Bond Fund (Fortsetzung)	
Administrative EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	154	1
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(29)	(130)
	125	(129)
Class E: thesaurierend		
Begeben	2.883	1.915
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(3.718)	(8.128)
	(835)	(6.213)
ausschüttend		
Begeben	1.010	1.408
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	33	55
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.318)	(4.098)
	(1.275)	(2.635)
Class E CHF (Hedged): thesaurierend		
Begeben	744	36
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(131)	(108)
	613	(72)
Class E EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	2.661	1.779
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(5.090)	(10.901)
	(2.429)	(9.122)
ausschüttend		
Begeben	431	540
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(909)	(2.278)
	(478)	(1.738)
Class E EUR (Unhedged): thesaurierend		
Begeben	19	83
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(35)	(16)
	(16)	67
Class E HKD (Unhedged): thesaurierend		
Begeben	82	211
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(186)	(178)
	(104)	33
Class E SGD (Hedged): thesaurierend		
Begeben	97	268
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(163)	(342)
	(66)	(74)
H Institutional: thesaurierend		
Begeben	8.179	1.136
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(10.096)	(1.227)
	(1.917)	(91)

Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
Total Return Bond Fund (Fortsetzung)		
ausschüttend		
Begeben	182	1.048
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	9	15
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(822)	(855)
	(631)	208
M Retail HKD (Unhedged):		
ausschüttend		
Begeben	99	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(29)	(286)
	70	(286)
Class R EUR (Hedged):		
thesaurierend		
Begeben	128	160
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(355)	(108)
	(227)	52
Class T:		
thesaurierend		
Begeben	96	549
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(616)	(902)
	(520)	(353)
Class T EUR (Hedged):		
thesaurierend		
Begeben	200	130
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(119)	(253)
	81	(123)
PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund		
Institutional:		
thesaurierend		
Begeben	12.457	5.565
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(4.248)	(1.555)
	8.209	4.010
Institutional EUR (Hedged):		
thesaurierend		
Begeben	10.855	47
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.198)	(175)
	9.657	(128)
Institutional GBP (Hedged):		
thesaurierend		
Begeben	1	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
	1	k. A.
ausschüttend		
Begeben	3.333	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
	3.333	k. A.

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund (Fortsetzung)		
Investor:		
thesaurierend		
Begeben	1	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
	1	k. A.
Investor EUR (Hedged):		
thesaurierend		
Begeben	1	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
	1	k. A.
Class E:		
thesaurierend		
Begeben	3.403	110
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.731)	(427)
	672	(317)
Class E EUR (Hedged):		
thesaurierend		
Begeben	1.900	99
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(402)	(35)
	1.498	64
H Institutional:		
thesaurierend		
Begeben	4	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
	4	k. A.
Class Z:		
thesaurierend		
Begeben	3.659	1.299
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	0
	3.659	1.299
UK Corporate Bond Fund		
Institutional:		
thesaurierend		
Begeben	653	2.794
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.469)	(5.446)
	(816)	(2.652)
ausschüttend		
Begeben	8.201	12.966
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	1
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(16.638)	(20.576)
	(8.437)	(7.609)
H Institutional:		
ausschüttend		
Begeben	k. A.	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	k. A.	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	k. A.	(1)
	k. A.	(1)
Class Z:		
thesaurierend		
Begeben	0	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	0
	0	0

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
UK Long Term Corporate Bond Fund		
Institutional: thesaurierend		
Begeben	5.022	4.410
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(3.722)	(1.590)
	1.300	2.820
ausschüttend		
Begeben	183	169
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	45
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(105)	(292)
	78	(78)
US High Yield Bond Fund		
Institutional: thesaurierend		
Begeben	4.125	18.555
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(23.143)	(35.432)
	(19.018)	(16.877)
ausschüttend		
Begeben	1.227	13.184
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	158	212
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(13.176)	(5.260)
	(11.791)	8.136
Institutional CHF (Hedged): thesaurierend		
Begeben	22	122
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(244)	(118)
	(222)	4
Institutional EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	2.175	8.803
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(8.534)	(3.328)
	(6.359)	5.475
ausschüttend		
Begeben	669	1.391
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	303	278
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(9.203)	(493)
	(8.231)	1.176
Institutional GBP (Hedged): thesaurierend		
Begeben	196	268
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(292)	(68)
	(96)	200
ausschüttend		
Begeben	63	254
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(447)	(463)
	(384)	(209)
Institutional SGD (Hedged): thesaurierend		
Begeben	15	37
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(52)	0
	(37)	37

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
US High Yield Bond Fund (Fortsetzung)		
Investor: thesaurierend		
Begeben	485	5.051
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(4.966)	(1.917)
	(4.481)	3.134
ausschüttend		
Begeben	448	1.582
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	31	27
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.987)	(925)
	(1.508)	684
Investor EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	495	21
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(495)	(48)
	0	(27)
Class E: thesaurierend		
Begeben	853	2.535
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(2.926)	(2.107)
	(2.073)	428
ausschüttend		
Begeben	5.181	16.026
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	70	64
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(10.275)	(14.086)
	(5.024)	2.004
Class E EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	1.163	716
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.564)	(1.070)
	(401)	(354)
H Institutional: thesaurierend		
Begeben	6.232	6.031
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(7.216)	(5.457)
	(984)	574
ausschüttend		
Begeben	31	90
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	1	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(70)	(1)
	(38)	89
M Retail: ausschüttend		
Begeben	12.039	14.553
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	1	1
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(11.070)	(14.913)
	970	(359)
Class R: thesaurierend		
Begeben	319	56
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(236)	(66)
	83	(10)

Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
US High Yield Bond Fund (Fortsetzung)		
Class Z: thesaurierend		
Begeben	0	0
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	0
	0	0
US Investment Grade Corporate Bond Fund		
Institutional: thesaurierend		
Begeben	10.490	4.087
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(6.644)	(12.841)
	3.846	(8.754)
ausschüttend		
Begeben	2.630	2.579
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	3	3
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.431)	(4.935)
	1.202	(2.353)
Institutional EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	6.790	18.089
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(12.251)	(22.965)
	(5.461)	(4.876)
Institutional GBP (Hedged): ausschüttend II		
Begeben	840	1.207
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	283	1.027
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(30.818)	(3.747)
	(29.695)	(1.513)
Class E: thesaurierend		
Begeben	1.086	492
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(249)	(1.328)
	837	(836)
ausschüttend		
Begeben	111	216
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	1	1
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(279)	(644)
	(167)	(427)
H Institutional: thesaurierend		
Begeben	6	k. A.
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	k. A.
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	0	k. A.
	6	k. A.
US Short-Term Fund		
Institutional: thesaurierend		
Begeben	73.837	49.749
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(71.198)	(114.398)
	2.639	(64.649)

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
US Short-Term Fund (Fortsetzung)		
ausschüttend		
Begeben	3.299	2.619
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(264)	(11.890)
	3.035	(9.271)
Institutional EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	16.072	16.010
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(18.694)	(17.952)
	(2.622)	(1.942)
Investor: thesaurierend		
Begeben	174	704
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(681)	(978)
	(507)	(274)
Class E: thesaurierend		
Begeben	15.967	20.241
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(20.780)	(28.234)
	(4.813)	(7.993)
Class E EUR (Hedged): thesaurierend		
Begeben	4.393	137
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(681)	(401)
	3.712	(264)
H Institutional: thesaurierend		
Begeben	840	4.940
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	0	0
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(1.943)	(3.084)
	(1.103)	1.856
Class Z: ausschüttend		
Begeben	690	1.480
Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	1.338	932
Rücknahmen während des Geschäftsjahres	(32.194)	(6.347)
	(30.166)	(3.935)

19. NETTOINVENTARWERTE

Im Folgenden sind das rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilhabern zuzuschreibende Nettovermögen der einzelnen Teilfonds, die ausgegebenen und umlaufenden Anteile und der NIW je Anteil der vergangenen drei Jahre (Angaben in Tausend, ausgenommen Beträge je Anteil) aufgeführt. Der in diesem Abschluss angegebene NIW je Anteil kann gemäß FRS 102 erforderliche Anpassungen enthalten. Diese können dazu führen, dass die Nettoinventarwerte oder Gesamterlöse der Anteilhaber von denjenigen abweichen, die in diesem Abschluss angegeben sind. Das Nettovermögen geteilt durch die Anzahl der ausgegebenen und umlaufenden Anteile kann vom NIW aufgrund gerundeter Werte abweichen:

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021	Zum 31. Dez. 2020
PIMCO Asia High Yield Bond Fund			
Nettovermögen	\$ 2.981.392	\$ 3.411.923	\$ 890.928
Institutional: thesaurierend	\$ 1.552.047	\$ 1.221.240	\$ 265.889
ausgegebene und umlaufende Anteile	174.453	117.953	23.044
NIW je Anteil	\$ 8,90	\$ 10,35	\$ 11,54

	Zum 31. Dez. 2022			Zum 31. Dez. 2021			Zum 31. Dez. 2020		
	PIMCO Asia High Yield Bond Fund (Fortsetzung)								
ausschüttend	\$	113.734	\$	248.734	\$	43.289			
ausgegebene und umlaufende Anteile		16.032		28.125		4.163			
NIW je Anteil	\$	7,09	\$	8,84	\$	10,40			
Institutional AUD (Hedged):									
ausschüttend	AUD	203.422	AUD	12	k. A.				
ausgegebene und umlaufende Anteile		28.372		1	k. A.				
NIW je Anteil	AUD	7,17	AUD	9,00	k. A.				
Institutional CHF (Hedged):									
thesaurierend	CHF	4.094	CHF	35.166	CHF	6.108			
ausgegebene und umlaufende Anteile		527		3.797		586			
NIW je Anteil	CHF	7,77	CHF	9,26	CHF	10,43			
ausschüttend	CHF	1.912	CHF	5.135	CHF	860			
ausgegebene und umlaufende Anteile		281		591		83			
NIW je Anteil	CHF	6,81	CHF	8,69	CHF	10,32			
Institutional EUR (Hedged):									
thesaurierend	€	498.977	€	653.189	€	38.336			
ausgegebene und umlaufende Anteile		63.739		70.200		3.662			
NIW je Anteil	€	7,83	€	9,30	€	10,47			
ausschüttend	€	27.728	€	75.650	€	11.559			
ausgegebene und umlaufende Anteile		4.056		8.695		1.120			
NIW je Anteil	€	6,84	€	8,70	€	10,32			
Institutional GBP (Hedged):									
thesaurierend	£	14.369	£	18.246	k. A.				
ausgegebene und umlaufende Anteile		1.836		1.996	k. A.				
NIW je Anteil	£	7,83	£	9,14	k. A.				
ausschüttend	£	20.785	£	59.979	k. A.				
ausgegebene und umlaufende Anteile		3.068		7.061	k. A.				
NIW je Anteil	£	6,77	£	8,50	k. A.				
Institutional RMB (Hedged):									
ausschüttend		k. A.	CNH	61	k. A.				
ausgegebene und umlaufende Anteile		k. A.		1	k. A.				
NIW je Anteil		k. A.	CNH	91,17	k. A.				
Institutional SGD (Hedged):									
ausschüttend	SGD	385	SGD	85	k. A.				
ausgegebene und umlaufende Anteile		53		9	k. A.				
NIW je Anteil	SGD	7,23	SGD	9,01	k. A.				
Investor:									
thesaurierend	\$	8.727	\$	19.282	k. A.				
ausgegebene und umlaufende Anteile		1.164		2.201	k. A.				
NIW je Anteil	\$	7,50	\$	8,76	k. A.				
ausschüttend	\$	71.688	\$	273.632	\$	66.319			
ausgegebene und umlaufende Anteile		10.304		31.566		6.506			
NIW je Anteil	\$	6,96	\$	8,67	\$	10,19			
Investor AUD (Hedged):									
ausschüttend	AUD	3.889	AUD	5.081	AUD	366			
ausgegebene und umlaufende Anteile		557		579		35			
NIW je Anteil	AUD	6,99	AUD	8,77	AUD	10,34			
Investor EUR (Hedged):									
ausschüttend	€	873	€	935	€	226			
ausgegebene und umlaufende Anteile		130		110		22			
NIW je Anteil	€	6,69	€	8,52	€	10,11			
Investor RMB (Hedged):									
ausschüttend	CNH	13.234	CNH	24.873	CNH	8.387			
ausgegebene und umlaufende Anteile		182		275		81			
NIW je Anteil	CNH	72,74	CNH	90,46	CNH	103,59			
Investor SGD (Hedged):									
ausschüttend	SGD	4.112	SGD	6.528	SGD	1.175			
ausgegebene und umlaufende Anteile		591		753		115			
NIW je Anteil	SGD	6,96	SGD	8,67	SGD	10,19			

	Zum 31. Dez. 2022			Zum 31. Dez. 2021			Zum 31. Dez. 2020			
	PIMCO Asia High Yield Bond Fund (Fortsetzung)									
Administrative:										
ausschüttend	\$	28.245	\$	41.320	\$	18.459				
ausgegebene und umlaufende Anteile		3.980		4.672		1.775				
NIW je Anteil	\$	7,10	\$	8,84	\$	10,40				
Class E:										
thesaurierend	\$	61.585	\$	78.405	\$	6.725				
ausgegebene und umlaufende Anteile		7.540		8.175		624				
NIW je Anteil	\$	8,17	\$	9,59	\$	10,79				
ausschüttend	\$	56.633	\$	100.159	\$	25.374				
ausgegebene und umlaufende Anteile		7.981		11.325		2.440				
NIW je Anteil	\$	7,10	\$	8,84	\$	10,40				
Class E CHF (Hedged):										
thesaurierend	CHF	1.012	CHF	1.263	CHF	89				
ausgegebene und umlaufende Anteile		133		138		9				
NIW je Anteil	CHF	7,63	CHF	9,16	CHF	10,41				
ausschüttend	CHF	245	CHF	280	CHF	31				
ausgegebene und umlaufende Anteile		36		32		3				
NIW je Anteil	CHF	6,81	CHF	8,69	CHF	10,33				
Class E EUR (Hedged):										
thesaurierend	€	48.877	€	61.580	€	20.246				
ausgegebene und umlaufende Anteile		6.365		6.687		1.938				
NIW je Anteil	€	7,68	€	9,21	€	10,45				
ausschüttend	€	8.314	€	10.041	€	1.020				
ausgegebene und umlaufende Anteile		1.217		1.154		99				
NIW je Anteil	€	6,83	€	8,70	€	10,32				
Class E HKD (Unhedged):										
ausschüttend	HKD	6.334	HKD	4.540	HKD	2.458				
ausgegebene und umlaufende Anteile		897		516		239				
NIW je Anteil	HKD	7,06	HKD	8,79	HKD	10,28				
Class E SGD (Hedged):										
ausschüttend	SGD	15.239	SGD	25.623	SGD	12.464				
ausgegebene und umlaufende Anteile		2.168		2.924		1.211				
NIW je Anteil	SGD	7,03	SGD	8,76	SGD	10,29				
H Institutional:										
thesaurierend	\$	1.323	\$	182	k. A.					
ausgegebene und umlaufende Anteile		172		20	k. A.					
NIW je Anteil	\$	7,69	\$	8,96	k. A.					
ausschüttend	\$	547	\$	686	k. A.					
ausgegebene und umlaufende Anteile		79		80	k. A.					
NIW je Anteil	\$	6,90	\$	8,60	k. A.					
M Retail:										
ausschüttend II	\$	17.613	\$	22.700	\$	12.308				
ausgegebene und umlaufende Anteile		2.637		2.684		1.219				
NIW je Anteil	\$	6,68	\$	8,46	\$	10,10				
M Retail HKD (Unhedged):										
ausschüttend II	HKD	1.797	HKD	6.482	HKD	1.567				
ausgegebene und umlaufende Anteile		270		771		157				
NIW je Anteil	HKD	6,65	HKD	8,41	HKD	9,98				
M Retail SGD (Hedged):										
ausschüttend II	SGD	8.881	SGD	11.492	SGD	7.080				
ausgegebene und umlaufende Anteile		1.342		1.372		708				
NIW je Anteil	SGD	6,62	SGD	8,38	SGD	10,00				
Class Z:										
thesaurierend	\$	230.136	\$	300.885	\$	339.431				
ausgegebene und umlaufende Anteile		25.207		28.503		29.046				
NIW je Anteil	\$	9,13	\$	10,56	\$	11,69				
		Asia Strategic Interest Bond Fund								
Nettvermögen	\$	313.987	\$	361.011	\$	167.716				
Institutional:										
ausschüttend	\$	54.459	\$	64.997	\$	3.652				
ausgegebene und umlaufende Anteile		6.776		6.958		362				
NIW je Anteil	\$	8,04	\$	9,34	\$	10,10				

Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021	Zum 31. Dez. 2020
Asia Strategic Interest Bond Fund (Fortsetzung)			
Institutional EUR (Hedged):			
ausschüttend	€ 97.916	€ 102.975	k. A.
ausgegebene und umlaufende			
Anteile	12.495	11.068	k. A.
NIW je Anteil	€ 7,84	€ 9,30	k. A.
Institutional GBP (Hedged):			
ausschüttend	£ 205	£ 174	k. A.
ausgegebene und umlaufende			
Anteile	26	19	k. A.
NIW je Anteil	£ 8,04	£ 9,41	k. A.
Institutional SGD (Hedged):			
ausschüttend	SGD 3.799	SGD 5.354	SGD 4.213
ausgegebene und umlaufende			
Anteile	467	566	412
NIW je Anteil	SGD 8,13	SGD 9,46	SGD 10,22
Class E:			
thesaurierend	\$ 806	\$ 12	\$ 10
ausgegebene und umlaufende			
Anteile	94	1	1
NIW je Anteil	\$ 8,62	\$ 9,69	\$ 10,19
ausschüttend	\$ 24.409	\$ 24.934	\$ 23.579
ausgegebene und umlaufende			
Anteile	3.450	3.015	2.605
NIW je Anteil	\$ 7,08	\$ 8,27	\$ 9,05
Class E EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 5.640	€ 5.060	k. A.
ausgegebene und umlaufende			
Anteile	680	532	k. A.
NIW je Anteil	€ 8,29	€ 9,51	k. A.
Class E EUR (Unhedged):			
thesaurierend	€ 21.244	€ 25.443	€ 14.254
ausgegebene und umlaufende			
Anteile	1.500	1.703	976
NIW je Anteil	€ 14,17	€ 14,94	€ 14,60
Class E HKD (Unhedged):			
ausschüttend	HKD 2.973	HKD 3.401	HKD 79
ausgegebene und umlaufende			
Anteile	367	362	8
NIW je Anteil	HKD 8,09	HKD 9,40	HKD 10,10
Class E SGD (Hedged):			
ausschüttend	SGD 300	SGD 337	SGD 355
ausgegebene und umlaufende			
Anteile	37	36	35
NIW je Anteil	SGD 8,13	SGD 9,46	SGD 10,22
M Retail HKD (Unhedged):			
ausschüttend	HKD 31.879	HKD 39.857	HKD 49.317
ausgegebene und umlaufende			
Anteile	5.174	5.540	6.298
NIW je Anteil	HKD 6,16	HKD 7,19	HKD 7,83
Class Z:			
thesaurierend	\$ 93.351	\$ 109.270	\$ 113.208
ausgegebene und umlaufende			
Anteile	10.610	11.219	11.220
NIW je Anteil	\$ 8,80	\$ 9,74	\$ 10,09

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021	Zum 31. Dez. 2020
PIMCO Capital Securities Fund (Fortsetzung)			
Institutional CHF (Hedged):			
thesaurierend	CHF 52.485	CHF 120.911	CHF 51.534
ausgegebene und umlaufende			
Anteile	3.478	6.908	3.064
NIW je Anteil	CHF 15,09	CHF 17,50	CHF 16,82
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 1.198.101	€ 1.868.333	€ 1.661.782
ausgegebene und umlaufende			
Anteile	88.171	118.946	110.286
NIW je Anteil	€ 13,59	€ 15,71	€ 15,07
ausschüttend	€ 383.951	€ 481.884	€ 487.278
ausgegebene und umlaufende			
Anteile	36.928	38.373	39.195
NIW je Anteil	€ 10,40	€ 12,56	€ 12,43
ausschüttend II	€ 31.417	€ 41.671	€ 26.473
ausgegebene und umlaufende			
Anteile	3.979	4.334	2.760
NIW je Anteil	€ 7,89	€ 9,61	€ 9,59
Institutional GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 35.494	£ 43.301	£ 37.603
ausgegebene und umlaufende			
Anteile	2.518	2.696	2.455
NIW je Anteil	£ 14,10	£ 16,06	£ 15,32
ausschüttend	£ 67.663	£ 106.976	£ 127.724
ausgegebene und umlaufende			
Anteile	6.132	8.135	9.873
NIW je Anteil	£ 11,03	£ 13,15	£ 12,94
Institutional RMB (Hedged):			
ausschüttend	k. A.	CNH 66	k. A.
ausgegebene und umlaufende			
Anteile	k. A.	1	k. A.
NIW je Anteil	k. A.	CNH 100,31	k. A.
Institutional SGD (Hedged):			
ausschüttend	SGD 178	SGD 39	k. A.
ausgegebene und umlaufende			
Anteile	21	4	k. A.
NIW je Anteil	SGD 8,38	SGD 9,91	k. A.
Investor:			
thesaurierend	\$ 215.127	\$ 345.234	\$ 237.400
ausgegebene und umlaufende			
Anteile	16.173	22.879	16.481
NIW je Anteil	\$ 13,30	\$ 15,09	\$ 14,40
ausschüttend	\$ 72.649	\$ 245.968	\$ 202.032
ausgegebene und umlaufende			
Anteile	7.387	21.180	17.730
NIW je Anteil	\$ 9,84	\$ 11,61	\$ 11,39
Investor AUD (Hedged):			
ausschüttend	AUD 12.971	AUD 26.915	AUD 26.186
ausgegebene und umlaufende			
Anteile	1.437	2.496	2.467
NIW je Anteil	AUD 9,03	AUD 10,79	AUD 10,62
Investor CAD (Hedged):			
ausschüttend	CAD 4.043	CAD 4.771	CAD 546
ausgegebene und umlaufende			
Anteile	432	431	50
NIW je Anteil	CAD 9,35	CAD 11,08	CAD 10,89
Investor EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 23.367	€ 49.337	€ 37.573
ausgegebene und umlaufende			
Anteile	1.978	3.601	2.848
NIW je Anteil	€ 11,81	€ 13,70	€ 13,19

	Zum 31. Dez. 2022		Zum 31. Dez. 2021		Zum 31. Dez. 2020	
PIMCO Capital Securities Fund (Fortsetzung)						
Investor GBP (Hedged):	£	2.695	£	3.470	£	2.096
ausschüttend						
ausgegebene und umlaufende Anteile		319		344		211
NIW je Anteil	£	8,46	£	10,08	£	9,92
Investor RMB (Hedged):	CNH	31.763	CNH	39.482	CNH	37.405
ausschüttend						
ausgegebene und umlaufende Anteile		313		330		327
NIW je Anteil	CNH	101,51	CNH	119,51	CNH	114,26
Investor SGD (Hedged):	SGD	5.849	SGD	5.321	SGD	4.726
ausschüttend						
ausgegebene und umlaufende Anteile		630		484		438
NIW je Anteil	SGD	9,29	SGD	10,99	SGD	10,78
Administrative:						
thesaurierend	\$	141.400	\$	149.168	\$	193.489
ausgegebene und umlaufende Anteile		7.599		7.057		9.574
NIW je Anteil	\$	18,61	\$	21,14	\$	20,21
ausschüttend	\$	98.383	\$	140.861	\$	137.606
ausgegebene und umlaufende Anteile		7.402		8.978		8.938
NIW je Anteil	\$	13,29	\$	15,69	\$	15,39
ausschüttend II	\$	10		k. A.		k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile		1		k. A.		k. A.
NIW je Anteil	\$	9,60		k. A.		k. A.
Administrative EUR (Hedged):	€	13.449	€	18.966	€	20.552
thesaurierend						
ausgegebene und umlaufende Anteile		843		1.024		1.150
NIW je Anteil	€	15,95	€	18,53	€	17,87
Administrative SGD (Hedged):	SGD	14		k. A.		k. A.
ausschüttend II						
ausgegebene und umlaufende Anteile		1		k. A.		k. A.
NIW je Anteil	SGD	9,59		k. A.		k. A.
Class E:						
thesaurierend	\$	352.622	\$	452.418	\$	406.039
ausgegebene und umlaufende Anteile		25.798		29.018		27.132
NIW je Anteil	\$	13,67	\$	15,59	\$	14,97
ausschüttend	\$	64.556	\$	99.264	\$	84.704
ausgegebene und umlaufende Anteile		6.556		8.539		7.426
NIW je Anteil	\$	9,85	\$	11,62	\$	11,41
Class E CHF (Hedged):	CHF	8.252	CHF	11.446	CHF	9.397
thesaurierend						
ausgegebene und umlaufende Anteile		793		940		796
NIW je Anteil	CHF	10,41	CHF	12,18	CHF	11,81
Class E EUR (Hedged):	€	402.295	€	497.935	€	465.125
thesaurierend						
ausgegebene und umlaufende Anteile		34.146		36.232		34.965
NIW je Anteil	€	11,78	€	13,74	€	13,30
ausschüttend	€	62.789	€	73.090	€	62.905
ausgegebene und umlaufende Anteile		7.332		7.069		6.146
NIW je Anteil	€	8,56	€	10,34	€	10,23
M Retail:						
ausschüttend II	\$	218.883	\$	306.306	\$	218.504
ausgegebene und umlaufende Anteile		24.922		29.067		20.788
NIW je Anteil	\$	8,78	\$	10,54	\$	10,51
M Retail HKD (Unhedged):	HKD	2.801	HKD	24.499	HKD	23.223
ausschüttend						
ausgegebene und umlaufende Anteile		298		2.211		2.148
NIW je Anteil	HKD	9,40	HKD	11,08	HKD	10,81
M Retail SGD (Hedged):	SGD	100.715	SGD	145.278	SGD	67.688
ausschüttend II						
ausgegebene und umlaufende Anteile		11.653		13.981		6.533
NIW je Anteil	SGD	8,64	SGD	10,39	SGD	10,36

	Zum 31. Dez. 2022		Zum 31. Dez. 2021		Zum 31. Dez. 2020	
PIMCO Capital Securities Fund (Fortsetzung)						
Class R:						
ausschüttend	\$	4.980	\$	6.177	\$	5.913
ausgegebene und umlaufende Anteile		501		526		514
NIW je Anteil	\$	9,94	\$	11,73	\$	11,51
Class R EUR (Hedged):	€	3.708	€	12.422	€	9.666
ausschüttend						
ausgegebene und umlaufende Anteile		445		1.233		970
NIW je Anteil	€	8,33	€	10,07	€	9,97
Class R GBP (Hedged):	£	2.795	£	5.957	£	6.265
ausschüttend						
ausgegebene und umlaufende Anteile		315		564		603
NIW je Anteil	£	8,86	£	10,56	£	10,39
Class T:						
ausschüttend	\$	8.517	\$	11.570	\$	10.970
ausgegebene und umlaufende Anteile		839		966		933
NIW je Anteil	\$	10,15	\$	11,98	\$	11,75
Class T EUR (Hedged):	€	65.092	€	84.896	€	68.823
thesaurierend						
ausgegebene und umlaufende Anteile		6.106		6.800		5.673
NIW je Anteil	€	10,66	€	12,48	€	12,13
Class Z:						
ausschüttend	\$	78.203	\$	124.585	\$	71.902
ausgegebene und umlaufende Anteile		7.202		9.705		5.708
NIW je Anteil	\$	10,86	\$	12,84	\$	12,60
Class Z AUD (Hedged):	AUD	104.790	AUD	127.724	AUD	125.272
ausschüttend						
ausgegebene und umlaufende Anteile		11.002		11.223		11.181
NIW je Anteil	AUD	9,52	AUD	11,38	AUD	11,20
PIMCO Climate Bond Fund						
Nettovermögen	\$	292.655	\$	328.081	\$	101.869
Institutional:						
thesaurierend	\$	27.502	\$	21.317	\$	4.565
ausgegebene und umlaufende Anteile		3.116		2.108		449
NIW je Anteil	\$	8,83	\$	10,11	\$	10,17
Institutional CHF (Hedged):	CHF	940	CHF	1.103	CHF	231
thesaurierend						
ausgegebene und umlaufende Anteile		112		111		23
NIW je Anteil	CHF	8,42	CHF	9,91	CHF	10,06
Institutional EUR (Hedged):	€	62.757	€	80.658	€	16.688
thesaurierend						
ausgegebene und umlaufende Anteile		7.351		8.066		1.646
NIW je Anteil	€	8,54	€	10,00	€	10,14
ausschüttend	€	73.780	€	101.819	€	60.190
ausgegebene und umlaufende Anteile		8.951		10.361		5.992
NIW je Anteil	€	8,24	€	9,83	€	10,05
Institutional GBP (Hedged):	£	32.441	£	28.217	£	1.717
thesaurierend						
ausgegebene und umlaufende Anteile		3.720		2.799		169
NIW je Anteil	£	8,72	£	10,08	£	10,15
ausschüttend	£	25.204	£	715	£	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile		2.978		72		k. A.
NIW je Anteil	£	8,46	£	9,97	£	k. A.
Institutional SEK (Hedged):	SEK	290.215	SEK	292.047	SEK	k. A.
thesaurierend						
ausgegebene und umlaufende Anteile		3.406		2.939		k. A.
NIW je Anteil	SEK	85,22	SEK	99,36	SEK	k. A.
Institutional SGD (Hedged):	SGD	5.576	SGD	5.453	SGD	k. A.
thesaurierend						
ausgegebene und umlaufende Anteile		635		541		k. A.
NIW je Anteil	SGD	8,78	SGD	10,08	SGD	k. A.

Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021	Zum 31. Dez. 2020
PIMCO Climate Bond Fund (Fortsetzung)			
Investor:			
thesaurierend	k. A.	\$ 3.214	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	321	k. A.
NIW je Anteil	k. A.	\$ 10,00	k. A.
Investor EUR (Hedged):			
thesaurierend	k. A.	€ 8	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	1	k. A.
NIW je Anteil	k. A.	€ 9,92	k. A.
Administrative SEK (Hedged):			
thesaurierend	SEK 73	SEK 86	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	k. A.
NIW je Anteil	SEK 84,84	SEK 99,39	k. A.
Class E EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 15.976	€ 16.979	€ 507
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.909	1.718	50
NIW je Anteil	€ 8,37	€ 9,88	€ 10,11
Class Z:			
thesaurierend	\$ 9	\$ 10	\$ 10
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	1
NIW je Anteil	\$ 8,93	\$ 10,18	\$ 10,18
Commodity Real Return Fund			
Nettovermögen	\$ 1.369.877	\$ 1.444.182	\$ 325.109
Institutional:			
thesaurierend	\$ 397.781	\$ 587.333	\$ 162.906
ausgegebene und umlaufende Anteile	41.220	67.481	24.677
NIW je Anteil	\$ 9,65	\$ 8,70	\$ 6,60
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 225.302	€ 144.220	€ 31.294
ausgegebene und umlaufende Anteile	23.996	16.678	4.723
NIW je Anteil	€ 9,39	€ 8,65	€ 6,63
Institutional EUR (Unhedged):			
thesaurierend	€ 87.086	€ 48.990	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.527	4.337	k. A.
NIW je Anteil	€ 13,34	€ 11,29	k. A.
Institutional GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 39.019	£ 36.172	£ 14.663
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.963	3.012	1.597
NIW je Anteil	£ 13,17	£ 12,01	£ 9,18
Institutional GBP (Unhedged):			
ausschüttend	£ 17.587	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.881	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	£ 9,35	k. A.	k. A.
Investor:			
thesaurierend	\$ 50.111	\$ 64.377	\$ 10.609
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.022	8.546	1.851
NIW je Anteil	\$ 8,32	\$ 7,53	\$ 5,73
Class E:			
thesaurierend	\$ 260.353	\$ 256.747	\$ 66.707
ausgegebene und umlaufende Anteile	33.734	36.552	12.411
NIW je Anteil	\$ 7,72	\$ 7,02	\$ 5,37
Class E EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 238.920	€ 234.570	€ 21.703
ausgegebene und umlaufende Anteile	33.254	35.127	4.204
NIW je Anteil	€ 7,18	€ 6,68	€ 5,16
Class E SGD (Hedged):			
thesaurierend	SGD 2.069	SGD 352	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	183	34	k. A.
NIW je Anteil	SGD 11,30	SGD 10,32	k. A.
H Institutional:			
thesaurierend	\$ 3.614	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	427	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	\$ 8,46	k. A.	k. A.

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021	Zum 31. Dez. 2020
PIMCO Credit Opportunities Bond Fund			
Nettovermögen	\$ 97.153	\$ 139.704	\$ 144.512
Institutional:			
thesaurierend	\$ 44.986	\$ 47.099	\$ 46.003
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.318	3.345	3.308
NIW je Anteil	\$ 13,56	\$ 14,07	\$ 13,91
Institutional CHF (Hedged):			
thesaurierend	CHF 15.367	CHF 22.488	CHF 22.715
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.500	2.060	2.084
NIW je Anteil	CHF 10,24	CHF 10,92	CHF 10,90
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 15.443	€ 39.139	€ 41.292
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.312	3.136	3.320
NIW je Anteil	€ 11,77	€ 12,48	€ 12,44
Class E:			
thesaurierend	\$ 8.985	\$ 9.740	\$ 8.496
ausgegebene und umlaufende Anteile	803	831	726
NIW je Anteil	\$ 11,20	\$ 11,73	\$ 11,70
Class E EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 9.455	€ 12.026	€ 11.273
ausgegebene und umlaufende Anteile	971	1.154	1.075
NIW je Anteil	€ 9,74	€ 10,42	€ 10,48
Diversified Income Fund			
Nettovermögen	\$ 8.751.796	\$ 16.447.733	\$ 18.641.861
Institutional:			
thesaurierend	\$ 824.847	\$ 1.243.637	\$ 1.066.263
ausgegebene und umlaufende Anteile	35.047	44.236	37.907
NIW je Anteil	\$ 23,54	\$ 28,11	\$ 28,13
ausschüttend	\$ 352.231	\$ 692.397	\$ 830.361
ausgegebene und umlaufende Anteile	27.897	44.132	51.315
NIW je Anteil	\$ 12,63	\$ 15,69	\$ 16,18
Institutional CAD (Hedged):			
thesaurierend	CAD 441.412	CAD 571.190	CAD 423.593
ausgegebene und umlaufende Anteile	45.218	48.824	36.151
NIW je Anteil	CAD 9,76	CAD 11,70	CAD 11,72
Institutional CHF (Hedged):			
thesaurierend	CHF 15.646	CHF 20.277	CHF 19.775
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.299	1.371	1.322
NIW je Anteil	CHF 12,04	CHF 14,79	CHF 14,96
ausschüttend	CHF 8.022	CHF 13.028	CHF 19.392
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.111	1.412	2.014
NIW je Anteil	CHF 7,22	CHF 9,23	CHF 9,63
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 998.452	€ 1.703.682	€ 1.697.782
ausgegebene und umlaufende Anteile	65.216	90.940	89.784
NIW je Anteil	€ 15,31	€ 18,73	€ 18,91
ausschüttend	€ 330.342	€ 852.032	€ 933.208
ausgegebene und umlaufende Anteile	42.647	86.306	90.802
NIW je Anteil	€ 7,75	€ 9,87	€ 10,28
Institutional GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 572.158	£ 1.248.141	£ 1.623.041
ausgegebene und umlaufende Anteile	44.993	81.268	105.382
NIW je Anteil	£ 12,72	£ 15,36	£ 15,40

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021	Zum 31. Dez. 2020
	Diversified Income Fund (Fortsetzung)		
ausschüttend	£ 391.080	£ 601.893	£ 1.020.119
ausgegebene und umlaufende Anteile	67.375	81.620	133.743
NIW je Anteil	£ 5,80	£ 7,37	£ 7,63
Institutional MXN (Hedged): thesaurierend	MXN 270.310	MXN 299.232	MXN 5.392
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.863	2.831	53
NIW je Anteil	MXN 94,40	MXN 105,70	MXN 101,13
Institutional SEK (Hedged): thesaurierend	SEK 168.340	SEK 205.009	SEK 258.455
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.058	1.057	1.325
NIW je Anteil	SEK 159,10	SEK 193,88	SEK 195,03
Institutional SGD (Hedged): ausschüttend	SGD 43.716	SGD 79.938	SGD 30.850
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.366	7.873	2.946
NIW je Anteil	SGD 8,15	SGD 10,15	SGD 10,47
Investor: thesaurierend	\$ 53.597	\$ 83.045	\$ 63.761
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.492	5.806	4.440
NIW je Anteil	\$ 11,93	\$ 14,30	\$ 14,36
ausschüttend	\$ 89.559	\$ 69.026	\$ 43.507
ausgegebene und umlaufende Anteile	10.495	6.522	3.986
NIW je Anteil	\$ 8,53	\$ 10,58	\$ 10,92
Investor EUR (Hedged): thesaurierend	€ 21.418	€ 34.903	€ 29.190
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.477	1.960	1.618
NIW je Anteil	€ 14,50	€ 17,81	€ 18,04
ausschüttend	€ 10.066	€ 11.743	€ 8.787
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.375	1.260	905
NIW je Anteil	€ 7,32	€ 9,32	€ 9,70
Administrative: ausschüttend	\$ 87.885	\$ 143.334	\$ 144.682
ausgegebene und umlaufende Anteile	9.431	12.385	12.123
NIW je Anteil	\$ 9,32	\$ 11,57	\$ 11,94
Administrative AUD (Hedged): ausschüttend	AUD 2.794	AUD 3.812	AUD 4.404
ausgegebene und umlaufende Anteile	341	370	413
NIW je Anteil	AUD 8,18	AUD 10,30	AUD 10,65
Administrative EUR (Hedged): thesaurierend	€ 4.330	€ 10.014	€ 12.496
ausgegebene und umlaufende Anteile	306	575	707
NIW je Anteil	€ 14,16	€ 17,42	€ 17,67
Administrative GBP (Hedged): ausschüttend	£ 8.358	£ 12.610	£ 11.699
ausgegebene und umlaufende Anteile	972	1.168	1.048
NIW je Anteil	£ 8,60	£ 10,80	£ 11,17
Administrative JPY (Hedged): thesaurierend	¥ 354.957	¥ 47.222	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	438	47	k. A.
NIW je Anteil	¥ 811,00	¥ 1.002,00	k. A.
Administrative SEK (Hedged): thesaurierend	SEK 78	SEK 84	SEK 85
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	1
NIW je Anteil	SEK 80,78	SEK 98,94	SEK 100,08
Administrative SGD (Hedged): ausschüttend	SGD 55.693	SGD 101.850	SGD 136.614
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.640	9.757	12.691
NIW je Anteil	SGD 8,39	SGD 10,44	SGD 10,76

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021	Zum 31. Dez. 2020
	Diversified Income Fund (Fortsetzung)		
BM Retail: ausschüttend II	\$ 9	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	\$ 9,17	k. A.	k. A.
BN Retail: ausschüttend II	\$ 9	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	\$ 9,17	k. A.	k. A.
Class E: thesaurierend	\$ 655.637	\$ 1.113.069	\$ 1.457.105
ausgegebene und umlaufende Anteile	32.342	45.554	59.069
NIW je Anteil	\$ 20,27	\$ 24,43	\$ 24,67
ausschüttend	\$ 372.507	\$ 630.798	\$ 808.596
ausgegebene und umlaufende Anteile	33.038	45.041	55.978
NIW je Anteil	\$ 11,28	\$ 14,01	\$ 14,44
Class E CHF (Hedged): thesaurierend	CHF 7.655	CHF 9.701	CHF 7.607
ausgegebene und umlaufende Anteile	918	939	721
NIW je Anteil	CHF 8,34	CHF 10,33	CHF 10,55
Class E EUR (Hedged): thesaurierend	€ 1.292.425	€ 1.880.735	€ 1.798.793
ausgegebene und umlaufende Anteile	96.369	113.579	106.656
NIW je Anteil	€ 13,41	€ 16,56	€ 16,87
ausschüttend	€ 781.155	€ 1.366.978	€ 1.638.721
ausgegebene und umlaufende Anteile	88.377	121.500	139.927
NIW je Anteil	€ 8,84	€ 11,25	€ 11,71
Class E SGD (Hedged): ausschüttend	SGD 22.377	SGD 47.272	SGD 83.189
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.757	4.674	7.977
NIW je Anteil	SGD 8,12	SGD 10,11	SGD 10,43
H Institutional: thesaurierend	\$ 385.630	\$ 1.501.526	\$ 1.307.826
ausgegebene und umlaufende Anteile	21.717	70.674	61.420
NIW je Anteil	\$ 17,76	\$ 21,25	\$ 21,29
ausschüttend	\$ 118	\$ 26	\$ 27
ausgegebene und umlaufende Anteile	14	2	2,00
NIW je Anteil	\$ 8,61	\$ 10,70	\$ 11,04
M Retail: ausschüttend	\$ 150.260	\$ 246.412	\$ 348.905
ausgegebene und umlaufende Anteile	15.573	20.577	28.250
NIW je Anteil	\$ 9,65	\$ 11,98	\$ 12,35
ausschüttend II	\$ 183.635	\$ 311.977	\$ 452.614
ausgegebene und umlaufende Anteile	23.717	31.930	44.209
NIW je Anteil	\$ 7,74	\$ 9,77	\$ 10,24
M Retail AUD (Hedged): ausschüttend	AUD 49.591	AUD 83.307	AUD 148.786
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.574	7.442	12.851
NIW je Anteil	AUD 8,90	AUD 11,19	AUD 11,58
M Retail SGD (Hedged): ausschüttend II	k. A.	SGD 13	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	1	k. A.
NIW je Anteil	k. A.	SGD 9,82	k. A.
N Retail: ausschüttend II	\$ 9	\$ 10	\$ 10
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	1
NIW je Anteil	\$ 8,61	\$ 10,38	\$ 10,48
Class T: thesaurierend	\$ 25.356	\$ 40.854	\$ 31.960
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.318	3.086	2.382
NIW je Anteil	\$ 10,94	\$ 13,24	\$ 13,42

Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021	Zum 31. Dez. 2020
	Diversified Income Fund (Fortsetzung)		
ausschüttend	\$ 6.829	\$ 9.630	\$ 9.265
ausgegebene und umlaufende Anteile	771	876	817
NIW je Anteil	\$ 8,85	\$ 11,00	\$ 11,34
Class T EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 36.445	€ 53.705	€ 56.537
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.883	4.616	4.752
NIW je Anteil	€ 9,38	€ 11,63	€ 11,90
ausschüttend	€ 19.507	€ 28.295	€ 35.099
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.576	2.937	3.500
NIW je Anteil	€ 7,57	€ 9,63	€ 10,03
Class W:			
thesaurierend	\$ 64.400	\$ 120.525	\$ 46.301
ausgegebene und umlaufende Anteile	7.380	11.579	4.453
NIW je Anteil	\$ 8,73	\$ 10,41	\$ 10,40
ausschüttend	\$ 45.458	\$ 137.527	\$ 36.531
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.672	13.806	3.555
NIW je Anteil	\$ 8,01	\$ 9,96	\$ 10,28
W Class CAD (Hedged):			
thesaurierend	k. A.	CAD 14	CAD 14
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	1	1
NIW je Anteil	k. A.	CAD 10,38	CAD 10,39
Class W CHF (Hedged):			
thesaurierend	CHF 10.994	CHF 13.719	CHF 12.711
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.317	1.339	1.229
NIW je Anteil	CHF 8,35	CHF 10,24	CHF 10,35
ausschüttend	CHF 699	CHF 1.588	CHF 10
ausgegebene und umlaufende Anteile	91	162	1
NIW je Anteil	CHF 7,67	CHF 9,80	CHF 10,23
Class W EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 11.937	€ 15.286	€ 10.643
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.420	1.488	1.028
NIW je Anteil	€ 8,40	€ 10,27	€ 10,35
ausschüttend	€ 3.382	€ 6.737	€ 7.733
ausgegebene und umlaufende Anteile	438	685	756
NIW je Anteil	€ 7,72	€ 9,83	€ 10,23
Class W GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 2.089	£ 2.371	£ 420
ausgegebene und umlaufende Anteile	243	229	40
NIW je Anteil	£ 8,59	£ 10,36	£ 10,38
ausschüttend	£ 2.895	£ 3.547	£ 767
ausgegebene und umlaufende Anteile	367	358	75
NIW je Anteil	£ 7,89	£ 9,92	£ 10,26
Class W SGD (Hedged):			
ausschüttend	SGD 3.079	SGD 4.762	SGD 3.397
ausgegebene und umlaufende Anteile	385	477	330
NIW je Anteil	SGD 8,00	SGD 9,97	SGD 10,28
	Diversified Income Duration Hedged Fund		
Nettvermögen	\$ 564.684	\$ 1.305.365	\$ 1.486.931
Institutional:			
thesaurierend	\$ 23.243	\$ 64.311	\$ 30.325
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.617	4.288	2.073
NIW je Anteil	\$ 14,38	\$ 15,00	\$ 14,63

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021	Zum 31. Dez. 2020
	Diversified Income Duration Hedged Fund (Fortsetzung)		
ausschüttend	k. A.	\$ 3.462	\$ 2.258
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	326	212
NIW je Anteil	k. A.	\$ 10,63	\$ 10,65
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 87.225	€ 165.664	€ 96.172
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.863	12.228	7.219
NIW je Anteil	€ 12,71	€ 13,55	€ 13,32
ausschüttend II	€ 9.995	€ 40.816	€ 41.836
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.372	5.012	5.045
NIW je Anteil	€ 7,29	€ 8,14	€ 8,29
Institutional GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 182.935	£ 312.905	£ 443.936
ausgegebene und umlaufende Anteile	13.134	21.396	31.048
NIW je Anteil	£ 13,93	£ 14,62	£ 14,30
ausschüttend	£ 63.760	£ 176.678	£ 238.667
ausgegebene und umlaufende Anteile	7.894	19.855	26.610
NIW je Anteil	£ 8,08	£ 8,90	£ 8,97
Investor:			
thesaurierend	\$ 5.125	\$ 11.010	\$ 10.807
ausgegebene und umlaufende Anteile	428	878	880
NIW je Anteil	\$ 11,98	\$ 12,54	\$ 12,28
Class E:			
thesaurierend	\$ 24.033	\$ 46.891	\$ 38.133
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.054	3.805	3.145
NIW je Anteil	\$ 11,70	\$ 12,32	\$ 12,13
ausschüttend	\$ 33.306	\$ 38.488	\$ 28.229
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.579	3.808	2.785
NIW je Anteil	\$ 9,30	\$ 10,11	\$ 10,13
Class E EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 54.593	€ 184.920	€ 185.348
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.696	14.788	14.936
NIW je Anteil	€ 11,63	€ 12,50	€ 12,41
ausschüttend	€ 18.931	€ 29.006	€ 39.600
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.511	3.466	4.678
NIW je Anteil	€ 7,54	€ 8,37	€ 8,46
	Diversified Income ESG Fund		
Nettvermögen	\$ 9.854	k. A.	k. A.
Institutional:			
thesaurierend	\$ 9.367	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	947	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	\$ 9,89	k. A.	k. A.
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 226	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	23	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	€ 9,76	k. A.	k. A.
Institutional GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 188	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	19	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	£ 9,83	k. A.	k. A.
Class E:			
thesaurierend	\$ 10	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	\$ 9,85	k. A.	k. A.
Class E EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 9	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	€ 9,73	k. A.	k. A.

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021	Zum 31. Dez. 2020
Nettovermögen	\$ 3.483.601	\$ 3.277.997	\$ 3.204.860
Institutional:	Dynamic Bond Fund		
thesaurierend	\$ 470.460	\$ 626.628	\$ 533.694
ausgegebene und umlaufende Anteile	34.671	42.473	36.253
NIW je Anteil	\$ 13,57	\$ 14,75	\$ 14,72
ausschüttend	\$ 81.771	\$ 100.397	\$ 50.835
ausgegebene und umlaufende Anteile	8.057	8.882	4.429
NIW je Anteil	\$ 10,15	\$ 11,30	\$ 11,48
Institutional CAD (Hedged):			
thesaurierend	CAD 11.952	CAD 15.351	CAD 17.931
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.186	1.398	1.635
NIW je Anteil	CAD 10,08	CAD 10,98	CAD 10,96
Institutional CHF (Hedged):			
thesaurierend	CHF 70.173	CHF 87.168	CHF 71.980
ausgegebene und umlaufende Anteile	7.073	7.873	6.448
NIW je Anteil	CHF 9,92	CHF 11,07	CHF 11,16
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 187.622	€ 348.406	€ 467.029
ausgegebene und umlaufende Anteile	15.837	26.481	35.268
NIW je Anteil	€ 11,85	€ 13,16	€ 13,24
ausschüttend	€ 11.318	€ 12.768	€ 10.018
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.283	1.272	974
NIW je Anteil	€ 8,82	€ 10,04	€ 10,29
Institutional GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 1.840.373	£ 887.562	£ 827.076
ausgegebene und umlaufende Anteile	152.611	67.216	62.634
NIW je Anteil	£ 12,06	£ 13,20	£ 13,20
ausschüttend	£ 94.155	£ 253.262	£ 242.182
ausgegebene und umlaufende Anteile	10.906	26.086	24.507
NIW je Anteil	£ 8,63	£ 9,71	£ 9,88
Institutional NOK (Hedged):			
thesaurierend	NOK 4.066	NOK 131.604	NOK 137.483
ausgegebene und umlaufende Anteile	337	9.965	10.428
NIW je Anteil	NOK 12,07	NOK 13,21	NOK 13,18
Institutional SEK (Hedged):			
thesaurierend	k. A.	SEK 24.943	SEK 502.097
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	237	4.761
NIW je Anteil	k. A.	SEK 105,17	SEK 105,47
Investor:			
thesaurierend	\$ 46.677	\$ 56.790	\$ 52.628
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.069	4.537	4.199
NIW je Anteil	\$ 11,47	\$ 12,52	\$ 12,53
ausschüttend	\$ 2.830	\$ 3.932	\$ 2.996
ausgegebene und umlaufende Anteile	312	389	292
NIW je Anteil	\$ 9,08	\$ 10,11	\$ 10,27
Investor EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 2.013	€ 5.744	€ 3.373
ausgegebene und umlaufende Anteile	200	512	298
NIW je Anteil	€ 10,08	€ 11,23	€ 11,34
Administrative:			
thesaurierend	\$ 21.094	\$ 29.563	\$ 31.246
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.659	2.128	2.242
NIW je Anteil	\$ 12,72	\$ 13,90	\$ 13,93
Administrative EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 1.170	€ 3.659	€ 4.758
ausgegebene und umlaufende Anteile	105	295	379
NIW je Anteil	€ 11,11	€ 12,40	€ 12,54
Administrative SEK (Hedged):			
thesaurierend	SEK 61.257	SEK 81.744	SEK 96.229
ausgegebene und umlaufende Anteile	597	718	838
NIW je Anteil	SEK 102,58	SEK 113,88	SEK 114,77

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021	Zum 31. Dez. 2020
Class E:	Dynamic Bond Fund (Fortsetzung)		
thesaurierend	\$ 69.989	\$ 92.812	\$ 74.125
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.354	7.680	6.092
NIW je Anteil	\$ 11,01	\$ 12,08	\$ 12,17
ausschüttend	\$ 14.979	\$ 19.242	\$ 19.575
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.615	1.862	1.866
NIW je Anteil	\$ 9,28	\$ 10,33	\$ 10,49
Class E CHF (Hedged):			
thesaurierend	CHF 8.868	CHF 10.761	CHF 11.815
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.000	1.078	1.164
NIW je Anteil	CHF 8,86	CHF 9,98	CHF 10,15
Class E EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 73.068	€ 138.697	€ 104.878
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.936	11.750	8.748
NIW je Anteil	€ 10,54	€ 11,80	€ 11,99
Class E GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 3.354	£ 3.820	£ 3.947
ausgegebene und umlaufende Anteile	318	328	336
NIW je Anteil	£ 10,55	£ 11,65	£ 11,76
G Retail EUR (Hedged):			
ausschüttend	€ 7.061	€ 8.905	€ 10.799
ausgegebene und umlaufende Anteile	896	992	1.174
NIW je Anteil	€ 7,88	€ 8,98	€ 9,20
H Institutional:			
thesaurierend	\$ 11.541	\$ 18.571	\$ 4.868
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.135	1.677	440
NIW je Anteil	\$ 10,17	\$ 11,08	\$ 11,07
ausschüttend	\$ 10	\$ 11	\$ 11
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	1
NIW je Anteil	\$ 9,12	\$ 10,16	\$ 10,32
Class R:			
thesaurierend	\$ 6.385	\$ 7.736	\$ 8.296
ausgegebene und umlaufende Anteile	577	642	689
NIW je Anteil	\$ 11,07	\$ 12,05	\$ 12,03
Class Z:			
thesaurierend	\$ 6.683	\$ 9.940	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	725	1.001	k. A.
NIW je Anteil	\$ 9,22	\$ 9,93	k. A.
Class Z AUD (Hedged):			
ausschüttend	AUD 27.023	AUD 36.313	AUD 34.486
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.938	3.513	3.276
NIW je Anteil	AUD 9,20	AUD 10,34	AUD 10,53
Nettovermögen	€ 5.115.170	€ 7.635.950	€ 5.128.926
Institutional:	Dynamic Multi-Asset Fund		
thesaurierend	€ 1.644.656	€ 2.765.020	€ 2.129.409
ausgegebene und umlaufende Anteile	137.719	198.997	153.874
NIW je Anteil	€ 11,94	€ 13,89	€ 13,84
ausschüttend II	€ 158.729	€ 238.007	€ 251.480
ausgegebene und umlaufende Anteile	14.419	18.212	18.963
NIW je Anteil	€ 11,01	€ 13,07	€ 13,26
Institutional CHF (Hedged):			
thesaurierend	CHF 3.063	CHF 5.282	CHF 4.488
ausgegebene und umlaufende Anteile	297	438	373
NIW je Anteil	CHF 10,31	CHF 12,06	CHF 12,04
Institutional GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 552.226	£ 576.557	£ 216.239
ausgegebene und umlaufende Anteile	43.745	39.733	15.034
NIW je Anteil	£ 12,62	£ 14,51	£ 14,38
ausschüttend	£ 33.675	£ 17.109	£ 610
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.025	1.337	48
NIW je Anteil	£ 11,13	£ 12,79	£ 12,68

Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

	Dynamic Multi-Asset Fund (Fortsetzung)		
	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021	Zum 31. Dez. 2020
Institutional ILS (Hedged):			
thesaurierend	ILS 4.206	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	423	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	ILS 9,93	k. A.	k. A.
Institutional SGD (Hedged):			
thesaurierend	SGD 109.428	SGD 27.017	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	12.486	2.702	k. A.
NIW je Anteil	SGD 8,76	SGD 10,00	k. A.
Institutional USD (Hedged):			
thesaurierend	\$ 156.343	\$ 281.670	\$ 175.228
ausgegebene und umlaufende Anteile	11.438	18.087	11.398
NIW je Anteil	\$ 13,67	\$ 15,57	\$ 15,37
ausschüttend II	\$ 4.450	\$ 5.074	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	531	512	k. A.
NIW je Anteil	\$ 8,38	\$ 9,92	k. A.
Investor:			
thesaurierend	€ 10.626	€ 11.030	€ 6.410
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.140	1.013	589
NIW je Anteil	€ 9,32	€ 10,89	€ 10,88
Investor USD (Hedged):			
thesaurierend	\$ 9	\$ 10	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	k. A.
NIW je Anteil	\$ 8,94	\$ 10,22	k. A.
BM Retail AUD (Hedged):			
ausschüttend II	AUD 12	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	AUD 9,19	k. A.	k. A.
BM Retail USD (Hedged):			
ausschüttend II	\$ 9	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	\$ 9,25	k. A.	k. A.
Class E:			
thesaurierend	€ 1.913.579	€ 2.955.626	€ 1.985.483
ausgegebene und umlaufende Anteile	171.934	225.981	150.907
NIW je Anteil	€ 11,13	€ 13,08	€ 13,16
ausschüttend	€ 4.679	€ 5.627	1.063
ausgegebene und umlaufende Anteile	506	517	97
NIW je Anteil	€ 9,25	€ 10,87	10,94
Class E USD (Hedged):			
thesaurierend	\$ 192.230	\$ 275.658	\$ 129.718
ausgegebene und umlaufende Anteile	16.657	20.756	9.795
NIW je Anteil	\$ 11,54	\$ 13,28	\$ 13,24
ausschüttend	\$ 32	\$ 10	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	4	1	k. A.
NIW je Anteil	\$ 8,84	\$ 10,18	k. A.
ausschüttend II	\$ 9	\$ 10	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	k. A.
NIW je Anteil	\$ 8,27	\$ 9,80	k. A.
H Institutional USD (Hedged):			
thesaurierend	\$ 2.298	\$ 8.850	\$ 70.265
ausgegebene und umlaufende Anteile	240	810	6.498
NIW je Anteil	\$ 9,58	\$ 10,93	\$ 10,81
M Retail AUD (Hedged):			
ausschüttend II	AUD 321	AUD 563	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	39	57	k. A.
NIW je Anteil	AUD 8,17	AUD 9,87	k. A.
M Retail SGD (Hedged):			
ausschüttend II	SGD 12.812	SGD 16.539	SGD 346
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.538	1.673	34
NIW je Anteil	SGD 8,33	SGD 9,89	SGD 10,16

	Dynamic Multi-Asset Fund (Fortsetzung)		
	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021	Zum 31. Dez. 2020
M Retail USD (Hedged):			
ausschüttend II	\$ 65.622	\$ 120.842	\$ 84.157
ausgegebene und umlaufende Anteile	7.183	11.077	7.457
NIW je Anteil	\$ 9,14	\$ 10,91	\$ 11,29
Class T:			
thesaurierend	€ 83.511	€ 118.172	€ 56.375
ausgegebene und umlaufende Anteile	8.130	9.750	4.605
NIW je Anteil	€ 10,27	€ 12,12	€ 12,24
Class T USD (Hedged):			
thesaurierend	\$ 3.396	\$ 618	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	399	63	k. A.
NIW je Anteil	\$ 8,51	\$ 9,83	k. A.
Class Z:			
thesaurierend	€ 151.534	€ 192.397	€ 76.639
ausgegebene und umlaufende Anteile	14.087	15.504	6.254
NIW je Anteil	€ 10,76	€ 12,41	€ 12,25
Emerging Local Bond Fund			
Nettovermögen	\$ 1.919.668	\$ 2.151.129	\$ 2.849.284
Institutional:			
thesaurierend	\$ 1.295.760	\$ 1.416.960	\$ 1.942.594
ausgegebene und umlaufende Anteile	102.499	104.910	132.226
NIW je Anteil	\$ 12,64	\$ 13,51	\$ 14,69
ausschüttend	\$ 67.645	\$ 77.715	\$ 94.610
ausgegebene und umlaufende Anteile	11.061	11.365	12.100
NIW je Anteil	\$ 6,12	\$ 6,84	\$ 7,82
Institutional CHF (Unhedged):			
thesaurierend	k. A.	CHF 397	CHF 491
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	44	51
NIW je Anteil	k. A.	CHF 9,06	CHF 9,56
Institutional EUR (Unhedged):			
thesaurierend	€ 172.199	€ 250.076	€ 165.027
ausgegebene und umlaufende Anteile	13.181	19.088	12.458
NIW je Anteil	€ 13,06	€ 13,10	€ 13,25
ausschüttend	€ 133.001	€ 123.817	€ 288.525
ausgegebene und umlaufende Anteile	20.143	17.869	39.179
NIW je Anteil	€ 6,60	€ 6,93	€ 7,36
Institutional GBP (Unhedged):			
thesaurierend	£ 3.791	£ 2.364	£ 2.910
ausgegebene und umlaufende Anteile	183	120	137
NIW je Anteil	£ 20,76	£ 19,70	£ 21,23
Investor:			
thesaurierend	\$ 19.075	\$ 38.617	\$ 24.099
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.001	3.779	2.159
NIW je Anteil	\$ 9,53	\$ 10,22	\$ 11,16
Investor EUR (Unhedged):			
thesaurierend	€ 698	€ 3.081	€ 3.074
ausgegebene und umlaufende Anteile	75	330	325
NIW je Anteil	€ 9,28	€ 9,33	€ 9,47
Class E:			
thesaurierend	\$ 35.736	\$ 39.398	\$ 53.089
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.249	3.319	4.070
NIW je Anteil	\$ 11,00	\$ 11,87	\$ 13,04
ausschüttend	\$ 12.985	\$ 15.964	\$ 22.053
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.266	2.492	3.012
NIW je Anteil	\$ 5,73	\$ 6,41	\$ 7,32
Class E EUR (Unhedged):			
thesaurierend	€ 65.014	€ 77.057	€ 102.405
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.579	5.359	6.974
NIW je Anteil	€ 14,20	€ 14,38	€ 14,68
ausschüttend	€ 1.510	€ 1.782	€ 2.018
ausgegebene und umlaufende Anteile	168	189	202
NIW je Anteil	€ 8,97	€ 9,41	€ 10,00
H Institutional:			
thesaurierend	\$ 48.210	\$ 10	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.416	1	k. A.
NIW je Anteil	\$ 8,90	\$ 9,52	k. A.

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021	Zum 31. Dez. 2020
Emerging Local Bond Fund (Fortsetzung)			
Class Z:			
ausschüttend	\$ 38.228	\$ 40.482	\$ 21.833
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.218	4.941	2.331
NIW je Anteil	\$ 7,33	\$ 8,19	\$ 9,37
Emerging Local Bond ESG Fund			
Nettovermögen	\$ 6.609	k. A.	k. A.
Institutional:			
thesaurierend	\$ 5.169	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	489	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	\$ 10,57	k. A.	k. A.
ausschüttend	\$ 11	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	\$ 10,34	k. A.	k. A.
Institutional EUR (Unhedged):			
thesaurierend	€ 9	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	€ 10,02	k. A.	k. A.
ausschüttend	€ 9	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	€ 9,81	k. A.	k. A.
Investor:			
thesaurierend	\$ 11	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	\$ 10,56	k. A.	k. A.
ausschüttend	\$ 11	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	\$ 10,34	k. A.	k. A.
Investor EUR (Unhedged):			
thesaurierend	€ 9	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	€ 10,01	k. A.	k. A.
ausschüttend	€ 9	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	€ 9,81	k. A.	k. A.
Class E:			
thesaurierend	\$ 11	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	\$ 10,53	k. A.	k. A.
ausschüttend	\$ 11	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	\$ 10,34	k. A.	k. A.
Class E EUR (Unhedged):			
thesaurierend	€ 9	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	€ 9,98	k. A.	k. A.
ausschüttend	€ 9	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	€ 9,80	k. A.	k. A.
Class Z:			
thesaurierend	\$ 1.329	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	123	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	\$ 10,77	k. A.	k. A.
Emerging Markets Bond Fund			
Nettovermögen	\$ 3.305.979	\$ 4.714.744	\$ 5.263.015
Institutional:			
thesaurierend	\$ 1.097.175	\$ 1.578.727	\$ 1.855.635
ausgegebene und umlaufende Anteile	24.303	28.997	33.297
NIW je Anteil	\$ 45,15	\$ 54,45	\$ 55,73
ausschüttend	\$ 56.849	\$ 92.620	\$ 79.496
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.860	4.961	3.984
NIW je Anteil	\$ 14,73	\$ 18,67	\$ 19,95

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021	Zum 31. Dez. 2020
Emerging Markets Bond Fund (Fortsetzung)			
Institutional CHF (Hedged):			
ausschüttend	CHF 77.505	CHF 97.681	CHF 101.703
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.390	5.215	5.020
NIW je Anteil	CHF 14,38	CHF 18,73	CHF 20,26
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 694.951	€ 695.028	€ 727.017
ausgegebene und umlaufende Anteile	19.643	15.897	16.095
NIW je Anteil	€ 35,38	€ 43,72	€ 45,17
ausschüttend	€ 401.157	€ 847.991	€ 768.610
ausgegebene und umlaufende Anteile	58.854	95.747	80.394
NIW je Anteil	€ 6,82	€ 8,86	€ 9,56
Institutional EUR (Unhedged):			
thesaurierend	€ 135.251	€ 164.246	€ 156.149
ausgegebene und umlaufende Anteile	12.028	12.905	12.896
NIW je Anteil	€ 11,24	€ 12,73	€ 12,11
Institutional GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 23.424	£ 26.418	£ 13.006
ausgegebene und umlaufende Anteile	997	922	442
NIW je Anteil	£ 23,50	£ 28,67	£ 29,43
ausschüttend	£ 28.487	£ 41.458	£ 67.185
ausgegebene und umlaufende Anteile	8.167	9.258	13.988
NIW je Anteil	£ 3,49	£ 4,48	£ 4,80
Institutional PLN (Hedged):			
ausschüttend	k. A.	PLN 95.531	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	9.927	k. A.
NIW je Anteil	k. A.	PLN 9,62	k. A.
Institutional SGD (Hedged):			
thesaurierend	SGD 31.394	SGD 32.296	SGD 16.392
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.178	2.703	1.340
NIW je Anteil	SGD 9,88	SGD 11,95	SGD 12,23
Investor:			
thesaurierend	\$ 3.988	\$ 7.210	\$ 7.681
ausgegebene und umlaufende Anteile	95	142	147
NIW je Anteil	\$ 42,01	\$ 50,84	\$ 52,22
Investor EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 3.248	€ 4.103	€ 4.086
ausgegebene und umlaufende Anteile	398	406	390
NIW je Anteil	€ 8,16	€ 10,11	€ 10,48
Administrative:			
thesaurierend	\$ 22.981	\$ 34.503	\$ 34.306
ausgegebene und umlaufende Anteile	560	693	670
NIW je Anteil	\$ 41,06	\$ 49,77	\$ 51,20
BM Retail:			
ausschüttend II	\$ 9	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	\$ 9,11	k. A.	k. A.
Class E:			
thesaurierend	\$ 114.186	\$ 165.453	\$ 185.616
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.933	3.492	3.793
NIW je Anteil	\$ 38,93	\$ 47,38	\$ 48,93
ausschüttend	\$ 61.547	\$ 109.051	\$ 151.156
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.932	9.691	12.574
NIW je Anteil	\$ 8,88	\$ 11,25	\$ 12,02
Class E EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 125.229	€ 187.716	€ 195.834
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.112	4.943	4.947
NIW je Anteil	€ 30,46	€ 37,98	€ 39,59
Class E SGD (Hedged):			
thesaurierend	SGD 10.020	SGD 11.604	SGD 12.729
ausgegebene und umlaufende Anteile	181	172	183
NIW je Anteil	SGD 55,23	SGD 67,40	SGD 69,62

Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021	Zum 31. Dez. 2020
Emerging Markets Bond Fund (Fortsetzung)			
H Institutional:			
thesaurierend	\$ 302.479	\$ 284.247	\$ 401.692
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.875	5.348	7.371
NIW je Anteil	\$ 44,00	\$ 53,15	\$ 54,50
ausschüttend	\$ 217	\$ 275	\$ 10
ausgegebene und umlaufende Anteile	29	29	1
NIW je Anteil	\$ 7,55	\$ 9,57	\$ 10,22
M Retail:			
ausschüttend	\$ 8.675	\$ 12.295	\$ 14.913
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.085	1.214	1.379
NIW je Anteil	\$ 8,00	\$ 10,13	\$ 10,82
ausschüttend II	\$ 3.190	\$ 3.720	\$ 6.538
ausgegebene und umlaufende Anteile	473	428	693
NIW je Anteil	\$ 6,75	\$ 8,68	\$ 9,44
M Retail AUD (Hedged):			
ausschüttend	AUD 1.510	AUD 7.264	AUD 9.306
ausgegebene und umlaufende Anteile	209	784	936
NIW je Anteil	AUD 7,22	AUD 9,27	AUD 9,94
Class Z:			
ausschüttend	\$ 5.279	\$ 6.317	\$ 6.442
ausgegebene und umlaufende Anteile	540	509	486
NIW je Anteil	\$ 9,78	\$ 12,41	\$ 13,26
Emerging Markets Bond ESG Fund			
Nettovermögen	\$ 2.492.475	\$ 2.635.769	\$ 1.441.457
Institutional:			
thesaurierend	\$ 640.128	\$ 650.604	\$ 482.367
ausgegebene und umlaufende Anteile	45.303	37.005	26.644
NIW je Anteil	\$ 14,13	\$ 17,58	\$ 18,10
ausschüttend	\$ 306.128	\$ 305.572	\$ 18.961
ausgegebene und umlaufende Anteile	40.679	31.166	1.806
NIW je Anteil	\$ 7,53	\$ 9,80	\$ 10,50
Institutional CHF (Hedged):			
thesaurierend	CHF 53.384	CHF 50.716	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.825	5.067	k. A.
NIW je Anteil	CHF 7,82	CHF 10,01	k. A.
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 1.011.465	€ 999.329	€ 566.203
ausgegebene und umlaufende Anteile	104.063	80.567	43.901
NIW je Anteil	€ 9,72	€ 12,40	€ 12,90
ausschüttend	€ 132.184	€ 192.797	€ 111.597
ausgegebene und umlaufende Anteile	19.921	21.737	11.631
NIW je Anteil	€ 6,64	€ 8,87	€ 9,59
Institutional GBP (Hedged):			
ausschüttend	£ 162.630	£ 80.974	£ 3.499
ausgegebene und umlaufende Anteile	22.478	8.479	341
NIW je Anteil	£ 7,24	£ 9,55	£ 10,26
Institutional GBP (Unhedged):			
ausschüttend	£ 3.960	£ 3.657	£ 7
ausgegebene und umlaufende Anteile	499	398	1
NIW je Anteil	£ 7,94	£ 9,19	£ 9,76
Investor NOK (Hedged):			
thesaurierend	NOK 5.222	NOK 6.610	NOK 7.902
ausgegebene und umlaufende Anteile	50	50	58
NIW je Anteil	NOK 103,95	NOK 131,59	NOK 136,26
Investor SEK (Hedged):			
thesaurierend	SEK 27.736	SEK 10.725	SEK 12.623
ausgegebene und umlaufende Anteile	292	89	100
NIW je Anteil	SEK 95,02	SEK 121,06	SEK 125,92
Administrative:			
thesaurierend	\$ 314	\$ 632	\$ 1.121
ausgegebene und umlaufende Anteile	37	59	102
NIW je Anteil	\$ 8,53	\$ 10,67	\$ 11,04

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021	Zum 31. Dez. 2020
Emerging Markets Bond ESG Fund (Fortsetzung)			
ausschüttend	\$ 718	\$ 992	\$ 293
ausgegebene und umlaufende Anteile	95	101	28
NIW je Anteil	\$ 7,53	\$ 9,81	\$ 10,50
Administrative SEK (Hedged):			
thesaurierend	SEK 105	SEK 85	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	k. A.
NIW je Anteil	SEK 77,61	SEK 99,05	k. A.
Class E:			
thesaurierend	\$ 924	\$ 1.531	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	120	158	k. A.
NIW je Anteil	\$ 7,71	\$ 9,68	k. A.
ausschüttend	\$ 676	\$ 868	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	94	92	k. A.
NIW je Anteil	\$ 7,23	\$ 9,41	k. A.
Class E EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 57.844	€ 129.837	€ 83.479
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.822	11.895	7.294
NIW je Anteil	€ 8,48	€ 10,92	€ 11,45
Emerging Markets Corporate Bond Fund			
Nettovermögen	\$ 168.986	\$ 212.894	\$ 261.236
Institutional:			
thesaurierend	\$ 8.279	\$ 9.507	\$ 20.306
ausgegebene und umlaufende Anteile	535	532	1.128
NIW je Anteil	\$ 15,48	\$ 17,88	\$ 18,01
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 102.077	€ 113.058	€ 126.871
ausgegebene und umlaufende Anteile	7.881	7.392	8.166
NIW je Anteil	€ 12,95	€ 15,29	€ 15,54
Class E:			
thesaurierend	\$ 15.703	\$ 22.756	\$ 22.272
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.342	1.668	1.607
NIW je Anteil	\$ 11,70	\$ 13,64	\$ 13,86
Class E CHF (Hedged):			
thesaurierend	CHF 10.121	CHF 14.255	CHF 16.710
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.048	1.235	1.410
NIW je Anteil	CHF 9,66	CHF 11,54	CHF 11,85
Class E EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 23.540	€ 32.022	€ 36.387
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.072	2.365	2.622
NIW je Anteil	€ 11,36	€ 13,54	€ 13,88
PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund			
Nettovermögen	\$ 205.131	\$ 290.475	\$ 220.309
Institutional:			
thesaurierend	\$ 25.166	\$ 48.615	\$ 13.910
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.449	4.383	1.214
NIW je Anteil	\$ 10,28	\$ 11,09	\$ 11,47
Institutional EUR (Partially Hedged):			
thesaurierend	€ 72.560	€ 212.680	€ 168.688
ausgegebene und umlaufende Anteile	7.427	19.839	15.309
NIW je Anteil	€ 9,77	€ 10,72	€ 11,02
Institutional GBP (Partially Hedged):			
ausschüttend	£ 760	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	81	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	£ 9,37	k. A.	k. A.
Class E EUR (Partially Hedged):			
thesaurierend	€ 9	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	€ 9,38	k. A.	k. A.

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021	Zum 31. Dez. 2020
PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund (Fortsetzung)			
Class Z:			
thesaurierend	\$ 101.602	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	10.102	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	\$ 10,06	k. A.	k. A.
Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund			
Nettovermögen	\$ 20.937	\$ 29.760	\$ 32.571
Institutional:			
thesaurierend	k. A.	\$ 114	\$ 139
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	8	10
NIW je Anteil	k. A.	\$ 14,02	\$ 14,44
Institutional EUR (Unhedged):			
thesaurierend	€ 6.154	€ 10.250	€ 7.119
ausgegebene und umlaufende Anteile	437	743	538
NIW je Anteil	€ 14,08	€ 13,80	€ 13,21
Class E:			
thesaurierend	\$ 4.388	\$ 5.195	\$ 6.144
ausgegebene und umlaufende Anteile	371	417	474
NIW je Anteil	\$ 11,84	\$ 12,47	\$ 12,97
Class E EUR (Unhedged):			
thesaurierend	€ 9.351	€ 11.252	€ 14.366
ausgegebene und umlaufende Anteile	700	852	1.126
NIW je Anteil	€ 13,36	€ 13,20	€ 12,76
PIMCO ESG Income Fund			
Nettovermögen	\$ 237.961	\$ 125.087	k. A.
Institutional:			
thesaurierend	\$ 23.414	\$ 5.465	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.486	541	k. A.
NIW je Anteil	\$ 9,42	\$ 10,10	k. A.
ausschüttend	\$ 3.575	\$ 3.756	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	393	375	k. A.
NIW je Anteil	\$ 9,10	\$ 10,02	k. A.
Institutional AUD (Hedged):			
ausschüttend	AUD 57.036	AUD 14	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.338	1	k. A.
NIW je Anteil	AUD 9,00	AUD 10,00	k. A.
Institutional CHF (Hedged):			
thesaurierend	CHF 7.316	CHF 692	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	803	69	k. A.
NIW je Anteil	CHF 9,11	CHF 10,02	k. A.
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 105.509	€ 72.025	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	11.509	7.175	k. A.
NIW je Anteil	€ 9,17	€ 10,04	k. A.
ausschüttend	€ 1.925	€ 223	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	217	22	k. A.
NIW je Anteil	€ 8,85	€ 9,95	k. A.
Institutional GBP (Hedged):			
ausschüttend	£ 405	£ 482	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	44	48	k. A.
NIW je Anteil	£ 9,00	£ 9,98	k. A.
Institutional SEK (Hedged):			
thesaurierend	SEK 122.486	SEK 77.208	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.335	772	k. A.
NIW je Anteil	SEK 91,73	SEK 99,96	k. A.
Institutional SGD (Hedged):			
ausschüttend	SGD 367	SGD 366	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	40	36	k. A.
NIW je Anteil	SGD 9,09	SGD 10,02	k. A.

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021	Zum 31. Dez. 2020
PIMCO ESG Income Fund (Fortsetzung)			
Administrative SEK (Hedged):			
thesaurierend	SEK 79.369	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	816	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	SEK 97,22	k. A.	k. A.
Class E:			
thesaurierend	\$ 1.433	\$ 285	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	155	28	k. A.
NIW je Anteil	\$ 9,28	\$ 10,04	k. A.
ausschüttend	\$ 387	\$ 20	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	43	2	k. A.
NIW je Anteil	\$ 9,10	\$ 10,01	k. A.
Class E CHF (Hedged):			
ausschüttend	CHF 9	CHF 9	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	k. A.
NIW je Anteil	CHF 8,81	CHF 9,94	k. A.
Class E EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 4.811	€ 1.113	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	535	112	k. A.
NIW je Anteil	€ 8,99	€ 9,94	k. A.
ausschüttend	€ 1.016	€ 256	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	115	26	k. A.
NIW je Anteil	€ 8,86	€ 9,96	k. A.
Class R AUD (Hedged):			
ausschüttend	AUD 31.770	AUD 29.726	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.530	2.973	k. A.
NIW je Anteil	AUD 9,00	AUD 10,00	k. A.
Euro Bond Fund			
Nettovermögen	€ 1.913.275	€ 2.574.129	€ 3.243.455
Institutional:			
thesaurierend	€ 1.386.127	€ 1.926.406	€ 2.235.581
ausgegebene und umlaufende Anteile	64.252	73.731	82.583
NIW je Anteil	€ 21,57	€ 26,13	€ 27,07
ausschüttend	€ 68.589	€ 92.872	€ 378.659
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.956	5.474	21.418
NIW je Anteil	€ 13,84	€ 16,97	€ 17,68
Institutional CHF (Hedged):			
thesaurierend	CHF 313.292	CHF 351.467	CHF 307.434
ausgegebene und umlaufende Anteile	10.631	9.789	8.243
NIW je Anteil	CHF 29,47	CHF 35,91	CHF 37,30
Investor:			
thesaurierend	€ 16.885	€ 23.320	€ 38.680
ausgegebene und umlaufende Anteile	841	956	1.524
NIW je Anteil	€ 20,08	€ 24,41	€ 25,38
ausschüttend	k. A.	€ 236	€ 679
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	15	40
NIW je Anteil	k. A.	€ 16,28	€ 16,97
Administrative:			
thesaurierend	k. A.	€ 2.579	€ 5.248
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	110	215
NIW je Anteil	k. A.	€ 23,48	€ 24,45
Class E:			
thesaurierend	€ 101.050	€ 151.006	€ 241.554
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.451	6.666	10.200
NIW je Anteil	€ 18,54	€ 22,65	€ 23,68
ausschüttend	€ 23.340	€ 38.508	€ 58.802
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.337	3.146	4.596
NIW je Anteil	€ 9,99	€ 12,24	€ 12,79
Euro Credit Fund			
Nettovermögen	€ 610.008	€ 1.017.163	€ 1.150.058
Institutional:			
thesaurierend	€ 348.784	€ 743.335	€ 854.429
ausgegebene und umlaufende Anteile	24.516	43.513	49.448
NIW je Anteil	€ 14,23	€ 17,08	€ 17,28

Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021	Zum 31. Dez. 2020
Euro Credit Fund (Fortsetzung)			
ausschüttend II	€ 16.940	€ 80.562	€ 110.981
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.879	7.303	9.831
NIW je Anteil	€ 9,02	€ 11,03	€ 11,29
Class E:			
thesaurierend	€ 11.194	€ 18.325	€ 24.907
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.001	1.353	1.802
NIW je Anteil	€ 11,18	€ 13,54	€ 13,82
H Institutional:			
thesaurierend	€ 232.926	€ 173.091	€ 156.377
ausgegebene und umlaufende Anteile	27.156	16.823	15.036
NIW je Anteil	€ 8,58	€ 10,29	€ 10,40
ausschüttend II	€ 164	€ 1.850	€ 3.364
ausgegebene und umlaufende Anteile	20	186	331
NIW je Anteil	€ 8,14	€ 9,93	€ 10,16
Euro Income Bond Fund			
Nettovermögen	€ 1.352.980	€ 2.482.304	€ 3.182.867
Institutional:			
thesaurierend	€ 332.727	€ 895.043	€ 882.179
ausgegebene und umlaufende Anteile	23.944	56.691	55.950
NIW je Anteil	€ 13,90	€ 15,79	€ 15,77
ausschüttend	€ 79.523	€ 128.548	€ 215.485
ausgegebene und umlaufende Anteile	8.533	11.833	19.471
NIW je Anteil	€ 9,32	€ 10,86	€ 11,07
Investor:			
thesaurierend	€ 10.138	€ 14.129	€ 6.268
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.136	1.388	615
NIW je Anteil	€ 8,93	€ 10,18	€ 10,20
ausschüttend	€ 8.520	€ 10.907	€ 19.825
ausgegebene und umlaufende Anteile	939	1.027	1.826
NIW je Anteil	€ 9,08	€ 10,62	€ 10,86
Class E:			
thesaurierend	€ 540.713	€ 856.874	€ 1.263.972
ausgegebene und umlaufende Anteile	43.285	59.839	87.596
NIW je Anteil	€ 12,49	€ 14,32	€ 14,43
ausschüttend	€ 347.514	€ 527.452	€ 731.652
ausgegebene und umlaufende Anteile	41.763	53.871	72.655
NIW je Anteil	€ 8,32	€ 9,79	€ 10,07
ausschüttend Q	k. A.	€ 3.868	€ 4.485
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	406	455
NIW je Anteil	k. A.	€ 9,53	€ 9,86
Class T:			
thesaurierend	€ 24.746	€ 32.571	€ 41.015
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.573	2.943	3.663
NIW je Anteil	€ 9,62	€ 11,07	€ 11,20
ausschüttend	€ 9.099	€ 12.914	€ 17.986
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.234	1.482	1.998
NIW je Anteil	€ 7,38	€ 8,72	€ 9,00
Euro Long Average Duration Fund			
Nettovermögen	€ 110.048	€ 160.601	€ 182.461
Institutional:			
thesaurierend	€ 110.048	€ 160.601	€ 182.461
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.786	5.426	5.656
NIW je Anteil	€ 19,02	€ 29,60	€ 32,26
Euro Short-Term Fund			
Nettovermögen	€ 353.095	€ 629.859	€ 807.538
Institutional:			
thesaurierend	€ 339.031	€ 616.693	€ 789.499
ausgegebene und umlaufende Anteile	28.689	51.558	65.792
NIW je Anteil	€ 11,82	€ 11,96	€ 12,00

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021	Zum 31. Dez. 2020
Euro Short-Term Fund (Fortsetzung)			
Class E:			
thesaurierend	€ 14.064	€ 13.166	€ 18.039
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.350	1.239	1.679
NIW je Anteil	€ 10,42	€ 10,63	€ 10,74
PIMCO European High Yield Bond Fund			
Nettovermögen	€ 174.162	€ 170.489	€ 162.061
Institutional:			
thesaurierend	€ 32.875	€ 12.500	€ 9.610
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.379	1.159	918
NIW je Anteil	€ 9,73	€ 10,79	€ 10,46
Class E:			
thesaurierend	€ 10	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	€ 10,00	k. A.	k. A.
Class Z:			
thesaurierend	€ 141.277	€ 157.989	€ 152.451
ausgegebene und umlaufende Anteile	14.301	14.501	14.501
NIW je Anteil	€ 9,88	€ 10,90	€ 10,51
PIMCO European Short-Term Opportunities Fund			
Nettovermögen	€ 211.172	€ 395.491	€ 350.749
Institutional:			
thesaurierend	€ 127.942	€ 254.925	€ 259.542
ausgegebene und umlaufende Anteile	11.637	22.466	22.487
NIW je Anteil	€ 10,99	€ 11,35	€ 11,54
Class E:			
thesaurierend	€ 7.775	€ 4.368	€ 6.217
ausgegebene und umlaufende Anteile	826	447	623
NIW je Anteil	€ 9,42	€ 9,77	€ 9,99
H Institutional:			
thesaurierend	€ 75.455	€ 136.198	€ 84.990
ausgegebene und umlaufende Anteile	7.907	13.806	8.456
NIW je Anteil	€ 9,54	€ 9,87	€ 10,05
Global Advantage Fund			
Nettovermögen	\$ 410.459	\$ 521.067	\$ 524.284
Institutional:			
thesaurierend	\$ 7.716	\$ 24.968	\$ 32.718
ausgegebene und umlaufende Anteile	582	1.630	2.070
NIW je Anteil	\$ 13,28	\$ 15,32	\$ 15,81
Institutional CHF (Partially Hedged):			
ausschüttend	CHF 111.046	CHF 132.681	CHF 136.133
ausgegebene und umlaufende Anteile	12.487	12.823	12.809
NIW je Anteil	CHF 8,89	CHF 10,35	CHF 10,63
Institutional EUR (Partially Hedged):			
thesaurierend	€ 203.446	€ 237.602	€ 215.680
ausgegebene und umlaufende Anteile	15.828	16.656	15.249
NIW je Anteil	€ 12,85	€ 14,26	€ 14,14
Institutional GBP (Partially Hedged):			
thesaurierend	k. A.	£ 182	£ 162
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	14	12
NIW je Anteil	k. A.	£ 13,42	£ 13,45
Institutional NOK (Partially Hedged):			
thesaurierend	NOK 577.381	NOK 625.501	NOK 526.754
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.099	4.093	3.462
NIW je Anteil	NOK 140,84	NOK 152,81	NOK 152,16
E Class EUR (Partially Hedged):			
thesaurierend	€ 6.540	€ 8.002	€ 9.744
ausgegebene und umlaufende Anteile	576	629	764
NIW je Anteil	€ 11,36	€ 12,73	€ 12,75

	Zum	Zum	Zum
	31. Dez. 2022	31. Dez. 2021	31. Dez. 2020
Nettovermögen	\$ 11.420.112	\$ 14.038.846	\$ 16.302.309
Institutional:		Global Bond Fund	
thesaurierend	\$ 3.410.090	\$ 3.999.850	\$ 4.781.849
ausgegebene und umlaufende Anteile	107.593	111.904	131.859
NIW je Anteil	\$ 31,69	\$ 35,74	\$ 36,26
ausschüttend	\$ 172.513	\$ 203.191	\$ 241.431
ausgegebene und umlaufende Anteile	9.898	10.136	11.685
NIW je Anteil	\$ 17,43	\$ 20,05	\$ 20,66
Institutional (Currency Exposure):			
thesaurierend	\$ 326.665	\$ 328.710	\$ 413.925
ausgegebene und umlaufende Anteile	11.261	9.512	11.412
NIW je Anteil	\$ 29,01	\$ 34,56	\$ 36,27
ausschüttend	\$ 19.875	\$ 26.341	\$ 44.078
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.080	1.178	1.848
NIW je Anteil	\$ 18,41	\$ 22,37	\$ 23,86
Institutional CAD (Hedged):			
thesaurierend	CAD 54.563	CAD 72.089	CAD 83.688
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.395	6.309	7.213
NIW je Anteil	CAD 10,11	CAD 11,43	CAD 11,60
Institutional CHF (Hedged):			
thesaurierend	CHF 440.925	CHF 552.547	CHF 464.413
ausgegebene und umlaufende Anteile	14.706	15.928	13.054
NIW je Anteil	CHF 29,98	CHF 34,69	CHF 35,58
ausschüttend	CHF 175.781	CHF 218.701	CHF 213.078
ausgegebene und umlaufende Anteile	10.095	10.645	9.953
NIW je Anteil	CHF 17,41	CHF 20,54	CHF 21,41
Institutional EUR			
(Currency Exposure):			
thesaurierend	€ 190.480	€ 139.337	€ 163.042
ausgegebene und umlaufende Anteile	14.810	9.692	11.624
NIW je Anteil	€ 12,86	€ 14,38	€ 14,03
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 1.974.600	€ 2.453.258	€ 2.491.097
ausgegebene und umlaufende Anteile	78.287	84.453	83.802
NIW je Anteil	€ 25,22	€ 29,05	€ 29,73
ausschüttend	€ 512.652	€ 628.774	€ 766.678
ausgegebene und umlaufende Anteile	32.355	33.781	39.612
NIW je Anteil	€ 15,84	€ 18,61	€ 19,35
Institutional GBP			
(Currency Exposure):			
thesaurierend	£ 3.343	£ 3.600	£ 4.429
ausgegebene und umlaufende Anteile	313	319	377
NIW je Anteil	£ 10,68	£ 11,30	£ 11,75
Institutional GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 162.896	£ 198.000	£ 160.075
ausgegebene und umlaufende Anteile	7.879	8.429	6.703
NIW je Anteil	£ 20,68	£ 23,49	£ 23,88
ausschüttend	£ 132.242	£ 191.729	£ 254.507
ausgegebene und umlaufende Anteile	10.904	13.574	17.444
NIW je Anteil	£ 12,13	£ 14,13	£ 14,59

	Zum	Zum	Zum
	31. Dez. 2022	31. Dez. 2021	31. Dez. 2020
		Global Bond Fund (Fortsetzung)	
Institutional ILS (Hedged):			
thesaurierend	k. A.	ILS 304	ILS 331
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	18	19
NIW je Anteil	k. A.	ILS 16,75	ILS 17,09
Institutional NOK (Hedged):			
thesaurierend	NOK 2.918.045	NOK 4.130.842	NOK 3.542.383
ausgegebene und umlaufende Anteile	14.215	17.688	14.946
NIW je Anteil	NOK 205,28	NOK 223,55	NOK 237,01
Institutional NZD (Hedged):			
ausschüttend	NZD 167.929	NZD 309.397	NZD 250.817
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.162	6.643	5.230
NIW je Anteil	NZD 40,35	NZD 46,57	NZD 47,96
Institutional SEK (Hedged):			
thesaurierend	SEK 1.120.588	SEK 1.219.998	SEK 1.176.107
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.712	5.426	5.129
NIW je Anteil	SEK 196,17	SEK 224,86	SEK 229,29
Institutional SGD (Hedged):			
thesaurierend	SGD 217.237	SGD 174.944	SGD 176.007
ausgegebene und umlaufende Anteile	12.665	9.030	8.960
NIW je Anteil	SGD 17,15	SGD 19,37	SGD 19,64
Investor:			
thesaurierend	\$ 94.643	\$ 135.136	\$ 195.058
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.244	4.092	5.801
NIW je Anteil	\$ 29,18	\$ 33,02	\$ 33,62
ausschüttend	\$ 28.517	\$ 7.773	\$ 9.885
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.948	462	570
NIW je Anteil	\$ 14,64	\$ 16,84	\$ 17,35
Investor (Currency Exposure):			
thesaurierend	k. A.	\$ 2.315	\$ 5.415
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	71	158
NIW je Anteil	k. A.	\$ 32,58	\$ 34,32
Investor CHF (Hedged):			
thesaurierend	CHF 145.814	CHF 188.770	CHF 283.165
ausgegebene und umlaufende Anteile	12.641	14.095	20.545
NIW je Anteil	CHF 11,53	CHF 13,39	CHF 13,78
Investor EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 75.495	€ 92.541	€ 83.112
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.189	3.382	2.958
NIW je Anteil	€ 23,68	€ 27,36	€ 28,10
Investor GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 5.437	£ 5.846	£ 6.089
ausgegebene und umlaufende Anteile	280	264	269
NIW je Anteil	£ 19,45	£ 22,17	£ 22,62
Investor NOK (Hedged):			
thesaurierend	NOK 23.662	NOK 28.765	NOK 32.011
ausgegebene und umlaufende Anteile	122	130	142
NIW je Anteil	NOK 193,71	NOK 221,16	NOK 225,22
Administrative:			
thesaurierend	\$ 9.565	\$ 15.922	\$ 23.302
ausgegebene und umlaufende Anteile	337	495	710
NIW je Anteil	\$ 28,38	\$ 32,16	\$ 32,80

Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

	Zum		Zum		Zum	
	31. Dez. 2022		31. Dez. 2021		31. Dez. 2020	
	Global Bond Fund (Fortsetzung)					
Administrative SEK (Hedged):						
thesaurierend	SEK	114.069	SEK	1.941		k. A.
ausgegebene und umlaufende		1.325		20		k. A.
Anteile						
NIW je Anteil	SEK	86,08	SEK	99,17		k. A.
Class E:						
thesaurierend	\$	326.703	\$	463.700	\$	550.753
ausgegebene und umlaufende		12.006		14.974		17.372
Anteile						
NIW je Anteil	\$	27,21	\$	30,97	\$	31,70
ausschüttend	\$	101.393	\$	117.421	\$	201.589
ausgegebene und umlaufende		8.054		8.111		13.511
Anteile						
NIW je Anteil	\$	12,59	\$	14,48	\$	14,92
Class E (Currency Exposure):						
thesaurierend	\$	34.705	\$	61.145	\$	84.089
ausgegebene und umlaufende		2.994		4.389		5.699
Anteile						
NIW je Anteil	\$	11,59	\$	13,93	\$	14,76
ausschüttend	\$	13.040	\$	16.440	\$	19.720
ausgegebene und umlaufende		1.324		1.374		1.545
Anteile						
NIW je Anteil	\$	9,85	\$	11,97	\$	12,76
Class E CHF (Hedged):						
thesaurierend	CHF	1.921	CHF	2.358	CHF	2.635
ausgegebene und umlaufende		215		226		244
Anteile						
NIW je Anteil	CHF	8,92	CHF	10,41	CHF	10,78
Class E EUR (Hedged):						
thesaurierend	€	685.427	€	959.543	€	1.168.524
ausgegebene und umlaufende		31.641		38.117		44.954
Anteile						
NIW je Anteil	€	21,66	€	25,17	€	25,99
ausschüttend	€	31.423	€	41.846	€	61.268
ausgegebene und umlaufende		3.613		4.097		5.769
Anteile						
NIW je Anteil	€	8,70	€	10,22	€	10,62
Class E NOK (Hedged):						
thesaurierend	k. A.		NOK	85		k. A.
ausgegebene und umlaufende				1		k. A.
Anteile						
NIW je Anteil	k. A.		NOK	99,69		k. A.
G Retail EUR (Hedged):						
ausschüttend	€	66.161	€	123.034	€	140.905
ausgegebene und umlaufende		7.543		11.955		13.167
Anteile						
NIW je Anteil	€	8,77	€	10,29	€	10,70
H Institutional:						
thesaurierend	\$	752.379	\$	835.136	\$	954.525
ausgegebene und umlaufende		24.551		24.124		27.130
Anteile						
NIW je Anteil	\$	30,65	\$	34,62	\$	35,18
ausschüttend	\$	2.035	\$	2.643	\$	3.905
ausgegebene und umlaufende		231		261		375
Anteile						
NIW je Anteil	\$	8,79	\$	10,11	\$	10,42
H Institutional (Currency Exposure):						
thesaurierend	\$	309.569	\$	756		k. A.
ausgegebene und umlaufende		37.885		78		k. A.
Anteile						
NIW je Anteil	\$	8,17	\$	9,75		k. A.
M Retail:						
ausschüttend II	\$	1.358	\$	1.742	\$	2.809
ausgegebene und umlaufende		153		168		260
Anteile						
NIW je Anteil	\$	8,89	\$	10,34	\$	10,80
M Retail HKD (Unhedged):						
ausschüttend II	HKD	5.118	HKD	8.307	HKD	11.626
ausgegebene und umlaufende		575		802		1.081
Anteile						
NIW je Anteil	HKD	8,91	HKD	10,35	HKD	10,76
M Retail SEK (Hedged):						
thesaurierend	k. A.		SEK	90		k. A.
ausgegebene und umlaufende				1		k. A.
Anteile						
NIW je Anteil	k. A.		SEK	99,56		k. A.

	Zum		Zum		Zum	
	31. Dez. 2022		31. Dez. 2021		31. Dez. 2020	
	Global Bond Fund (Fortsetzung)					
Class R EUR (Hedged):						
thesaurierend	€	5.591	€	6.442	€	5.196
ausgegebene und umlaufende		530		528		415
Anteile						
NIW je Anteil	€	10,56	€	12,19	€	12,51
Class R SEK (Hedged):						
thesaurierend	k. A.		k. A.		SEK	100
ausgegebene und umlaufende						1
Anteile						
NIW je Anteil	k. A.		k. A.		SEK	111,31
Class T:						
thesaurierend	\$	15.814	\$	26.245	\$	42.315
ausgegebene und umlaufende		1.487		2.163		3.396
Anteile						
NIW je Anteil	\$	10,63	\$	12,14	\$	12,46
ausschüttend	\$	3.040	\$	4.183	\$	5.274
ausgegebene und umlaufende		303		362		443
Anteile						
NIW je Anteil	\$	10,04	\$	11,54	\$	11,89
Class T EUR (Hedged):						
thesaurierend	€	14.560	€	19.104	€	25.635
ausgegebene und umlaufende		1.567		1.764		2.285
Anteile						
NIW je Anteil	€	9,29	€	10,83	€	11,22
Class W:						
thesaurierend	\$	24.415	\$	29.951	\$	21.207
ausgegebene und umlaufende		2.721		2.962		2.070
Anteile						
NIW je Anteil	\$	8,97	\$	10,11	\$	10,25
ausschüttend	\$	9.498	\$	9.066	\$	13.683
ausgegebene und umlaufende		1.106		919		1.345
Anteile						
NIW je Anteil	\$	8,59	\$	9,87	\$	10,17
Class W (Currency Exposure):						
thesaurierend	k. A.		\$	10	\$	10
ausgegebene und umlaufende				1		1
Anteile						
NIW je Anteil	k. A.		\$	10,00	\$	10,48
ausschüttend	k. A.		\$	10	\$	10
ausgegebene und umlaufende				1		1
Anteile						
NIW je Anteil	k. A.		\$	9,77	\$	10,41
Class W CHF (Hedged):						
thesaurierend	CHF	24.828	CHF	33.361	CHF	35.760
ausgegebene und umlaufende		2.884		3.352		3.508
Anteile						
NIW je Anteil	CHF	8,61	CHF	9,95	CHF	10,20
ausschüttend	CHF	705	CHF	740	CHF	9
ausgegebene und umlaufende		86		76		1
Anteile						
NIW je Anteil	CHF	8,24	CHF	9,72	CHF	10,12
Class W EUR (Hedged):						
thesaurierend	€	9.594	€	14.976	€	14.731
ausgegebene und umlaufende		1.106		1.500		1.444
Anteile						
NIW je Anteil	€	8,68	€	9,98	€	10,20
ausschüttend	€	2.352	€	2.251	€	1.740
ausgegebene und umlaufende		283		231		172
Anteile						
NIW je Anteil	€	8,30	€	9,75	€	10,14
Class W GBP (Hedged):						
thesaurierend	£	2.383	£	1.265	£	139
ausgegebene und umlaufende		268		126		14
Anteile						
NIW je Anteil	£	8,88	£	10,08	£	10,23
ausschüttend	£	5.877	£	9.060	£	8.773
ausgegebene und umlaufende		692		921		863
Anteile						
NIW je Anteil	£	8,49	£	9,84	£	10,16
Class W NOK (Hedged):						
thesaurierend	NOK	4.083	NOK	3.799		k. A.
ausgegebene und umlaufende		46		38		k. A.
Anteile						
NIW je Anteil	NOK	88,35	NOK	100,41		k. A.
Class W SEK (Hedged):						
thesaurierend	k. A.		SEK	89	SEK	91
ausgegebene und umlaufende				1		1
Anteile						
NIW je Anteil	k. A.		SEK	100,33	SEK	102,20

	Zum		Zum		Zum	
	31. Dez. 2022		31. Dez. 2021		31. Dez. 2020	
	Global Bond ESG Fund					
Nettovermögen	\$	3.106.190	\$	2.302.966	\$	1.509.594
Institutional:						
thesaurierend	\$	366.227	\$	300.944	\$	153.820
ausgegebene und umlaufende Anteile		34.584		25.077		12.640
NIW je Anteil	\$	10,59	\$	12,00	\$	12,17
ausschüttend	\$	65.549	\$	25.309	\$	19.510
ausgegebene und umlaufende Anteile		7.213		2.428		1.826
NIW je Anteil	\$	9,09	\$	10,43	\$	10,68
Institutional CHF (Hedged):						
thesaurierend	CHF	454.679	CHF	22.579	CHF	16.793
ausgegebene und umlaufende Anteile		49.550		2.115		1.534
NIW je Anteil	CHF	9,18	CHF	10,67	CHF	10,94
Institutional EUR						
(Currency Exposure):						
thesaurierend	€	3.933	€	856		k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile		444		86		k. A.
NIW je Anteil	€	8,85	€	9,96		k. A.
Institutional EUR (Hedged):						
thesaurierend	€	957.548	€	623.870	€	276.328
ausgegebene und umlaufende Anteile		101.940		57.390		24.851
NIW je Anteil	€	9,39	€	10,87	€	11,12
ausschüttend	€	92.352	€	111.407	€	165.370
ausgegebene und umlaufende Anteile		10.695		11.012		15.815
NIW je Anteil	€	8,63	€	10,12	€	10,46
Institutional GBP						
(Currency Exposure):						
ausschüttend	£	8		k. A.		k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile		1		k. A.		k. A.
NIW je Anteil	£	9,55		k. A.		k. A.
Institutional GBP (Hedged):						
thesaurierend	£	2.394	£	16.849	£	13.241
ausgegebene und umlaufende Anteile		266		1.634		1.264
NIW je Anteil	£	9,03	£	10,31	£	10,48
ausschüttend	£	84.397	£	75.165	£	43.778
ausgegebene und umlaufende Anteile		9.242		7.117		4.037
NIW je Anteil	£	9,13	£	10,56	£	10,84
Institutional GBP (Unhedged):						
ausschüttend	£	20.996	£	23.387	£	7
ausgegebene und umlaufende Anteile		2.240		2.448		1
NIW je Anteil	£	9,37	£	9,55	£	9,70
Institutional NOK (Hedged):						
thesaurierend	NOK	5.366.868	NOK	5.205.593	NOK	4.228.645
ausgegebene und umlaufende Anteile		531.175		450.696		360.891
NIW je Anteil	NOK	10,10	NOK	11,55	NOK	11,72
Institutional NZD (Hedged):						
ausschüttend	NZD	64.722	NZD	74.299	NZD	68.677
ausgegebene und umlaufende Anteile		6.755		6.732		6.078
NIW je Anteil	NZD	9,58	NZD	11,04	NZD	11,30
Institutional SEK (Hedged):						
thesaurierend	SEK	504.943	SEK	568.764		k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile		5.807		5.678		k. A.
NIW je Anteil	SEK	86,95	SEK	100,17		k. A.

	Zum		Zum		Zum	
	31. Dez. 2022		31. Dez. 2021		31. Dez. 2020	
	Global Bond ESG Fund (Fortsetzung)					
Investor:						
thesaurierend	\$	8.195	\$	12.127	\$	18.700
ausgegebene und umlaufende Anteile		811		1.055		1.600
NIW je Anteil	\$	10,10	\$	11,49	\$	11,69
Administrative:						
thesaurierend	k. A.		\$	2.318	\$	11
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.			208		1
NIW je Anteil	k. A.		\$	11,12	\$	11,34
ausschüttend	k. A.		\$	11	\$	11
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.			1		1
NIW je Anteil	k. A.		\$	10,82	\$	11,09
Class E:						
ausschüttend	\$	3.846	\$	2.115	\$	6.261
ausgegebene und umlaufende Anteile		408		196		565
NIW je Anteil	\$	9,42	\$	10,81	\$	11,08
Class E CHF (Hedged):						
thesaurierend	CHF	77		k. A.		k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile		8		k. A.		k. A.
NIW je Anteil	CHF	9,66		k. A.		k. A.
Class E EUR (Hedged):						
thesaurierend	€	38.263	€	48.847	€	44.524
ausgegebene und umlaufende Anteile		4.288		4.688		4.140
NIW je Anteil	€	8,92	€	10,42	€	10,76
Class Z AUD (Hedged):						
ausschüttend	AUD	356.037	AUD	250.833	AUD	98.588
ausgegebene und umlaufende Anteile		37.495		22.777		8.716
NIW je Anteil	AUD	9,50	AUD	11,01	AUD	11,31
Nettovermögen	\$	716.022	\$	911.707	\$	929.980
Institutional:						
thesaurierend	\$	420.156	\$	527.915	\$	493.644
ausgegebene und umlaufende Anteile		18.790		21.249		19.620
NIW je Anteil	\$	22,36	\$	24,84	\$	25,16
ausschüttend	\$	32.820	\$	52.506	\$	46.004
ausgegebene und umlaufende Anteile		2.206		3.117		2.652
NIW je Anteil	\$	14,88	\$	16,85	\$	17,35
Institutional EUR (Hedged):						
thesaurierend	€	45.032	€	23.841	€	35.120
ausgegebene und umlaufende Anteile		2.816		1.315		1.898
NIW je Anteil	€	15,99	€	18,13	€	18,50
Institutional GBP (Hedged):						
ausschüttend	k. A.			k. A.	£	210
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.			k. A.		20
NIW je Anteil	k. A.			k. A.	£	10,54
Investor:						
thesaurierend	\$	6.657	\$	17.194	\$	21.037
ausgegebene und umlaufende Anteile		316		732		881
NIW je Anteil	\$	21,07	\$	23,49	\$	23,88
Administrative:						
thesaurierend	\$	10.720	\$	12.451	\$	10.624
ausgegebene und umlaufende Anteile		525		546		458
NIW je Anteil	\$	20,41	\$	22,79	\$	23,19
Class E:						
ausschüttend	\$	23.336	\$	54.115	\$	46.592
ausgegebene und umlaufende Anteile		1.615		3.309		2.766
NIW je Anteil	\$	14,45	\$	16,36	\$	16,84
Class E (Currency Exposure):						
ausschüttend	\$	62.837	\$	81.361	\$	56.847
ausgegebene und umlaufende Anteile		7.858		8.142		5.213
NIW je Anteil	\$	8,00	\$	9,99	\$	10,91

Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021	Zum 31. Dez. 2020
Global Bond Ex-US Fund (Fortsetzung)			
H Institutional:			
thesaurierend	\$ 6.714	\$ 1.160	\$ 73.013
ausgegebene und umlaufende Anteile	667	104	6.428
NIW je Anteil	\$ 10,06	\$ 11,20	\$ 11,36
Class Z:			
thesaurierend	\$ 104.722	\$ 137.893	\$ 138.962
ausgegebene und umlaufende Anteile	10.957	13.049	13.049
NIW je Anteil	\$ 9,56	\$ 10,57	\$ 10,65
PIMCO Global Core Asset Allocation Fund			
Nettovermögen	\$ 750.076	\$ 1.035.021	\$ 702.430
Institutional:			
thesaurierend	\$ 30.140	\$ 37.389	\$ 45.298
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.526	1.571	2.116
NIW je Anteil	\$ 19,74	\$ 23,80	\$ 21,41
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 204.979	€ 352.099	€ 123.732
ausgegebene und umlaufende Anteile	11.632	16.474	6.469
NIW je Anteil	€ 17,62	€ 21,37	€ 19,13
Institutional GBP (Hedged):			
ausschüttend	£ 3.301	£ 4.301	£ 4.026
ausgegebene und umlaufende Anteile	331	345	349
NIW je Anteil	£ 9,99	£ 12,45	£ 11,55
Investor:			
thesaurierend	\$ 10.303	\$ 10.116	\$ 9.158
ausgegebene und umlaufende Anteile	704	571	573
NIW je Anteil	\$ 14,63	\$ 17,70	\$ 15,98
Class E:			
thesaurierend	\$ 32.627	\$ 40.303	\$ 33.696
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.942	1.966	1.806
NIW je Anteil	\$ 16,80	\$ 20,50	\$ 18,66
ausschüttend	\$ 13.011	\$ 13.372	\$ 8.100
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.448	1.172	749
NIW je Anteil	\$ 8,98	\$ 11,41	\$ 10,81
Class E EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 217.239	€ 230.733	€ 205.357
ausgegebene und umlaufende Anteile	14.494	12.541	12.325
NIW je Anteil	€ 14,99	€ 18,40	€ 16,66
ausschüttend	€ 49.389	€ 57.708	€ 42.548
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.071	5.551	4.342
NIW je Anteil	€ 8,14	€ 10,40	€ 9,80
H Institutional:			
thesaurierend	\$ 9	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	\$ 9,43	k. A.	k. A.
ausschüttend	\$ 9	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	\$ 9,18	k. A.	k. A.
Class Z:			
thesaurierend	\$ 156.684	\$ 199.594	\$ 145.959
ausgegebene und umlaufende Anteile	10.644	11.355	9.320
NIW je Anteil	\$ 14,72	\$ 17,58	\$ 15,66
Global High Yield Bond Fund			
Nettovermögen	\$ 3.102.868	\$ 5.169.160	\$ 5.403.543
Institutional:			
thesaurierend	\$ 579.939	\$ 844.967	\$ 1.065.384
ausgegebene und umlaufende Anteile	22.368	29.240	38.174
NIW je Anteil	\$ 25,93	\$ 28,90	\$ 27,91
ausschüttend	\$ 292.202	\$ 489.734	\$ 349.849
ausgegebene und umlaufende Anteile	29.927	42.937	30.507
NIW je Anteil	\$ 9,76	\$ 11,41	\$ 11,47

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021	Zum 31. Dez. 2020
Global High Yield Bond Fund Fortsetzung)			
Institutional CHF (Hedged):			
thesaurierend	CHF 22.915	CHF 38.082	CHF 40.299
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.439	2.089	2.265
NIW je Anteil	CHF 15,92	CHF 18,23	CHF 17,79
ausschüttend	CHF 3.237	CHF 16.630	CHF 18.324
ausgegebene und umlaufende Anteile	436	1.863	2.019
NIW je Anteil	CHF 7,43	CHF 8,93	CHF 9,08
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 725.182	€ 1.232.938	€ 1.149.182
ausgegebene und umlaufende Anteile	32.640	48.671	46.572
NIW je Anteil	€ 22,22	€ 25,33	€ 24,68
ausschüttend	€ 155.150	€ 119.724	€ 109.781
ausgegebene und umlaufende Anteile	15.853	10.243	9.253
NIW je Anteil	€ 9,79	€ 11,69	€ 11,86
Institutional GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 31.335	£ 239.206	£ 96.397
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.130	14.437	6.007
NIW je Anteil	£ 14,71	£ 16,57	£ 16,05
ausschüttend	£ 292.800	£ 557.487	£ 642.574
ausgegebene und umlaufende Anteile	59.445	95.775	109.465
NIW je Anteil	£ 4,93	£ 5,82	£ 5,87
Investor:			
thesaurierend	\$ 1.820	\$ 12.295	\$ 12.417
ausgegebene und umlaufende Anteile	149	902	940
NIW je Anteil	\$ 12,19	\$ 13,64	\$ 13,21
Investor EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 12.416	€ 5.703	€ 3.311
ausgegebene und umlaufende Anteile	583	234	139
NIW je Anteil	€ 21,30	€ 24,37	€ 23,83
Administrative:			
thesaurierend	\$ 30.795	\$ 50.855	\$ 47.282
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.276	1.881	1.802
NIW je Anteil	\$ 24,14	\$ 27,04	\$ 26,24
ausschüttend	\$ 21.259	\$ 32.985	\$ 29.675
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.225	2.956	2.644
NIW je Anteil	\$ 9,56	\$ 11,16	\$ 11,22
Administrative EUR (Hedged):			
ausschüttend	k. A.	€ 1.908	€ 2.201
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	196	223
NIW je Anteil	k. A.	€ 9,71	€ 9,85
Administrative GBP (Hedged):			
ausschüttend	k. A.	£ 1.111	£ 1.475
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	106	140
NIW je Anteil	k. A.	£ 10,44	£ 10,53
BM Retail:			
ausschüttend II	\$ 10	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	\$ 9,34	k. A.	k. A.
Class E:			
thesaurierend	\$ 129.353	\$ 186.558	\$ 210.078
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.776	7.407	8.558
NIW je Anteil	\$ 22,40	\$ 25,19	\$ 24,55
ausschüttend	\$ 109.532	\$ 151.015	\$ 224.794
ausgegebene und umlaufende Anteile	11.389	13.453	19.913
NIW je Anteil	\$ 9,62	\$ 11,23	\$ 11,29
Class E EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 224.727	€ 299.451	€ 288.006
ausgegebene und umlaufende Anteile	10.424	12.074	11.814
NIW je Anteil	€ 21,56	€ 24,80	€ 24,38
ausschüttend	€ 27.782	€ 38.159	€ 43.265
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.472	3.992	4.460
NIW je Anteil	€ 8,00	€ 9,56	€ 9,70

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021	Zum 31. Dez. 2020
Global High Yield Bond Fund (Fortsetzung)			
Class E GBP (Hedged):			
ausschüttend	£ 5.932	£ 7.285	£ 7.198
ausgegebene und umlaufende Anteile	572	595	583
NIW je Anteil	£ 10,38	£ 12,25	£ 12,36
Class E SGD (Hedged):			
ausschüttend	SGD 6.387	SGD 11.731	SGD 9.093
ausgegebene und umlaufende Anteile	711	1.116	860
NIW je Anteil	SGD 8,98	SGD 10,52	SGD 10,57
H Institutional:			
thesaurierend	\$ 218.500	\$ 82.082	\$ 240.370
ausgegebene und umlaufende Anteile	8.771	2.952	8.934
NIW je Anteil	\$ 24,91	\$ 27,81	\$ 26,91
ausschüttend	\$ 4.003	\$ 10.759	\$ 9.847
ausgegebene und umlaufende Anteile	462	1.064	968
NIW je Anteil	\$ 8,66	\$ 10,11	\$ 10,17
M Retail:			
ausschüttend	\$ 17.710	\$ 25.552	\$ 30.491
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.865	2.306	2.736
NIW je Anteil	\$ 9,50	\$ 11,08	\$ 11,14
ausschüttend II	\$ 35.654	\$ 107.627	\$ 49.638
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.652	11.857	5.358
NIW je Anteil	\$ 7,66	\$ 9,08	\$ 9,26
Class R:			
thesaurierend	\$ 2.617	\$ 73.221	\$ 73.682
ausgegebene und umlaufende Anteile	184	4.598	4.779
NIW je Anteil	\$ 14,25	\$ 15,92	\$ 15,42
Class T:			
thesaurierend	\$ 5.339	\$ 7.458	\$ 7.892
ausgegebene und umlaufende Anteile	448	554	599
NIW je Anteil	\$ 11,93	\$ 13,47	\$ 13,18
ausschüttend	\$ 1.796	\$ 2.373	\$ 2.703
ausgegebene und umlaufende Anteile	200	227	257
NIW je Anteil	\$ 8,96	\$ 10,46	\$ 10,52
Class T EUR (Hedged):			
thesaurierend	k. A.	€ 1.450	€ 1.448
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	130	132
NIW je Anteil	k. A.	€ 11,14	€ 11,00
Global Investment Grade Credit Fund			
Nettovermögen	\$ 10.538.341	\$ 17.154.925	\$ 28.178.170
Institutional:			
thesaurierend	\$ 2.618.560	\$ 3.806.107	\$ 5.463.978
ausgegebene und umlaufende Anteile	140.682	172.781	244.589
NIW je Anteil	\$ 18,61	\$ 22,03	\$ 22,34
ausschüttend	\$ 474.941	\$ 705.907	\$ 1.176.158
ausgegebene und umlaufende Anteile	44.276	53.902	86.159
NIW je Anteil	\$ 10,73	\$ 13,10	\$ 13,65
Institutional (Currency Exposure):			
thesaurierend	\$ 100.855	\$ 86.823	\$ 135.818
ausgegebene und umlaufende Anteile	7.439	5.244	7.905
NIW je Anteil	\$ 13,56	\$ 16,56	\$ 17,18

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021	Zum 31. Dez. 2020
Global Investment Grade Credit Fund (Fortsetzung)			
ausschüttend	\$ 22.435	\$ 33.395	\$ 46.397
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.833	3.347	4.359
NIW je Anteil	\$ 7,92	\$ 9,98	\$ 10,64
Institutional AUD (Hedged):			
ausschüttend	AUD 7.370	AUD 90.155	AUD 193.406
ausgegebene und umlaufende Anteile	861	8.528	17.513
NIW je Anteil	AUD 8,56	AUD 10,57	AUD 11,04
Institutional CAD (Hedged):			
ausschüttend	k. A.	CAD 12	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	1	k. A.
NIW je Anteil	k. A.	CAD 9,70	k. A.
Institutional CHF (Hedged):			
thesaurierend	CHF 656.465	CHF 814.188	CHF 1.033.114
ausgegebene und umlaufende Anteile	44.353	45.260	56.019
NIW je Anteil	CHF 14,80	CHF 17,99	CHF 18,44
ausschüttend	CHF 33.474	CHF 49.517	CHF 64.939
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.674	5.516	6.862
NIW je Anteil	CHF 7,16	CHF 8,98	CHF 9,46
Institutional CZK (Hedged):			
ausschüttend	CZK 339.010	CZK 2.085.033	CZK 2.321.368
ausgegebene und umlaufende Anteile	41.499	216.797	232.003
NIW je Anteil	CZK 8,17	CZK 9,62	CZK 10,01
Institutional EUR (Currency Exposure):			
thesaurierend	€ 43.714	€ 39.844	€ 19.426
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.441	2.737	1.383
NIW je Anteil	€ 12,70	€ 14,56	€ 14,04
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 1.343.974	€ 2.237.224	€ 3.901.877
ausgegebene und umlaufende Anteile	79.965	109.970	187.485
NIW je Anteil	€ 16,81	€ 20,34	€ 20,81
ausschüttend	€ 447.965	€ 803.485	€ 740.139
ausgegebene und umlaufende Anteile	47.525	68.258	59.770
NIW je Anteil	€ 9,43	€ 11,77	€ 12,38
Institutional GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 112.550	£ 258.867	£ 443.999
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.014	11.576	19.545
NIW je Anteil	£ 18,72	£ 22,36	£ 22,72
ausschüttend	£ 767.395	£ 1.684.722	£ 3.908.795
ausgegebene und umlaufende Anteile	69.403	123.537	274.389
NIW je Anteil	£ 11,06	£ 13,64	£ 14,25
Institutional HUF (Hedged):			
ausschüttend	k. A.	HUF 9.873.261	HUF 9.940.031
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	1.025.701	995.298
NIW je Anteil	k. A.	HUF 9,63	HUF 9,99
Institutional ILS (Hedged):			
thesaurierend	k. A.	ILS 9.004	ILS 231.711
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	531	13.394
NIW je Anteil	k. A.	ILS 16,96	ILS 17,30

Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

		Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021	Zum 31. Dez. 2020
Global Investment Grade Credit Fund (Fortsetzung)				
Institutional NOK (Hedged):				
thesaurierend	NOK	258.128	NOK 429.061	NOK 452.970
ausgegebene und umlaufende Anteile		1.931	2.683	2.793
NIW je Anteil	NOK	133,69	NOK 159,90	NOK 162,17
Institutional PLN (Hedged):				
ausschüttend		k. A. PLN	120.869	PLN 24.867
ausgegebene und umlaufende Anteile		k. A.	11.435	2.257
NIW je Anteil		k. A. PLN	10,57	PLN 11,02
Institutional SEK (Hedged):				
thesaurierend	SEK	2.527.557	SEK 3.657.935	SEK 4.033.636
ausgegebene und umlaufende Anteile		176.118	211.649	228.950
NIW je Anteil	SEK	14,35	SEK 17,28	SEK 17,62
Institutional SGD (Hedged):				
ausschüttend	SGD	11.301	SGD 8.028	SGD 53.885
ausgegebene und umlaufende Anteile		1.291	749	4.827
NIW je Anteil	SGD	8,76	SGD 10,72	SGD 11,16
Investor:				
thesaurierend	\$	440.714	\$ 988.957	\$ 1.715.463
ausgegebene und umlaufende Anteile		21.729	41.056	69.981
NIW je Anteil	\$	20,28	\$ 24,09	\$ 24,51
ausschüttend	\$	131.169	\$ 92.275	\$ 272.490
ausgegebene und umlaufende Anteile		11.489	6.624	18.766
NIW je Anteil	\$	11,42	\$ 13,93	\$ 14,52
Investor AUD (Hedged):				
ausschüttend	AUD	10.542	AUD 5.854	AUD 8.681
ausgegebene und umlaufende Anteile		1.256	565	802
NIW je Anteil	AUD	8,39	AUD 10,37	AUD 10,83
Investor CAD (Hedged):				
ausschüttend		k. A. CAD	1.822	CAD 3.272
ausgegebene und umlaufende Anteile		k. A.	175	300
NIW je Anteil		k. A. CAD	10,44	CAD 10,89
Investor CHF (Hedged):				
thesaurierend	CHF	5.359	CHF 7.624	CHF 8.313
ausgegebene und umlaufende Anteile		494	577	611
NIW je Anteil	CHF	10,84	CHF 13,22	CHF 13,60
ausschüttend	CHF	5.334	CHF 8.176	CHF 10.171
ausgegebene und umlaufende Anteile		578	707	834
NIW je Anteil	CHF	9,23	CHF 11,56	CHF 12,19
Investor EUR (Hedged):				
thesaurierend	€	26.086	€ 49.619	€ 71.993
ausgegebene und umlaufende Anteile		1.646	2.577	3.643
NIW je Anteil	€	15,85	€ 19,25	€ 19,76
ausschüttend	€	11.379	€ 16.646	€ 16.947
ausgegebene und umlaufende Anteile		1.151	1.349	1.306
NIW je Anteil	€	9,88	€ 12,34	€ 12,98
Investor GBP (Hedged):				
ausschüttend	£	4.175	£ 5.735	£ 8.458
ausgegebene und umlaufende Anteile		389	433	612
NIW je Anteil	£	10,73	£ 13,23	£ 13,82

		Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021	Zum 31. Dez. 2020
Global Investment Grade Credit Fund (Fortsetzung)				
Investor RMB (Hedged):				
ausschüttend		k. A. CNH	3.345	CNH 7.674
ausgegebene und umlaufende Anteile		k. A.	30	67
NIW je Anteil		k. A. CNH	111,93	CNH 113,76
Investor SGD (Hedged):				
ausschüttend	SGD	7.277	SGD 7.473	SGD 20.558
ausgegebene und umlaufende Anteile		852	715	1.889
NIW je Anteil	SGD	8,54	SGD 10,45	SGD 10,89
Administrative:				
thesaurierend	\$	76.931	\$ 215.743	\$ 241.443
ausgegebene und umlaufende Anteile		4.431	10.444	11.468
NIW je Anteil	\$	17,36	\$ 20,66	\$ 21,05
ausschüttend	\$	47.290	\$ 99.369	\$ 290.320
ausgegebene und umlaufende Anteile		4.285	7.378	20.679
NIW je Anteil	\$	11,04	\$ 13,47	\$ 14,04
Administrative CHF (Hedged):				
thesaurierend	CHF	391	CHF 629	CHF 1.583
ausgegebene und umlaufende Anteile		41	54	132
NIW je Anteil	CHF	9,54	CHF 11,65	CHF 12,01
Administrative EUR (Hedged):				
thesaurierend	€	7.522	€ 9.518	€ 21.800
ausgegebene und umlaufende Anteile		503	523	1.165
NIW je Anteil	€	14,97	€ 18,21	€ 18,72
ausschüttend	€	7.846	€ 9.315	€ 13.726
ausgegebene und umlaufende Anteile		822	782	1.095
NIW je Anteil	€	9,54	€ 11,91	€ 12,53
Administrative GBP (Hedged):				
ausschüttend	£	4.557	£ 6.985	£ 9.572
ausgegebene und umlaufende Anteile		427	531	696
NIW je Anteil	£	10,68	£ 13,17	£ 13,75
Administrative HKD (Unhedged):				
ausschüttend	HKD	10.505	HKD 12.810	HKD 40.974
ausgegebene und umlaufende Anteile		1.244	1.244	3.837
NIW je Anteil	HKD	8,44	HKD 10,30	HKD 10,68
Administrative SEK (Hedged):				
thesaurierend	SEK	901.901	SEK 936.226	SEK 1.214.895
ausgegebene und umlaufende Anteile		88.869	76.221	96.543
NIW je Anteil	SEK	10,15	SEK 12,28	SEK 12,58
Administrative SGD (Hedged):				
ausschüttend	SGD	2.918	SGD 5.459	SGD 48.256
ausgegebene und umlaufende Anteile		354	542	4.597
NIW je Anteil	SGD	8,24	SGD 10,08	SGD 10,50
Class E:				
thesaurierend	\$	605.749	\$ 799.659	\$ 1.314.292
ausgegebene und umlaufende Anteile		36.905	40.796	65.526
NIW je Anteil	\$	16,41	\$ 19,60	\$ 20,06
ausschüttend	\$	216.440	\$ 341.550	\$ 615.957
ausgegebene und umlaufende Anteile		18.589	24.037	41.586
NIW je Anteil	\$	11,64	\$ 14,21	\$ 14,81
Class E CHF (Hedged):				
thesaurierend	CHF	52.629	CHF 78.253	CHF 87.585
ausgegebene und umlaufende Anteile		5.342	6.476	7.007
NIW je Anteil	CHF	9,85	CHF 12,08	CHF 12,50
E Class EUR (Currency Exposure):				
ausschüttend	€	1.340	€ 3.077	€ 4.671
ausgegebene und umlaufende Anteile		148	288	441
NIW je Anteil	€	9,03	€ 10,67	€ 10,58
Class E EUR (Hedged):				
thesaurierend	€	451.796	€ 630.730	€ 767.585
ausgegebene und umlaufende Anteile		31.264	35.735	42.129
NIW je Anteil	€	14,45	€ 17,65	€ 18,22

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021	Zum 31. Dez. 2020
	Global Investment Grade Credit Fund (Fortsetzung)		
	€	€	€
ausschüttend			
ausgegebene und umlaufende Anteile	24.230	26.741	33.181
NIW je Anteil	€ 8,13	€ 10,15	€ 10,68
Class E GBP (Hedged):			
ausschüttend	£ 20.979	£ 31.335	£ 44.366
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.881	2.279	3.090
NIW je Anteil	£ 11,15	£ 13,75	£ 14,36
Class E SGD (Hedged):			
ausschüttend	SGD 30.453	SGD 37.343	SGD 84.734
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.472	3.481	7.583
NIW je Anteil	SGD 8,77	SGD 10,73	SGD 11,17
H Institutional:			
thesaurierend	\$ 282.176	\$ 168.210	\$ 358.146
ausgegebene und umlaufende Anteile	14.572	7.327	15.358
NIW je Anteil	\$ 19,36	\$ 22,96	\$ 23,32
ausschüttend	\$ 17.320	\$ 14.287	\$ 12.263
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.000	1.351	1.113
NIW je Anteil	\$ 8,66	\$ 10,57	\$ 11,02
H Institutional (Currency Exposure):			
thesaurierend	\$ 184.082	\$ 10	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	22.850	1	k. A.
NIW je Anteil	\$ 8,06	\$ 9,85	k. A.
M Retail:			
ausschüttend	\$ 25.037	\$ 49.229	\$ 120.020
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.840	4.577	10.705
NIW je Anteil	\$ 8,82	\$ 10,76	\$ 11,21
ausschüttend II	\$ 86.672	\$ 120.251	\$ 189.177
ausgegebene und umlaufende Anteile	10.861	12.179	18.129
NIW je Anteil	\$ 7,98	\$ 9,87	\$ 10,43
M Retail HKD (Unhedged):			
ausschüttend	HKD 8.376	HKD 9.145	HKD 56.230
ausgegebene und umlaufende Anteile	990	887	5.264
NIW je Anteil	HKD 8,46	HKD 10,31	HKD 10,68
Class R:			
thesaurierend	\$ 16.316	\$ 28.433	\$ 38.196
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.381	2.028	2.679
NIW je Anteil	\$ 11,81	\$ 14,02	\$ 14,26
ausschüttend	\$ 4.870	\$ 6.925	\$ 8.289
ausgegebene und umlaufende Anteile	558	650	746
NIW je Anteil	\$ 8,73	\$ 10,66	\$ 11,11
Class R EUR (Hedged):			
ausschüttend	€ 2.758	€ 6.026	€ 9.645
ausgegebene und umlaufende Anteile	364	636	968
NIW je Anteil	€ 7,59	€ 9,47	€ 9,97
Class R GBP (Hedged):			
ausschüttend	£ 8.117	£ 11.449	£ 26.041
ausgegebene und umlaufende Anteile	998	1.141	2.485
NIW je Anteil	£ 8,14	£ 10,04	£ 10,48
Class T:			
thesaurierend	\$ 28.595	\$ 42.303	\$ 61.567
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.786	3.438	4.870
NIW je Anteil	\$ 10,26	\$ 12,30	\$ 12,64
Class T EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 3.508	€ 4.875	€ 7.585
ausgegebene und umlaufende Anteile	393	446	669
NIW je Anteil	€ 8,92	€ 10,94	€ 11,34
Class W:			
thesaurierend	\$ 32.822	\$ 66.615	\$ 70.586
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.811	6.543	6.843
NIW je Anteil	\$ 8,61	\$ 10,18	\$ 10,32

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021	Zum 31. Dez. 2020
	Global Investment Grade Credit ESG Fund		
	\$	\$	\$
ausschüttend			
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.437	2.116	2.996
NIW je Anteil	\$ 8,03	\$ 9,80	\$ 10,21
Class W CHF (Hedged):			
thesaurierend	CHF 20.144	CHF 32.864	CHF 36.879
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.440	3.278	3.592
NIW je Anteil	CHF 8,26	CHF 10,03	CHF 10,27
Class W EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 14.812	€ 150.079	€ 14.050
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.781	14.925	1.367
NIW je Anteil	€ 8,31	€ 10,06	€ 10,28
ausschüttend	€ 2.194	€ 3.545	€ 4.089
ausgegebene und umlaufende Anteile	283	367	402
NIW je Anteil	€ 7,74	€ 9,67	€ 10,17
Class W GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 3.270	£ 515	£ 8
ausgegebene und umlaufende Anteile	385	51	1
NIW je Anteil	£ 8,50	£ 10,15	£ 10,30
ausschüttend	£ 6.970	£ 16.284	£ 15.521
ausgegebene und umlaufende Anteile	881	1.668	1.521
NIW je Anteil	£ 7,92	£ 9,76	£ 10,20
Class W SGD (Hedged):			
ausschüttend	SGD 4.506	SGD 810	SGD 14
ausgegebene und umlaufende Anteile	563	83	1
NIW je Anteil	SGD 8,01	SGD 9,79	SGD 10,20
Nettovermögen			
	\$ 1.369.890	\$ 1.189.563	\$ 332.010
Institutional:			
thesaurierend	\$ 61.632	\$ 39.212	\$ 42.254
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.924	3.211	3.426
NIW je Anteil	\$ 10,40	\$ 12,21	\$ 12,33
ausschüttend	\$ 10.347	\$ 19.429	\$ 29.531
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.167	1.825	2.706
NIW je Anteil	\$ 8,86	\$ 10,65	\$ 10,91
Institutional CHF (Hedged):			
thesaurierend	CHF 190.278	CHF 185.627	CHF 54.442
ausgegebene und umlaufende Anteile	20.258	16.381	4.707
NIW je Anteil	CHF 9,39	CHF 11,33	CHF 11,57
ausschüttend	CHF 2.020	CHF 3.002	CHF 200
ausgegebene und umlaufende Anteile	253	304	19
NIW je Anteil	CHF 8,00	CHF 9,88	CHF 10,24
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 220.186	€ 229.148	€ 49.683
ausgegebene und umlaufende Anteile	23.072	19.996	4.257
NIW je Anteil	€ 9,54	€ 11,46	€ 11,67
ausschüttend	€ 320.757	€ 42.749	€ 23.021
ausgegebene und umlaufende Anteile	39.702	4.306	2.243
NIW je Anteil	€ 8,08	€ 9,93	€ 10,26
Institutional GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 72.284	£ 83.370	£ 15.049
ausgegebene und umlaufende Anteile	7.283	7.085	1.264
NIW je Anteil	£ 9,92	£ 11,77	£ 11,90
ausschüttend	£ 87.512	£ 155.708	£ 10.023
ausgegebene und umlaufende Anteile	9.955	14.592	915
NIW je Anteil	£ 8,79	£ 10,67	£ 10,96
Institutional SEK (Hedged):			
thesaurierend	SEK 11.028	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	106	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	SEK 103,64	k. A.	k. A.

Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

	Zum		Zum		Zum	
	31. Dez. 2022		31. Dez. 2021		31. Dez. 2020	
Global Investment Grade Credit ESG Fund (Fortsetzung)						
Investor:						
thesaurierend	\$	217	\$	141		k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile		25		14		k. A.
NIW je Anteil	\$	8,56	\$	10,09		k. A.
Administrative SEK (Hedged):						
thesaurierend	SEK	3.047.191	SEK	2.293.688	SEK	349.070
ausgegebene und umlaufende Anteile		35.030		21.953		3.274
NIW je Anteil	SEK	86,99	SEK	104,48	SEK	106,61
Class E:						
thesaurierend	\$	1.735	\$	3.820	\$	10.591
ausgegebene und umlaufende Anteile		200		372		1.011
NIW je Anteil	\$	8,68	\$	10,28	\$	10,47
ausschüttend	\$	446	\$	834	\$	3.531
ausgegebene und umlaufende Anteile		53		82		339
NIW je Anteil	\$	8,45	\$	10,15	\$	10,40
Class E CHF (Hedged):						
thesaurierend	CHF	491	CHF	194	CHF	1.953
ausgegebene und umlaufende Anteile		60		19		189
NIW je Anteil	CHF	8,22	CHF	10,01	CHF	10,31
ausschüttend	CHF	24	CHF	30	CHF	31
ausgegebene und umlaufende Anteile		3		3		3
NIW je Anteil	CHF	8,00	CHF	9,87	CHF	10,23
Class E EUR (Hedged):						
thesaurierend	€	3.370	€	7.130	€	6.631
ausgegebene und umlaufende Anteile		406		709		642
NIW je Anteil	€	8,29	€	10,05	€	10,33
ausschüttend	€	581	€	869	€	561
ausgegebene und umlaufende Anteile		72		88		55
NIW je Anteil	€	8,07	€	9,92	€	10,25
Class E GBP (Hedged):						
thesaurierend	£	420	£	503	£	532
ausgegebene und umlaufende Anteile		50		50		51
NIW je Anteil	£	8,49	£	10,16	£	10,37
ausschüttend		k. A.	£	104	£	114
ausgegebene und umlaufende Anteile		k. A.		10		11
NIW je Anteil		k. A.	£	10,02	£	10,29
Class Z:						
thesaurierend	\$	19.339	\$	22.582	\$	6.627
ausgegebene und umlaufende Anteile		1.986		1.986		580
NIW je Anteil	\$	9,74	\$	11,37	\$	11,43
Global Low Duration Real Return Fund						
Nettvermögen	\$	1.364.375	\$	1.199.076	\$	787.871
Institutional:						
thesaurierend	\$	136.292	\$	150.363	\$	121.782
ausgegebene und umlaufende Anteile		11.554		12.580		10.630
NIW je Anteil	\$	11,80	\$	11,95	\$	11,46
Institutional CHF (Hedged):						
thesaurierend	CHF	22.752	CHF	32.711	CHF	10.894
ausgegebene und umlaufende Anteile		2.303		3.190		1.097
NIW je Anteil	CHF	9,88	CHF	10,25	CHF	9,93

	Zum		Zum		Zum	
	31. Dez. 2022		31. Dez. 2021		31. Dez. 2020	
Global Low Duration Real Return Fund (Fortsetzung)						
Institutional EUR (Hedged):						
thesaurierend	€	498.384	€	518.804	€	360.889
ausgegebene und umlaufende Anteile		48.614		48.941		35.221
NIW je Anteil	€	10,25	€	10,60	€	10,25
ausschüttend	€	34.131	€	45.289	€	39.196
ausgegebene und umlaufende Anteile		3.856		4.630		4.002
NIW je Anteil	€	8,85	€	9,78	€	9,79
Institutional GBP (Hedged):						
thesaurierend	£	55.816	£	63.979	£	32.234
ausgegebene und umlaufende Anteile		5.128		5.771		3.025
NIW je Anteil	£	10,88	£	11,09	£	10,66
ausschüttend	£	62.640	£	57.902	£	31.115
ausgegebene und umlaufende Anteile		6.761		5.720		3.085
NIW je Anteil	£	9,26	£	10,12	£	10,09
Institutional SGD (Hedged):						
thesaurierend	SGD	351.313		k. A.		k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile		34.943		k. A.		k. A.
NIW je Anteil	SGD	10,05		k. A.		k. A.
Investor:						
thesaurierend	\$	6.751	\$	5.146	\$	3.787
ausgegebene und umlaufende Anteile		591		443		339
NIW je Anteil	\$	11,42	\$	11,61	\$	11,17
Class E:						
thesaurierend	\$	34.924	\$	26.574	\$	15.858
ausgegebene und umlaufende Anteile		3.206		2.386		1.472
NIW je Anteil	\$	10,89	\$	11,14	\$	10,77
Class E EUR (Hedged):						
thesaurierend	€	177.147	€	153.469	€	47.404
ausgegebene und umlaufende Anteile		18.721		15.545		4.923
NIW je Anteil	€	9,46	€	9,87	€	9,63
Global Real Return Fund						
Nettvermögen	\$	2.571.862	\$	3.703.379	\$	2.578.062
Institutional:						
thesaurierend	\$	272.591	\$	380.827	\$	220.950
ausgegebene und umlaufende Anteile		12.628		14.784		9.004
NIW je Anteil	\$	21,59	\$	25,76	\$	24,54
ausschüttend	\$	12.328	\$	22.531	\$	26.256
ausgegebene und umlaufende Anteile		796		1.136		1.349
NIW je Anteil	\$	15,49	\$	19,84	\$	19,47
Institutional (Currency Exposure):						
thesaurierend	\$	47.075	\$	68.405	\$	84.232
ausgegebene und umlaufende Anteile		4.828		5.543		7.004
NIW je Anteil	\$	9,75	\$	12,34	\$	12,03
Institutional CHF (Hedged):						
thesaurierend	CHF	56.131	CHF	63.005	CHF	52.289
ausgegebene und umlaufende Anteile		4.267		3.907		3.366
NIW je Anteil	CHF	13,15	CHF	16,12	CHF	15,53
ausschüttend	CHF	33.615	CHF	38.988	CHF	36.335
ausgegebene und umlaufende Anteile		3.898		3.438		3.228
NIW je Anteil	CHF	8,62	CHF	11,34	CHF	11,26
Institutional EUR (Hedged):						
thesaurierend	€	824.251	€	1.075.404	€	796.538
ausgegebene und umlaufende Anteile		45.572		48.681		37.555
NIW je Anteil	€	18,09	€	22,09	€	21,21
ausschüttend	€	98.750	€	140.728	€	152.140
ausgegebene und umlaufende Anteile		7.750		8.415		9.195
NIW je Anteil	€	12,74	€	16,72	€	16,55

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021	Zum 31. Dez. 2020
	Global Real Return Fund (Fortsetzung)		
Institutional GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 38.820	£ 45.209	£ 33.719
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.298	3.177	2.484
NIW je Anteil	£ 11,77	£ 14,23	£ 13,57
ausschüttend	£ 205.454	£ 276.097	£ 83.894
ausgegebene und umlaufende Anteile	25.531	26.297	8.128
NIW je Anteil	£ 8,05	£ 10,50	£ 10,32
Institutional SGD (Hedged):			
thesaurierend	SGD 236.796	SGD 307.106	SGD 157.065
ausgegebene und umlaufende Anteile	14.984	16.250	8.732
NIW je Anteil	SGD 15,80	SGD 18,90	SGD 17,99
Investor:			
thesaurierend	\$ 63.935	\$ 92.993	\$ 70.699
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.170	3.850	3.062
NIW je Anteil	\$ 20,17	\$ 24,16	\$ 23,09
ausschüttend	\$ 9.038	\$ 31.044	\$ 21.532
ausgegebene und umlaufende Anteile	669	1.795	1.269
NIW je Anteil	\$ 13,51	\$ 17,30	\$ 16,97
Investor CHF (Hedged):			
ausschüttend	CHF 2.516	CHF 5.139	CHF 4.219
ausgegebene und umlaufende Anteile	232	360	298
NIW je Anteil	CHF 10,85	CHF 14,28	CHF 14,17
Investor EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 22.838	€ 36.406	€ 15.265
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.347	1.752	763
NIW je Anteil	€ 16,95	€ 20,77	€ 20,02
Administrative:			
thesaurierend	\$ 43.396	\$ 71.230	\$ 61.037
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.200	3.010	2.694
NIW je Anteil	\$ 19,73	\$ 23,66	\$ 22,65
Class E:			
thesaurierend	\$ 153.574	\$ 231.761	\$ 157.612
ausgegebene und umlaufende Anteile	8.292	10.391	7.352
NIW je Anteil	\$ 18,52	\$ 22,30	\$ 21,44
ausschüttend	\$ 38.490	\$ 53.098	\$ 31.022
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.958	3.187	1.898
NIW je Anteil	\$ 13,01	\$ 16,66	\$ 16,35
Class E EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 234.441	€ 321.175	€ 217.762
ausgegebene und umlaufende Anteile	15.090	16.773	11.740
NIW je Anteil	€ 15,54	€ 19,15	€ 18,55
Class E GBP (Hedged):			
ausschüttend	k. A.	£ 4.354	£ 2.597
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	282	171
NIW je Anteil	k. A.	£ 15,45	£ 15,19
H Institutional:			
thesaurierend	\$ 90.138	\$ 150.924	\$ 49.942
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.307	6.032	2.092
NIW je Anteil	\$ 20,93	\$ 25,02	\$ 23,87
Class R:			
thesaurierend	\$ 1.569	\$ 7.292	\$ 1.921
ausgegebene und umlaufende Anteile	132	514	142
NIW je Anteil	\$ 11,85	\$ 14,18	\$ 13,54
Class R GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 8.283	£ 12.683	£ 13.745
ausgegebene und umlaufende Anteile	747	944	1.069
NIW je Anteil	£ 11,09	£ 13,44	£ 12,86

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021	Zum 31. Dez. 2020
	Income Fund		
Nettovermögen	\$ 57.980.327	\$ 73.579.726	\$ 71.275.311
Institutional:			
thesaurierend	\$ 9.197.801	\$ 10.989.198	\$ 10.051.322
ausgegebene und umlaufende Anteile	582.256	643.353	603.562
NIW je Anteil	\$ 15,80	\$ 17,08	\$ 16,65
ausschüttend	\$ 4.597.148	\$ 5.308.194	\$ 4.407.646
ausgegebene und umlaufende Anteile	435.389	442.049	362.996
NIW je Anteil	\$ 10,56	\$ 12,01	\$ 12,14
Institutional AUD (Hedged):			
thesaurierend	AUD 80.591	AUD 96.588	AUD 88.881
ausgegebene und umlaufende Anteile	7.611	8.329	7.836
NIW je Anteil	AUD 10,59	AUD 11,60	AUD 11,34
ausschüttend	k. A.	AUD 14	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	1	k. A.
NIW je Anteil	k. A.	AUD 9,84	k. A.
Institutional BRL (Hedged):			
thesaurierend	\$ 274.136	\$ 561.362	\$ 601.491
ausgegebene und umlaufende Anteile	20.003	43.619	46.272
NIW je Anteil	\$ 13,70	\$ 12,87	\$ 13,00
Institutional CAD (Hedged):			
thesaurierend	CAD 83.552	CAD 98.436	CAD 111.995
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.821	7.406	8.629
NIW je Anteil	CAD 12,25	CAD 13,29	CAD 12,98
ausschüttend	CAD 117.940	CAD 138.770	CAD 127.606
ausgegebene und umlaufende Anteile	12.956	13.346	12.097
NIW je Anteil	CAD 9,10	CAD 10,40	CAD 10,55
Institutional CHF (Hedged):			
thesaurierend	CHF 293.823	CHF 326.885	CHF 273.775
ausgegebene und umlaufende Anteile	26.495	26.540	22.558
NIW je Anteil	CHF 11,09	CHF 12,32	CHF 12,14
ausschüttend	CHF 135.996	CHF 178.124	CHF 183.521
ausgegebene und umlaufende Anteile	17.253	19.281	19.319
NIW je Anteil	CHF 7,88	CHF 9,24	CHF 9,50
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 4.856.302	€ 6.397.698	€ 6.723.610
ausgegebene und umlaufende Anteile	356.885	424.812	453.932
NIW je Anteil	€ 13,61	€ 15,06	€ 14,81
ausschüttend	€ 858.841	€ 1.216.992	€ 963.725
ausgegebene und umlaufende Anteile	96.621	117.285	90.563
NIW je Anteil	€ 8,89	€ 10,38	€ 10,64
ausschüttend II	€ 13.739	€ 21.567	€ 58.118
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.555	2.138	5.750
NIW je Anteil	€ 8,84	€ 10,09	€ 10,11
Institutional GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 179.687	£ 223.422	£ 13.809
ausgegebene und umlaufende Anteile	17.378	19.797	1.252
NIW je Anteil	£ 10,34	£ 11,29	£ 11,03
ausschüttend	£ 437.940	£ 465.680	£ 426.938
ausgegebene und umlaufende Anteile	48.401	44.776	40.380
NIW je Anteil	£ 9,05	£ 10,40	£ 10,57

Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

	Zum 31. Dez. 2022		Zum 31. Dez. 2021		Zum 31. Dez. 2020	
	Income Fund (Fortsetzung)					
Institutional HKD (Unhedged):						
ausschüttend	HKD	448.226	HKD	798.164	HKD	796.572
ausgegebene und umlaufende Anteile		46.468		72.832		72.285
NIW je Anteil	HKD	9,65	HKD	10,96	HKD	11,02
Institutional JPY (Hedged):						
thesaurierend	k. A.	¥	255.548	¥		198.303
ausgegebene und umlaufende Anteile		k. A.	229			181
NIW je Anteil		k. A.	¥	1.118,00	¥	1.093,00
Institutional NOK (Hedged):						
thesaurierend	NOK	2.153.310	NOK	2.187.743	NOK	2.157.697
ausgegebene und umlaufende Anteile		19.915		18.488		18.680
NIW je Anteil	NOK	108,13	NOK	118,34	NOK	115,51
Institutional RMB (Hedged):						
thesaurierend	k. A.	CNH	66			k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile		k. A.	1			k. A.
NIW je Anteil		k. A.	CNH	101,42		k. A.
Institutional SGD (Hedged):						
thesaurierend	SGD	57.007	SGD	46.472	SGD	2.335
ausgegebene und umlaufende Anteile		5.614		4.222		218
NIW je Anteil	SGD	10,15	SGD	11,01	SGD	10,73
ausschüttend	SGD	233.054	SGD	277.493	SGD	271.784
ausgegebene und umlaufende Anteile		24.522		25.607		24.806
NIW je Anteil	SGD	9,50	SGD	10,84	SGD	10,96
Investor:						
thesaurierend	\$	1.938.128	\$	2.841.494	\$	2.037.337
ausgegebene und umlaufende Anteile		150.961		203.964		149.476
NIW je Anteil	\$	12,84	\$	13,93	\$	13,63
ausschüttend	\$	1.424.611	\$	1.709.869	\$	1.314.008
ausgegebene und umlaufende Anteile		152.992		160.791		121.625
NIW je Anteil	\$	9,31	\$	10,63	\$	10,80
Investor AUD (Hedged):						
ausschüttend	AUD	64.155	AUD	73.714	AUD	52.351
ausgegebene und umlaufende Anteile		7.404		7.348		5.112
NIW je Anteil	AUD	8,66	AUD	10,03	AUD	10,24
Investor EUR (Hedged):						
thesaurierend	€	212.831	€	508.040	€	1.450.102
ausgegebene und umlaufende Anteile		19.702		42.352		122.489
NIW je Anteil	€	10,80	€	12,00	€	11,84
ausschüttend	€	75.705	€	105.743	€	60.870
ausgegebene und umlaufende Anteile		9.766		11.634		6.496
NIW je Anteil	€	7,75	€	9,09	€	9,37
ausschüttend A	€	29.277	€	37.920	€	40.130
ausgegebene und umlaufende Anteile		3.673		4.052		4.156
NIW je Anteil	€	7,97	€	9,36	€	9,66
Investor GBP (Hedged):						
ausschüttend	£	16.799	£	9.219	£	3.920
ausgegebene und umlaufende Anteile		1.965		935		390
NIW je Anteil	£	8,55	£	9,86	£	10,04
Investor RMB (Hedged):						
thesaurierend	CNH	66.886	CNH	124.077	CNH	252.069
ausgegebene und umlaufende Anteile		579		994		2.117
NIW je Anteil	CNH	115,46	CNH	124,87	CNH	119,09
Investor SGD (Hedged):						
thesaurierend	SGD	6.150	SGD	1.979	SGD	127
ausgegebene und umlaufende Anteile		625		185		12
NIW je Anteil	SGD	9,84	SGD	10,70	SGD	10,47
ausschüttend	SGD	47.450	SGD	67.208	SGD	37.559
ausgegebene und umlaufende Anteile		5.340		6.605		3.630
NIW je Anteil	SGD	8,89	SGD	10,18	SGD	10,35
Administrative:						
thesaurierend	\$	744.526	\$	912.059	\$	631.493
ausgegebene und umlaufende Anteile		65.457		73.786		52.139
NIW je Anteil	\$	11,37	\$	12,36	\$	12,11
ausschüttend	\$	2.930.269	\$	3.699.459	\$	3.418.694
ausgegebene und umlaufende Anteile		294.606		325.103		295.096
NIW je Anteil	\$	9,95	\$	11,38	\$	11,59
Administrative AUD (Hedged):						
ausschüttend	AUD	286.887	AUD	316.049	AUD	355.413
ausgegebene und umlaufende Anteile		32.273		30.677		33.782
NIW je Anteil	AUD	8,89	AUD	10,30	AUD	10,52
Administrative EUR (Hedged):						
thesaurierend	€	96.175	€	193.792	€	242.607
ausgegebene und umlaufende Anteile		8.961		16.228		20.554
NIW je Anteil	€	10,73	€	11,94	€	11,80
ausschüttend	€	266.419	€	308.049	€	331.791
ausgegebene und umlaufende Anteile		33.865		33.362		34.844
NIW je Anteil	€	7,87	€	9,23	€	9,52
Administrative GBP (Hedged):						
ausschüttend	£	112.506	£	140.149	£	139.212
ausgegebene und umlaufende Anteile		13.611		14.660		14.220
NIW je Anteil	£	8,27	£	9,56	£	9,79
Administrative HKD (Unhedged):						
ausschüttend	HKD	3.221.408	HKD	4.681.912	HKD	3.245.289
ausgegebene und umlaufende Anteile		364.591		463.488		316.993
NIW je Anteil	HKD	8,84	HKD	10,10	HKD	10,24
Administrative JPY (Hedged):						
thesaurierend	k. A.	¥	1.099			k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile		k. A.	1			k. A.
NIW je Anteil		k. A.	¥	999,00		k. A.
Administrative SGD (Hedged):						
ausschüttend	SGD	971.804	SGD	1.080.475	SGD	1.038.592
ausgegebene und umlaufende Anteile		99.186		96.129		90.748
NIW je Anteil	SGD	9,80	SGD	11,24	SGD	11,44
Class E:						
thesaurierend	\$	4.837.460	\$	6.088.898	\$	5.774.107
ausgegebene und umlaufende Anteile		335.073		386.539		372.607
NIW je Anteil	\$	14,44	\$	15,75	\$	15,50
ausschüttend	\$	6.857.888	\$	8.765.914	\$	7.968.268
ausgegebene und umlaufende Anteile		723.233		804.221		714.149
NIW je Anteil	\$	9,48	\$	10,90	\$	11,16

	Zum 31. Dez. 2022		Zum 31. Dez. 2021		Zum 31. Dez. 2020	
	Income Fund (Fortsetzung)					
	k. A.	\$	2.029	\$	1.841	
Ausschüttend Q						
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.		203		180	
NIW je Anteil	k. A.	\$	10,01	\$	10,24	
Class E AUD (Hedged):						
ausschüttend	AUD	595.621	AUD	699.187	AUD	688.828
ausgegebene und umlaufende Anteile		71.382		71.928		68.955
NIW je Anteil	AUD	8,34	AUD	9,72	AUD	9,99
Class E CHF (Hedged):						
thesaurierend	CHF	80.590	CHF	101.113	CHF	98.769
ausgegebene und umlaufende Anteile		7.568		8.472		8.323
NIW je Anteil	CHF	10,65	CHF	11,93	CHF	11,87
ausschüttend	CHF	80.502	CHF	117.164	CHF	141.703
ausgegebene und umlaufende Anteile		11.178		13.731		15.949
NIW je Anteil	CHF	7,20	CHF	8,53	CHF	8,88
Class E EUR (Hedged):						
thesaurierend	€	4.356.288	€	5.062.678	€	4.783.315
ausgegebene und umlaufende Anteile		350.614		364.865		347.362
NIW je Anteil	€	12,42	€	13,88	€	13,77
ausschüttend	€	3.436.223	€	4.359.865	€	4.900.988
ausgegebene und umlaufende Anteile		430.505		462.802		500.834
NIW je Anteil	€	7,98	€	9,42	€	9,79
ausschüttend II	€	121.587	€	125.779	€	128.995
ausgegebene und umlaufende Anteile		13.705		12.308		12.476
NIW je Anteil	€	8,87	€	10,22	€	10,34
Ausschüttend II Q	€	38.028	€	52.706	€	35.195
ausgegebene und umlaufende Anteile		4.345		5.208		3.436
NIW je Anteil	€	8,75	€	10,12	€	10,24
Class E GBP (Hedged):						
ausschüttend	£	208.926	£	236.936	£	254.166
ausgegebene und umlaufende Anteile		26.188		25.560		26.639
NIW je Anteil	£	7,98	£	9,27	£	9,54
Class E HKD (Unhedged):						
ausschüttend	HKD	3.442.414	HKD	4.704.540	HKD	5.569.457
ausgegebene und umlaufende Anteile		385.795		459.225		534.050
NIW je Anteil	HKD	8,92	HKD	10,24	HKD	10,43
Class E JPY (Hedged):						
thesaurierend	¥	4.076.871	¥	743.601	¥	2.647.085
ausgegebene und umlaufende Anteile		4.248		692		2.495
NIW je Anteil	¥	960,00	¥	1.075,00	¥	1.061,00
ausschüttend	¥	1.381		k. A.		k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile		1		k. A.		k. A.
NIW je Anteil	¥	992,00		k. A.		k. A.
Class E RMB (Hedged):						
ausschüttend	CNH	490.076	CNH	671.398	CNH	593.183
ausgegebene und umlaufende Anteile		4.497		5.397		4.815
NIW je Anteil	CNH	108,97	CNH	124,39	CNH	123,20
Class E SGD (Hedged):						
ausschüttend	SGD	2.537.340	SGD	2.784.269	SGD	2.701.956
ausgegebene und umlaufende Anteile		292.512		278.445		263.912
NIW je Anteil	SGD	8,67	SGD	10,00	SGD	10,24

	Zum 31. Dez. 2022		Zum 31. Dez. 2021		Zum 31. Dez. 2020	
	Income Fund (Fortsetzung)					
	€	\$	€	\$	€	\$
G Retail EUR (Hedged):						
ausschüttend	€	18.496	€	29.724	€	35.845
ausgegebene und umlaufende Anteile		2.393		3.263		3.801
NIW je Anteil	€	7,73	€	9,11	€	9,43
G Retail EUR (Unhedged):						
ausschüttend		k. A.	€	518	€	275
ausgegebene und umlaufende Anteile		k. A.		51		29
NIW je Anteil		k. A.	€	10,11	€	9,55
H Institutional:						
thesaurierend	\$	669.952	\$	770.236	\$	562.857
ausgegebene und umlaufende Anteile		60.591		64.313		48.123
NIW je Anteil	\$	11,06	\$	11,98	\$	11,70
ausschüttend	\$	287.285	\$	333.808	\$	299.508
ausgegebene und umlaufende Anteile		31.482		32.084		28.375
NIW je Anteil	\$	9,13	\$	10,40	\$	10,56
H Institutional EUR (Hedged):						
thesaurierend		k. A.	€	8.530	€	2.672
ausgegebene und umlaufende Anteile		k. A.		772		245
NIW je Anteil		k. A.	€	11,05	€	10,89
Class R:						
thesaurierend	\$	82.073	\$	70.929	\$	31.223
ausgegebene und umlaufende Anteile		8.054		6.420		2.892
NIW je Anteil	\$	10,19	\$	11,05	\$	10,80
ausschüttend	\$	61.635	\$	84.900	\$	70.869
ausgegebene und umlaufende Anteile		6.695		8.082		6.645
NIW je Anteil	\$	9,21	\$	10,50	\$	10,66
Class R EUR (Hedged):						
ausschüttend	€	12.865	€	16.112	€	14.929
ausgegebene und umlaufende Anteile		1.567		1.678		1.514
NIW je Anteil	€	8,21	€	9,60	€	9,86
Class R GBP (Hedged):						
ausschüttend	£	20.954	£	33.995	£	31.954
ausgegebene und umlaufende Anteile		2.220		3.123		2.878
NIW je Anteil	£	9,44	£	10,88	£	11,10
Class T:						
thesaurierend	\$	295.923	\$	371.744	\$	359.667
ausgegebene und umlaufende Anteile		24.971		28.634		28.049
NIW je Anteil	\$	11,85	\$	12,98	\$	12,82
ausschüttend	\$	102.600	\$	130.671	\$	131.492
ausgegebene und umlaufende Anteile		12.279		13.542		13.244
NIW je Anteil	\$	8,36	\$	9,65	\$	9,93
Class T EUR (Hedged):						
thesaurierend	€	226.266	€	268.086	€	280.339
ausgegebene und umlaufende Anteile		22.053		23.304		24.457
NIW je Anteil	€	10,26	€	11,50	€	11,46
ausschüttend	€	165.117	€	217.088	€	252.475
ausgegebene und umlaufende Anteile		23.351		25.890		28.837
NIW je Anteil	€	7,07	€	8,38	€	8,76
Class Z:						
thesaurierend	\$	219.519	\$	162.794	\$	110.891
ausgegebene und umlaufende Anteile		13.161		9.076		6.376
NIW je Anteil	\$	16,68	\$	17,94	\$	17,39

Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

	Zum 31. Dez. 2022		Zum 31. Dez. 2021		Zum 31. Dez. 2020	
	Income Fund (Fortsetzung)					
Class Z AUD (Hedged):						
ausschüttend II	AUD	1.339.063	AUD	1.451.394	AUD	1.115.008
ausgegebene und umlaufende Anteile		136.394		129.096		98.412
NIW je Anteil	AUD	9,82	AUD	11,24	AUD	11,33
Nettovermögen	\$	56.623	\$	27.770		k. A.
Institutional:						
thesaurierend	\$	22.431	\$	24.374		k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile		2.396		2.396		k. A.
NIW je Anteil	\$	9,35	\$	10,17		k. A.
ausschüttend		k. A.		10		k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile		k. A.		1		k. A.
NIW je Anteil		k. A.		9,94		k. A.
Class E:						
ausschüttend	\$	17.894	\$	1.730		k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile		2.069		174		k. A.
NIW je Anteil	\$	8,65	\$	9,92		k. A.
Class E AUD (Hedged):						
ausschüttend	AUD	2.119	AUD	365		k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile		249		37		k. A.
NIW je Anteil	AUD	8,52	AUD	9,90		k. A.
Class E EUR (Hedged):						
ausschüttend	€	3.221	€	494		k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile		385		50		k. A.
NIW je Anteil	€	8,37	€	9,85		k. A.
Class E GBP (Hedged):						
ausschüttend	£	2.810	£	196		k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile		329		20		k. A.
NIW je Anteil	£	8,55	£	9,90		k. A.
Class E HKD (Unhedged):						
ausschüttend	HKD	62.867	HKD	2.462		k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile		7.226		247		k. A.
NIW je Anteil	HKD	8,70	HKD	9,98		k. A.
Class E SGD (Hedged):						
ausschüttend		k. A.	SGD	333		k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile		k. A.		34		k. A.
NIW je Anteil		k. A.	SGD	9,93		k. A.
Nettovermögen	\$	403.078	\$	164.345	\$	70.032
Institutional:						
thesaurierend	\$	83.455	\$	68.012	\$	55.509
ausgegebene und umlaufende Anteile		7.503		5.798		5.263
NIW je Anteil	\$	11,12	\$	11,73	\$	10,55
Institutional EUR (Partially Hedged):						
thesaurierend	€	82.243	€	4.749		k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile		8.718		477		k. A.
NIW je Anteil	€	9,43	€	9,96		k. A.
Institutional GBP (Partially Hedged):						
thesaurierend	£	3.543	£	22.843	£	2.213
ausgegebene und umlaufende Anteile		308		1.924		207
NIW je Anteil	£	11,50	£	11,87	£	10,68

	Zum 31. Dez. 2022		Zum 31. Dez. 2021		Zum 31. Dez. 2020	
	Inflation Multi-Asset Fund (Fortsetzung)					
Administrative:						
ausschüttend II	\$	2.961		k. A.		k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile		338		k. A.		k. A.
NIW je Anteil	\$	8,75		k. A.		k. A.
Administrative SGD (Hedged):						
ausschüttend II	SGD	10.723		k. A.		k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile		1.197		k. A.		k. A.
NIW je Anteil	SGD	8,95		k. A.		k. A.
Class E:						
thesaurierend	\$	85.842	\$	14.809	\$	2.620
ausgegebene und umlaufende Anteile		8.673		1.405		273
NIW je Anteil	\$	9,90	\$	10,54	\$	9,59
ausschüttend II	\$	9		k. A.		k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile		1		k. A.		k. A.
NIW je Anteil	\$	9,27		k. A.		k. A.
Class E AUD (Partially Hedged):						
thesaurierend	AUD	334		k. A.		k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile		36		k. A.		k. A.
NIW je Anteil	AUD	9,35		k. A.		k. A.
Class E EUR (Partially Hedged):						
thesaurierend	€	110.990	€	33.996	€	6.072
ausgegebene und umlaufende Anteile		11.966		3.436		683
NIW je Anteil	€	9,28	€	9,89	€	8,89
ausschüttend	€	11.302	€	5.738	€	1.185
ausgegebene und umlaufende Anteile		1.312		608		137
NIW je Anteil	€	8,61	€	9,43	€	8,62
Class E GBP (Partially Hedged):						
thesaurierend	£	8		k. A.		k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile		1		k. A.		k. A.
NIW je Anteil	£	9,41		k. A.		k. A.
Class E SGD (Partially Hedged):						
thesaurierend	SGD	13		k. A.		k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile		1		k. A.		k. A.
NIW je Anteil	SGD	9,35		k. A.		k. A.
H Institutional:						
thesaurierend	\$	9		k. A.		k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile		1		k. A.		k. A.
NIW je Anteil	\$	9,45		k. A.		k. A.
M Retail:						
ausschüttend II	\$	9		k. A.		k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile		1		k. A.		k. A.
NIW je Anteil	\$	9,32		k. A.		k. A.
Nettovermögen	\$	1.072.758	\$	1.179.138	\$	1.183.413
Institutional:						
thesaurierend	\$	640.710	\$	747.732	\$	806.772
ausgegebene und umlaufende Anteile		41.077		45.606		48.799
NIW je Anteil	\$	15,60	\$	16,40	\$	16,53
ausschüttend	\$	53.185	\$	33.312	\$	37.437
ausgegebene und umlaufende Anteile		5.377		3.159		3.500
NIW je Anteil	\$	9,89	\$	10,54	\$	10,70
Institutional EUR (Hedged):						
thesaurierend	€	37.536	€	35.456	€	35.471
ausgegebene und umlaufende Anteile		3.864		3.402		3.347
NIW je Anteil	€	9,71	€	10,42	€	10,60
ausschüttend	€	8.986	€	10.023	€	8.988
ausgegebene und umlaufende Anteile		1.270		1.302		1.141
NIW je Anteil	€	7,08	€	7,70	€	7,88
Institutional GBP (Hedged):						
thesaurierend	£	17.044	£	13.877	£	6.460
ausgegebene und umlaufende Anteile		1.748		1.347		621
NIW je Anteil	£	9,75	£	10,30	£	10,40

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021	Zum 31. Dez. 2020
Low Average Duration Fund (Fortsetzung)			
ausschüttend	£ 3.285	£ 4.225	£ 11.174
ausgegebene und umlaufende Anteile	367	439	1.141
NIW je Anteil	£ 8,95	£ 9,64	£ 9,79
Investor:			
thesaurierend	\$ 16.532	\$ 20.960	\$ 30.355
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.131	1.359	1.945
NIW je Anteil	\$ 14,62	\$ 15,42	\$ 15,61
ausschüttend	\$ 2.022	\$ 7.973	\$ 9.569
ausgegebene und umlaufende Anteile	206	762	902
NIW je Anteil	\$ 9,81	\$ 10,46	\$ 10,61
Administrative:			
thesaurierend	\$ 10.755	\$ 11.016	\$ 15.464
ausgegebene und umlaufende Anteile	755	733	1.014
NIW je Anteil	\$ 14,24	\$ 15,04	\$ 15,24
Class E:			
thesaurierend	\$ 47.980	\$ 52.498	\$ 81.937
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.979	4.104	6.297
NIW je Anteil	\$ 12,06	\$ 12,79	\$ 13,01
ausschüttend	\$ 5.384	\$ 6.751	\$ 13.842
ausgegebene und umlaufende Anteile	528	621	1.251
NIW je Anteil	\$ 10,20	\$ 10,87	\$ 11,06
Class E EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 25.480	€ 18.812	€ 19.638
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.238	2.209	2.247
NIW je Anteil	€ 7,87	€ 8,52	€ 8,74
H Institutional:			
thesaurierend	\$ 186.190	\$ 186.367	\$ 72.717
ausgegebene und umlaufende Anteile	15.891	15.108	5.837
NIW je Anteil	\$ 11,72	\$ 12,34	\$ 12,46
ausschüttend	\$ 1.521	\$ 7.574	\$ 6.978
ausgegebene und umlaufende Anteile	159	745	677
NIW je Anteil	\$ 9,54	\$ 10,16	\$ 10,31
Class R:			
thesaurierend	\$ 7.183	\$ 7.325	\$ 5.812
ausgegebene und umlaufende Anteile	687	665	522
NIW je Anteil	\$ 10,45	\$ 11,02	\$ 11,14
Low Duration Global Investment Grade Credit Fund			
Nettovermögen	\$ 654.749	\$ 806.869	\$ 632.519
Institutional:			
thesaurierend	\$ 120.881	\$ 94.445	\$ 92.260
ausgegebene und umlaufende Anteile	10.562	7.805	7.572
NIW je Anteil	\$ 11,44	\$ 12,10	\$ 12,18
ausschüttend	\$ 17.001	\$ 10	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.859	1	k. A.
NIW je Anteil	\$ 9,15	\$ 9,82	k. A.
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 417.993	€ 520.319	€ 358.476
ausgegebene und umlaufende Anteile	41.937	48.370	32.815
NIW je Anteil	€ 9,97	€ 10,76	€ 10,92
ausschüttend	€ 133	€ 928	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	15	95	k. A.
NIW je Anteil	€ 8,90	€ 9,75	k. A.
Institutional GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 18.388	£ 18.462	£ 20.287
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.708	1.611	1.754
NIW je Anteil	£ 10,77	£ 11,46	£ 11,57
ausschüttend	£ 3.910	£ 18.096	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	432	1.849	k. A.
NIW je Anteil	£ 9,06	£ 9,79	k. A.

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021	Zum 31. Dez. 2020
Low Duration Global Investment Grade Credit Fund (Fortsetzung)			
Institutional NOK (Hedged):			
thesaurierend	NOK 159.169	NOK 441.039	NOK 416.606
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.581	4.119	3.864
NIW je Anteil	NOK 100,63	NOK 107,06	NOK 107,82
Class E EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 25.901	€ 17.694	€ 20.641
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.816	1.767	2.011
NIW je Anteil	€ 9,20	€ 10,01	€ 10,26
Low Duration Income Fund			
Nettovermögen	\$ 1.084.380	\$ 1.367.475	\$ 960.639
Institutional:			
thesaurierend	\$ 186.357	\$ 275.963	\$ 6.730
ausgegebene und umlaufende Anteile	17.111	24.381	607
NIW je Anteil	\$ 10,89	\$ 11,32	\$ 11,08
ausschüttend	\$ 11.734	\$ 13.398	\$ 2.025
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.229	1.305	196
NIW je Anteil	\$ 9,56	\$ 10,27	\$ 10,31
Institutional CHF (Hedged):			
thesaurierend	k. A.	CHF 1.854	CHF 401
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	178	39
NIW je Anteil	k. A.	CHF 10,43	CHF 10,32
ausschüttend	k. A.	k. A.	CHF 10
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	1
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	CHF 9,58
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 633.070	€ 666.067	€ 605.043
ausgegebene und umlaufende Anteile	63.769	63.153	58.084
NIW je Anteil	€ 9,93	€ 10,55	€ 10,42
ausschüttend	€ 8	€ 60.301	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	6.036	k. A.
NIW je Anteil	€ 9,14	€ 9,99	k. A.
Institutional GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 3.280	£ 5.158	£ 150.468
ausgegebene und umlaufende Anteile	316	475	14.121
NIW je Anteil	£ 10,37	£ 10,85	£ 10,66
ausschüttend	£ 50.073	£ 130.935	£ 8
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.539	13.372	1
NIW je Anteil	£ 9,04	£ 9,79	£ 9,86
Institutional SGD (Hedged):			
thesaurierend	SGD 15.840	SGD 19.822	SGD 589
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.566	1.883	57
NIW je Anteil	SGD 10,12	SGD 10,53	SGD 10,30
Investor EUR (Hedged):			
thesaurierend	k. A.	€ 639	€ 9
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	61	1
NIW je Anteil	k. A.	€ 10,41	€ 10,32
ausschüttend	k. A.	€ 452	€ 9
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	48	1
NIW je Anteil	k. A.	€ 9,46	€ 9,62
Class E:			
thesaurierend	\$ 27.537	\$ 16.491	\$ 1.386
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.629	1.502	128
NIW je Anteil	\$ 10,47	\$ 10,98	\$ 10,85
ausschüttend	\$ 8.193	\$ 9.075	\$ 1.034
ausgegebene und umlaufende Anteile	885	904	102
NIW je Anteil	\$ 9,25	\$ 10,04	\$ 10,17
Class E CHF (Hedged):			
thesaurierend	k. A.	k. A.	CHF 10
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	1
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	CHF 10,10

Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021	Zum 31. Dez. 2020
Low Duration Income Fund (Fortsetzung)			
ausschüttend	k. A.	k. A.	CHF 10
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	1
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	CHF 9,46
Class E EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 31.442	€ 16.611	€ 1.334
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.297	1.625	131
NIW je Anteil	€ 9,54	€ 10,22	€ 10,18
ausschüttend	€ 2.708	€ 1.014	€ 265
ausgegebene und umlaufende Anteile	322	109	28
NIW je Anteil	€ 8,42	€ 9,34	€ 9,55
Class E SGD (Hedged):			
ausschüttend	k. A.	SGD 721	SGD 712
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	73	71
NIW je Anteil	k. A.	SGD 9,90	SGD 10,02
H Institutional:			
thesaurierend	\$ 62.043	\$ 3.622	\$ 10
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.136	344	1
NIW je Anteil	\$ 10,11	\$ 10,53	\$ 10,33
ausschüttend	\$ 418	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	45	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	\$ 9,34	k. A.	k. A.
Class Z EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 9	€ 10	€ 10
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	1
NIW je Anteil	€ 10,21	€ 10,79	€ 10,59
Low Duration Opportunities Fund			
Nettovermögen	\$ 1.345.781	\$ 3.217.260	\$ 2.644.601
Institutional:			
thesaurierend	\$ 61.036	\$ 142.348	\$ 96.148
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.569	12.027	8.110
NIW je Anteil	\$ 10,96	\$ 11,84	\$ 11,86
ausschüttend	\$ 33.224	\$ 41.508	\$ 8.606
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.555	4.051	830
NIW je Anteil	\$ 9,35	\$ 10,25	\$ 10,37
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 23.753	€ 41.652	€ 54.549
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.478	3.940	5.108
NIW je Anteil	€ 9,58	€ 10,57	€ 10,68
ausschüttend	€ 10.599	€ 12.374	€ 27.239
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.244	1.297	2.796
NIW je Anteil	€ 8,52	€ 9,54	€ 9,74
Institutional GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 713.035	£ 1.734.093	£ 1.417.923
ausgegebene und umlaufende Anteile	69.498	155.485	126.639
NIW je Anteil	£ 10,26	£ 11,15	£ 11,20
ausschüttend	£ 288.970	£ 447.455	£ 352.374
ausgegebene und umlaufende Anteile	31.985	44.752	34.734
NIW je Anteil	£ 9,03	£ 10,00	£ 10,14
Investor EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 4.406	€ 8.109	€ 10.572
ausgegebene und umlaufende Anteile	485	806	1.036
NIW je Anteil	€ 9,09	€ 10,06	€ 10,20
Class E EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 3.102	€ 4.360	€ 5.666
ausgegebene und umlaufende Anteile	350	443	566
NIW je Anteil	€ 8,86	€ 9,84	€ 10,01
Class Z:			
thesaurierend	\$ 1.534	\$ 2.989	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	166	301	k. A.
NIW je Anteil	\$ 9,24	\$ 9,93	k. A.

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021	Zum 31. Dez. 2020
Low Duration Opportunities ESG Fund			
Nettovermögen	\$ 4.928	k. A.	k. A.
Institutional:			
thesaurierend	\$ 4.426	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	446	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	\$ 9,90	k. A.	k. A.
ausschüttend	\$ 10	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	\$ 9,81	k. A.	k. A.
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 225	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	23	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	€ 9,78	k. A.	k. A.
ausschüttend	€ 9	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	€ 9,69	k. A.	k. A.
Institutional GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 194	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	20	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	£ 9,85	k. A.	k. A.
ausschüttend	£ 8	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	£ 9,75	k. A.	k. A.
PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund			
Nettovermögen	\$ 120.137	\$ 100.538	\$ 77.631
Institutional:			
thesaurierend	\$ 21.492	\$ 21.487	\$ 22.753
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.114	2.658	4.069
NIW je Anteil	\$ 10,17	\$ 8,08	\$ 5,59
ausschüttend	\$ 10.469	\$ 29.680	\$ 30.040
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.678	5.697	7.885
NIW je Anteil	\$ 6,24	\$ 5,21	\$ 3,81
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 41.892	€ 19.141	€ 7.987
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.844	2.714	1.623
NIW je Anteil	€ 8,65	€ 7,05	€ 4,92
ausschüttend	€ 3.309	€ 2.062	€ 1.546
ausgegebene und umlaufende Anteile	625	455	461
NIW je Anteil	€ 5,29	€ 4,54	€ 3,36
Institutional GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 1.415	£ 1.362	£ 961
ausgegebene und umlaufende Anteile	162	193	195
NIW je Anteil	£ 8,76	£ 7,07	£ 4,93
ausschüttend	k. A.	£ 25	£ 101
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	5	30
NIW je Anteil	k. A.	£ 4,51	£ 3,34
Investor:			
thesaurierend	k. A.	\$ 1.183	\$ 1.179
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	117	168
NIW je Anteil	k. A.	\$ 10,09	\$ 7,00
ausschüttend	k. A.	k. A.	\$ 7
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	1
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	\$ 5,76
Investor EUR (Hedged):			
thesaurierend	k. A.	k. A.	€ 24
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	4
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	€ 6,55
Class E:			
ausschüttend	\$ 23.893	\$ 10.905	\$ 4.830
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.223	2.287	1.368
NIW je Anteil	\$ 5,66	\$ 4,77	\$ 3,53

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021	Zum 31. Dez. 2020
PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund (Fortsetzung)			
Class Z:			
thesaurierend	\$ 14.340	\$ 11.293	\$ 5.677
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.113	1.113	818
NIW je Anteil	\$ 12,88	\$ 10,14	\$ 6,94
Mortgage Opportunities Fund			
Nettovermögen	\$ 849.148	\$ 2.238.424	\$ 1.977.007
Institutional:			
thesaurierend	\$ 409.011	\$ 558.563	\$ 491.609
ausgegebene und umlaufende Anteile	38.104	47.581	42.776
NIW je Anteil	\$ 10,73	\$ 11,74	\$ 11,49
ausschüttend	\$ 94.373	\$ 351.769	\$ 285.533
ausgegebene und umlaufende Anteile	10.759	35.231	28.386
NIW je Anteil	\$ 8,77	\$ 9,98	\$ 10,06
Institutional CAD (Hedged):			
thesaurierend	CAD 23.438	CAD 25.659	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.532	2.532	k. A.
NIW je Anteil	CAD 9,26	CAD 10,14	k. A.
Institutional CHF (Hedged):			
thesaurierend	CHF 3.010	CHF 5.577	CHF 6.951
ausgegebene und umlaufende Anteile	322	532	670
NIW je Anteil	CHF 9,34	CHF 10,47	CHF 10,37
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 192.977	€ 317.357	€ 330.507
ausgegebene und umlaufende Anteile	20.209	29.769	31.397
NIW je Anteil	€ 9,55	€ 10,66	€ 10,53
ausschüttend	€ 14.970	€ 26.722	€ 9.571
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.923	2.953	1.041
NIW je Anteil	€ 7,78	€ 9,05	€ 9,20
Institutional GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 7.355	£ 19.288	£ 7.971
ausgegebene und umlaufende Anteile	727	1.733	730
NIW je Anteil	£ 10,12	£ 11,13	£ 10,92
ausschüttend	£ 6.104	£ 5.764	£ 11.380
ausgegebene und umlaufende Anteile	740	609	1.192
NIW je Anteil	£ 8,25	£ 9,46	£ 9,55
Investor:			
thesaurierend	\$ 20.219	\$ 32.611	\$ 49.987
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.963	2.885	4.499
NIW je Anteil	\$ 10,30	\$ 11,30	\$ 11,11
ausschüttend	\$ 4.762	\$ 19.104	\$ 12.072
ausgegebene und umlaufende Anteile	543	1.914	1.200
NIW je Anteil	\$ 8,77	\$ 9,98	\$ 10,06
Administrative:			
ausschüttend	\$ 44	\$ 540	\$ 544
ausgegebene und umlaufende Anteile	5	54	54
NIW je Anteil	\$ 8,77	\$ 9,98	\$ 10,06
Class E:			
thesaurierend	\$ 43.823	\$ 58.797	\$ 65.293
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.304	5.232	5.878
NIW je Anteil	\$ 10,18	\$ 11,24	\$ 11,11
ausschüttend	\$ 4.351	\$ 10.154	\$ 10.765
ausgegebene und umlaufende Anteile	496	1.017	1.070
NIW je Anteil	\$ 8,77	\$ 9,99	\$ 10,06
Class E CHF (Hedged):			
ausschüttend	CHF 166	CHF 319	CHF 338
ausgegebene und umlaufende Anteile	22	36	38
NIW je Anteil	CHF 7,55	CHF 8,82	CHF 8,98
Class E EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 12.803	€ 16.220	€ 18.176
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.415	1.591	1.788
NIW je Anteil	€ 9,05	€ 10,20	€ 10,16

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021	Zum 31. Dez. 2020
Mortgage Opportunities Fund (Fortsetzung)			
ausschüttend	k. A.	€ 151	€ 131
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	17	14
NIW je Anteil	k. A.	€ 8,98	€ 9,13
Class E SGD (Hedged):			
thesaurierend	k. A.	k. A.	SGD 15
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	1
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	SGD 10,63
ausschüttend	k. A.	SGD 1.645	SGD 2.135
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	168	217
NIW je Anteil	k. A.	SGD 9,78	SGD 9,85
H Institutional:			
thesaurierend	\$ 39	\$ 71	\$ 11
ausgegebene und umlaufende Anteile	4	7	1
NIW je Anteil	\$ 9,88	\$ 10,83	\$ 10,62
Class Z:			
thesaurierend	\$ 10	\$ 214.716	\$ 74.635
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	19.628	7.012,00
NIW je Anteil	\$ 9,78	\$ 10,94	\$ 10,64
Class Z GBP (Hedged):			
thesaurierend	k. A.	£ 384.109	£ 374.361
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	34.658	34.658
NIW je Anteil	k. A.	£ 11,08	£ 10,80
StocksPLUS™ Fund			
Nettovermögen	\$ 1.008.739	\$ 3.761.156	\$ 3.538.833
Institutional:			
thesaurierend	\$ 581.668	\$ 2.349.757	\$ 2.530.233
ausgegebene und umlaufende Anteile	12.422	39.164	53.956
NIW je Anteil	\$ 46,83	\$ 60,00	\$ 46,89
ausschüttend	\$ 24.829	\$ 39.901	\$ 45.032
ausgegebene und umlaufende Anteile	734	913	1.319
NIW je Anteil	\$ 33,81	\$ 43,69	\$ 34,14
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 131.649	€ 570.050	€ 530.048
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.953	16.237	19.143
NIW je Anteil	€ 26,58	€ 35,11	€ 27,69
ausschüttend	k. A.	€ 2.081	€ 1.636
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	68	68
NIW je Anteil	k. A.	€ 30,66	€ 24,18
Institutional GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 3.922	£ 199	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	456	18	k. A.
NIW je Anteil	£ 8,60	£ 11,28	k. A.
Institutional SGD (Hedged):			
thesaurierend	SGD 335	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	38	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	SGD 8,76	k. A.	k. A.
Investor:			
thesaurierend	\$ 19.778	\$ 21.609	\$ 18.615
ausgegebene und umlaufende Anteile	458	389	428
NIW je Anteil	\$ 43,17	\$ 55,51	\$ 43,53
BE Retail:			
thesaurierend	\$ 9	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	\$ 8,66	k. A.	k. A.
Class E:			
thesaurierend	\$ 165.517	\$ 175.651	\$ 91.242
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.087	3.355	2.210
NIW je Anteil	\$ 40,50	\$ 52,35	\$ 41,29
Class E EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 35.366	€ 13.927	€ 9.527
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.632	777	668
NIW je Anteil	€ 13,44	€ 17,91	€ 14,25

Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021	Zum 31. Dez. 2020
StocksPLUS™ Fund (Fortsetzung)			
H Institutional:			
thesaurierend	\$ 33.724	\$ 504.831	\$ 189.133
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.884	33.635	16.101
NIW je Anteil	\$ 11,69	\$ 15,01	\$ 11,75
Class T:			
thesaurierend	k. A.	\$ 2.673	\$ 2.380
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	124	140
NIW je Anteil	k. A.	\$ 21,50	\$ 17,03
PIMCO StocksPLUS™ AR Fund			
Nettovermögen	\$ 9.528	\$ 11.610	\$ 8.417
Institutional:			
thesaurierend	\$ 9.327	\$ 10.848	\$ 8.021
ausgegebene und umlaufende Anteile	663	603	570
NIW je Anteil	\$ 14,07	\$ 17,97	\$ 14,09
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	k. A.	€ 405	€ 312
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	24	23
NIW je Anteil	k. A.	€ 17,09	€ 13,52
Institutional GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 167	£ 198	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	19	18	k. A.
NIW je Anteil	£ 8,59	£ 11,24	k. A.
Class E:			
thesaurierend	k. A.	\$ 34	\$ 14
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	2	1
NIW je Anteil	k. A.	\$ 17,53	\$ 13,87
Strategic Income Fund			
Nettovermögen	\$ 506.557	\$ 619.928	\$ 974.664
Institutional:			
thesaurierend	\$ 21.761	\$ 33.080	\$ 35.112
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.939	2.754	3.118
NIW je Anteil	\$ 11,22	\$ 12,01	\$ 11,26
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 168.023	€ 207.426	€ 453.622
ausgegebene und umlaufende Anteile	13.134	14.906	34.652
NIW je Anteil	€ 12,79	€ 13,92	€ 13,09
Institutional GBP (Hedged):			
ausschüttend	£ 201	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	21	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	£ 9,67	k. A.	k. A.
Class E:			
thesaurierend	\$ 37.001	\$ 35.991	\$ 33.128
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.786	2.509	2.441
NIW je Anteil	\$ 13,28	\$ 14,34	\$ 13,57
ausschüttend II	\$ 18.150	\$ 18.959	\$ 18.919
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.989	1.828	1.848
NIW je Anteil	\$ 9,13	\$ 10,37	\$ 10,24
Class E EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 133.817	€ 140.034	€ 143.937
ausgegebene und umlaufende Anteile	11.367	10.837	11.731
NIW je Anteil	€ 11,77	€ 12,92	€ 12,27
ausschüttend II	€ 76.984	€ 94.373	€ 102.667
ausgegebene und umlaufende Anteile	9.528	10.105	11.093
NIW je Anteil	€ 8,08	€ 9,34	€ 9,25
Class T EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 15.503	€ 17.708	€ 17.321
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.475	1.529	1.569
NIW je Anteil	€ 10,51	€ 11,58	€ 11,04
ausschüttend	€ 8.019	€ 8.185	€ 7.803
ausgegebene und umlaufende Anteile	908	817	800
NIW je Anteil	€ 8,83	€ 10,02	€ 9,76

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021	Zum 31. Dez. 2020
Total Return Bond Fund			
Nettovermögen	\$ 4.150.717	\$ 4.944.898	\$ 6.424.053
Institutional:			
thesaurierend	\$ 1.419.973	\$ 1.598.195	\$ 1.930.542
ausgegebene und umlaufende Anteile	49.161	46.882	55.944
NIW je Anteil	\$ 28,88	\$ 34,09	\$ 34,51
ausschüttend	\$ 112.085	\$ 174.533	\$ 187.163
ausgegebene und umlaufende Anteile	7.634	9.829	10.216
NIW je Anteil	\$ 14,68	\$ 17,76	\$ 18,32
Institutional CAD (Hedged):			
ausschüttend	CAD 13.555	CAD 26.323	CAD 26.735
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.587	2.540	2.497
NIW je Anteil	CAD 8,54	CAD 10,36	CAD 10,70
Institutional CHF (Hedged):			
thesaurierend	CHF 3.138	CHF 13.206	CHF 16.880
ausgegebene und umlaufende Anteile	320	1.111	1.388
NIW je Anteil	CHF 9,79	CHF 11,88	CHF 12,16
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 388.231	€ 358.693	€ 495.828
ausgegebene und umlaufende Anteile	20.056	15.344	20.771
NIW je Anteil	€ 19,36	€ 23,38	€ 23,87
ausschüttend	€ 212.408	€ 260.110	€ 216.306
ausgegebene und umlaufende Anteile	18.120	17.931	14.322
NIW je Anteil	€ 11,72	€ 14,51	€ 15,10
Institutional EUR (Unhedged):			
thesaurierend	€ 19.929	€ 14.618	€ 33.888
ausgegebene und umlaufende Anteile	736	488	1.202
NIW je Anteil	€ 27,06	€ 29,97	€ 28,20
Institutional GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 3.621	£ 5.534	£ 9.730
ausgegebene und umlaufende Anteile	296	379	658
NIW je Anteil	£ 12,24	£ 14,59	£ 14,80
ausschüttend	£ 29.067	£ 43.763	£ 39.302
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.543	4.355	3.783
NIW je Anteil	£ 8,20	£ 10,05	£ 10,39
Institutional ILS (Hedged):			
thesaurierend	k. A.	ILS 185	ILS 578
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	13	39
NIW je Anteil	k. A.	ILS 14,41	ILS 14,67
Institutional SGD (Hedged):			
thesaurierend	SGD 7.941	SGD 21.940	SGD 19.222
ausgegebene und umlaufende Anteile	652	1.524	1.320
NIW je Anteil	SGD 12,17	SGD 14,40	SGD 14,57
Investor:			
thesaurierend	\$ 409.533	\$ 369.122	\$ 573.009
ausgegebene und umlaufende Anteile	15.440	11.750	17.957
NIW je Anteil	\$ 26,52	\$ 31,41	\$ 31,91
ausschüttend	\$ 67.693	\$ 35.775	\$ 129.625
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.545	1.987	6.977
NIW je Anteil	\$ 14,89	\$ 18,01	\$ 18,58
Investor CHF (Hedged):			
thesaurierend	CHF 2.893	CHF 4.784	CHF 6.265
ausgegebene und umlaufende Anteile	307	417	532
NIW je Anteil	CHF 9,41	CHF 11,46	CHF 11,77

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021	Zum 31. Dez. 2020
	Total Return Bond Fund (Fortsetzung)		
Investor EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 18.868	€ 19.262	€ 27.120
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.038	874	1.201
NIW je Anteil	€ 18,18	€ 22,03	€ 22,58
Administrative:			
thesaurierend	\$ 130.283	\$ 159.690	\$ 188.750
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.975	5.141	5.973
NIW je Anteil	\$ 26,19	\$ 31,06	\$ 31,60
ausschüttend	\$ 4.583	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	482	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	\$ 9,51	k. A.	k. A.
Administrative EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 2.966	€ 1.953	€ 3.742
ausgegebene und umlaufende Anteile	273	148	277
NIW je Anteil	€ 10,84	€ 13,16	€ 13,51
Class E:			
thesaurierend	\$ 380.803	\$ 478.210	\$ 676.175
ausgegebene und umlaufende Anteile	15.332	16.167	22.380
NIW je Anteil	\$ 24,84	\$ 29,58	\$ 30,21
ausschüttend	\$ 151.164	\$ 199.962	\$ 243.049
ausgegebene und umlaufende Anteile	13.526	14.801	17.436
NIW je Anteil	\$ 11,18	\$ 13,51	\$ 13,94
Class E CHF (Hedged):			
thesaurierend	CHF 9.731	CHF 5.648	CHF 6.592
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.166	553	625
NIW je Anteil	CHF 8,34	CHF 10,22	CHF 10,55
Class E EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 471.035	€ 623.265	€ 833.038
ausgegebene und umlaufende Anteile	28.276	30.705	39.827
NIW je Anteil	€ 16,66	€ 20,30	€ 20,92
ausschüttend	€ 40.476	€ 54.687	€ 74.430
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.177	5.655	7.393
NIW je Anteil	€ 7,82	€ 9,67	€ 10,07
Class E EUR (Unhedged):			
thesaurierend	€ 489	€ 710	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	51	67	k. A.
NIW je Anteil	€ 9,53	€ 10,65	k. A.
Class E HKD (Unhedged):			
thesaurierend	HKD 1.568	HKD 3.128	HKD 2.773
ausgegebene und umlaufende Anteile	155	259	226
NIW je Anteil	HKD 10,15	HKD 12,07	HKD 12,26
Class E SGD (Hedged):			
thesaurierend	SGD 30.035	SGD 38.699	SGD 42.772
ausgegebene und umlaufende Anteile	828	894	968
NIW je Anteil	SGD 36,28	SGD 43,30	SGD 44,20
H Institutional:			
thesaurierend	\$ 115.199	\$ 199.555	\$ 205.400
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.116	6.033	6.124
NIW je Anteil	\$ 27,98	\$ 33,08	\$ 33,54
ausschüttend	\$ 8.589	\$ 17.255	\$ 15.468
ausgegebene und umlaufende Anteile	954	1.585	1.377
NIW je Anteil	\$ 9,00	\$ 10,89	\$ 11,23
M Retail HKD (Unhedged):			
ausschüttend	HKD 76.242	HKD 91.252	HKD 96.768
ausgegebene und umlaufende Anteile	8.622	8.552	8.838
NIW je Anteil	HKD 8,84	HKD 10,67	HKD 10,95
Class R EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 2.836	€ 5.974	€ 5.521
ausgegebene und umlaufende Anteile	308	535	483
NIW je Anteil	€ 9,22	€ 11,16	€ 11,43

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021	Zum 31. Dez. 2020
	Total Return Bond Fund (Fortsetzung)		
Class T:			
thesaurierend	\$ 6.382	\$ 13.697	\$ 18.261
ausgegebene und umlaufende Anteile	652	1.172	1.525
NIW je Anteil	\$ 9,79	\$ 11,69	\$ 11,97
Class T EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 4.426	€ 4.561	€ 6.041
ausgegebene und umlaufende Anteile	518	437	560
NIW je Anteil	€ 8,54	€ 10,44	€ 10,79
	PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund		
Nettovermögen	\$ 435.924	\$ 101.789	\$ 47.221
Institutional:			
thesaurierend	\$ 183.555	\$ 70.982	\$ 24.193
ausgegebene und umlaufende Anteile	14.361	6.152	2.142
NIW je Anteil	\$ 12,78	\$ 11,54	\$ 11,30
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 121.520	€ 11.436	€ 12.591
ausgegebene und umlaufende Anteile	10.765	1.108	1.236
NIW je Anteil	€ 11,29	€ 10,32	€ 10,19
Institutional GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 9	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	£ 9,88	k. A.	k. A.
ausschüttend	£ 31.132	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.333	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	£ 9,34	k. A.	k. A.
Investor:			
thesaurierend	\$ 9	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	\$ 9,43	k. A.	k. A.
Investor EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 9	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	€ 9,39	k. A.	k. A.
Class E:			
thesaurierend	\$ 11.079	\$ 2.886	\$ 6.232
ausgegebene und umlaufende Anteile	941	269	586
NIW je Anteil	\$ 11,78	\$ 10,74	\$ 10,63
Class E EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 17.465	€ 1.747	€ 1.136
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.680	182	118
NIW je Anteil	€ 10,40	€ 9,61	€ 9,60
H Institutional:			
thesaurierend	\$ 43	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	4	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	\$ 10,13	k. A.	k. A.
Class Z:			
thesaurierend	\$ 55.435	\$ 12.929	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.958	1.299	k. A.
NIW je Anteil	\$ 11,18	\$ 9,95	k. A.
	UK Corporate Bond Fund		
Nettovermögen	£ 389.173	£ 592.164	£ 764.359
Institutional:			
thesaurierend	£ 46.355	£ 75.231	£ 139.232
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.532	3.348	6.000
NIW je Anteil	£ 18,31	£ 22,47	£ 23,20
ausschüttend	£ 276.939	£ 436.466	£ 542.403
ausgegebene und umlaufende Anteile	32.956	41.393	49.002
NIW je Anteil	£ 8,40	£ 10,54	£ 11,07

Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021	Zum 31. Dez. 2020
UK Corporate Bond Fund (Fortsetzung)			
H Institutional:			
ausschüttend	k. A.	k. A.	9
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	1
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	10,28
Class Z:			
thesaurierend	£ 65.879	£ 80.467	£ 82.715
ausgegebene und umlaufende Anteile	7.715	7.715	7.715
NIW je Anteil	£ 8,54	£ 10,43	£ 10,72
UK Long Term Corporate Bond Fund			
Nettovermögen	£ 325.020	£ 425.748	£ 364.631
Institutional:			
thesaurierend	£ 283.958	£ 366.869	£ 300.422
ausgegebene und umlaufende Anteile	14.455	13.155	10.335
NIW je Anteil	£ 19,65	£ 27,89	£ 29,07
ausschüttend	£ 41.062	£ 58.879	£ 64.209
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.656	3.578	3.656
NIW je Anteil	£ 11,23	£ 16,45	£ 17,56
US High Yield Bond Fund			
Nettovermögen	\$ 1.984.922	\$ 3.923.786	\$ 4.054.927
Institutional:			
thesaurierend	\$ 780.024	\$ 1.665.090	\$ 2.254.396
ausgegebene und umlaufende Anteile	21.785	40.803	57.680
NIW je Anteil	\$ 35,80	\$ 40,81	\$ 39,09
ausschüttend	\$ 233.780	\$ 400.716	\$ 319.414
ausgegebene und umlaufende Anteile	27.877	39.668	31.532
NIW je Anteil	\$ 8,39	\$ 10,10	\$ 10,13
Institutional CHF (Hedged):			
thesaurierend	k. A.	CHF 2.738	CHF 2.604
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	222	218
NIW je Anteil	k. A.	CHF 12,33	CHF 11,94
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 240.268	€ 482.095	€ 297.614
ausgegebene und umlaufende Anteile	8.811	15.170	9.695
NIW je Anteil	€ 27,27	€ 31,78	€ 30,70
ausschüttend	€ 33.678	€ 138.522	€ 126.166
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.520	11.751	10.575
NIW je Anteil	€ 9,57	€ 11,79	€ 11,93
Institutional GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 40.143	£ 48.533	£ 41.967
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.913	2.009	1.809
NIW je Anteil	£ 20,99	£ 24,16	£ 23,20
ausschüttend	£ 1.108	£ 5.115	£ 7.216
ausgegebene und umlaufende Anteile	138	522	731
NIW je Anteil	£ 8,04	£ 9,80	£ 9,86
Institutional SGD (Hedged):			
thesaurierend	k. A.	SGD 374	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	37	k. A.
NIW je Anteil	k. A.	SGD 10,10	k. A.
Investor:			
thesaurierend	\$ 236.934	\$ 434.782	\$ 307.813
ausgegebene und umlaufende Anteile	7.413	11.894	8.760
NIW je Anteil	\$ 31,96	\$ 36,56	\$ 35,14
ausschüttend	\$ 20.862	\$ 37.431	\$ 31.926
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.073	4.581	3.897
NIW je Anteil	\$ 6,79	\$ 8,17	\$ 8,19
Investor EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 2.708	€ 3.173	€ 3.819
ausgegebene und umlaufende Anteile	110	110	137
NIW je Anteil	€ 24,59	€ 28,78	€ 27,89

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021	Zum 31. Dez. 2020
US High Yield Bond Fund (Fortsetzung)			
Class E:			
thesaurierend	\$ 132.559	\$ 225.933	\$ 203.678
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.302	6.375	5.947
NIW je Anteil	\$ 30,82	\$ 35,44	\$ 34,25
ausschüttend	\$ 58.679	\$ 124.742	\$ 103.491
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.557	11.581	9.577
NIW je Anteil	\$ 8,95	\$ 10,77	\$ 10,81
Class E EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 56.406	€ 77.393	€ 84.948
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.407	2.808	3.162
NIW je Anteil	€ 23,44	€ 27,56	€ 26,86
H Institutional:			
thesaurierend	\$ 88.253	\$ 139.658	\$ 112.228
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.548	3.532	2.958
NIW je Anteil	\$ 34,63	\$ 39,54	\$ 37,94
ausschüttend	\$ 2.482	\$ 3.370	\$ 2.484
ausgegebene und umlaufende Anteile	299	337	248
NIW je Anteil	\$ 8,29	\$ 9,99	\$ 10,01
M Retail:			
ausschüttend	\$ 12.265	\$ 4.154	\$ 8.103
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.351	381	740
NIW je Anteil	\$ 9,08	\$ 10,91	\$ 10,95
Class R:			
thesaurierend	\$ 5.477	\$ 4.914	\$ 4.885
ausgegebene und umlaufende Anteile	387	304	314
NIW je Anteil	\$ 14,17	\$ 16,18	\$ 15,54
Class Z:			
thesaurierend	\$ 8.528	\$ 9.666	\$ 9.208
ausgegebene und umlaufende Anteile	661	661	661
NIW je Anteil	\$ 12,91	\$ 14,63	\$ 13,93
US Investment Grade Corporate Bond Fund			
Nettovermögen	\$ 388.522	\$ 878.100	\$ 1.180.148
Institutional:			
thesaurierend	\$ 151.061	\$ 132.646	\$ 247.764
ausgegebene und umlaufende Anteile	14.307	10.461	19.215
NIW je Anteil	\$ 10,56	\$ 12,68	\$ 12,89
ausschüttend	\$ 61.577	\$ 63.781	\$ 93.048
ausgegebene und umlaufende Anteile	7.201	5.999	8.352
NIW je Anteil	\$ 8,55	\$ 10,63	\$ 11,14
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 124.155	€ 214.560	€ 276.920
ausgegebene und umlaufende Anteile	13.447	18.908	23.784
NIW je Anteil	€ 9,23	€ 11,35	€ 11,64
Institutional GBP (Hedged):			
ausschüttend II	£ 13.692	£ 304.200	£ 336.589
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.794	31.489	33.002
NIW je Anteil	£ 7,63	£ 9,66	£ 10,20
Class E:			
thesaurierend	\$ 21.852	\$ 17.627	\$ 27.163
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.504	1.667	2.503
NIW je Anteil	\$ 8,73	\$ 10,58	\$ 10,85
ausschüttend	\$ 5.002	\$ 8.025	\$ 13.248
ausgegebene und umlaufende Anteile	576	743	1.170
NIW je Anteil	\$ 8,68	\$ 10,80	\$ 11,32
H Institutional:			
thesaurierend	\$ 55	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	6	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	\$ 9,73	k. A.	k. A.

	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021	Zum 31. Dez. 2020
Nettovermögen	\$ 2.310.115	\$ 2.650.198	\$ 3.654.185
Institutional:			
thesaurierend	\$ 865.421	\$ 835.096	\$ 1.571.393
ausgegebene und umlaufende Anteile	76.197	73.558	138.207
NIW je Anteil	\$ 11,36	\$ 11,35	\$ 11,37
ausschüttend	\$ 131.027	\$ 102.552	\$ 197.384
ausgegebene und umlaufende Anteile	13.207	10.172	19.443
NIW je Anteil	\$ 9,92	\$ 10,08	\$ 10,15
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 202.833	€ 233.199	€ 255.291
ausgegebene und umlaufende Anteile	20.470	23.092	25.034
NIW je Anteil	€ 9,91	€ 10,10	€ 10,20
Investor:			
thesaurierend	\$ 12.829	\$ 18.474	\$ 21.612
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.164	1.671	1.945
NIW je Anteil	\$ 11,02	\$ 11,06	\$ 11,11
Class E:			
thesaurierend	\$ 412.347	\$ 467.026	\$ 558.194
ausgegebene und umlaufende Anteile	37.521	42.334	50.327
NIW je Anteil	\$ 10,99	\$ 11,03	\$ 11,09
Class E EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 44.471	€ 9.227	€ 11.970
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.656	944	1.208
NIW je Anteil	€ 9,55	€ 9,77	€ 9,91
H Institutional:			
thesaurierend	\$ 22.367	\$ 33.914	\$ 14.591
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.147	3.250	1.394
NIW je Anteil	\$ 10,42	\$ 10,44	\$ 10,47
Class Z:			
ausschüttend	\$ 602.189	\$ 917.450	\$ 964.005
ausgegebene und umlaufende Anteile	60.375	90.541	94.476
NIW je Anteil	\$ 9,97	\$ 10,13	\$ 10,20

20. RECHTSSTREITIGKEITEN UND AUFSICHTSRECHTLICHE ANGELEGENHEITEN

Die Gesellschaft ist nicht als Beklagte an wesentlichen Rechtsstreitigkeiten oder Schiedsverfahren beteiligt und ihr sind etwaige solche gegen sie bestehenden oder drohenden wesentlichen Rechtsstreitigkeiten oder Schadensersatzforderungen nicht bekannt.

Die vorangehenden Ausführungen gelten lediglich zum 31. Dezember 2022.

21. KREDITFAZILITÄT

PIMCO Funds: Global Investors Series plc hat im Namen des Global High Yield Bond Fund und des US High Yield Bond Fund (die „Fonds“ und jeder ein „Fonds“) eine dritte geänderte und neu gefasste Kreditfazilität mit Datum vom 19. August 2022 (die „Kreditvereinbarung“) abgeschlossen, unter anderem zwischen den Fonds, bestimmten Kreditgebern, darunter MUFG Bank Ltd. („MUFG“) (als Kreditgeber) und MUFG in ihrer Eigenschaft als Agent und Lead Arranger.

Jeder Fonds darf die Fazilität für temporäre Zwecke nutzen, um Rücknahmen durch Anteilinhaber zu finanzieren, sowie für andere kurzfristige Liquiditätszwecke, die gemäß seiner Anlagepolitik zulässig sind.

Der Gesamtbetrag, der für eine Nutzung durch die Fonds zur Verfügung steht, beläuft sich vorbehaltlich der Bestimmungen der Kreditvereinbarung auf USD 285.000.000. Der Gesamtbetrag, der den Fonds zusammen mit den anderen Kreditnehmern (zusammen die „Kreditnehmer“) zur Verfügung steht, unterliegt den Bedingungen der Kreditvereinbarung und beträgt 300.500.000 USD (der „zugesagte Gesamtbetrag“). Die Kreditnehmer können vorbehaltlich der Bedingungen der Kreditvereinbarung eine Erhöhung um bis zu 299.500.000 USD des zugesagten Gesamtbetrags beantragen. Dieser erhöhte zugesagte Betrag würde den Kreditnehmern zur Inanspruchnahme gemäß den Bestimmungen der Kreditvereinbarung zur Verfügung stehen.

Die Kreditvereinbarung sieht zwei verschiedene Zinssätze vor. Bei der Inanspruchnahme eines Kredits entscheidet jeder Fonds, welcher Zinssatz für den gesamten oder einen Teil des jeweiligen Kredits gilt. Hierbei wird der geltende Zinssatz durch Bezugnahme auf (i) die Alternate Base Rate (den alternativen Basiszinssatz) oder (ii) die Adjusted Daily Simple SOFR (die angepasste tägliche einfache SOFR) bestimmt.

Der alternative Basiszinssatz ist für jeden Tag entweder die (i) Federal Funds Rate (gemäß Definition in der Kreditvereinbarung) oder (ii) die Overnight Bank Funding Rate (gemäß Definition in der Kreditvereinbarung), je nachdem, welcher Wert höher ist. Jeder auf der Grundlage des alternativen Basiszinssatzes verzinsten Kredit wird für den ausstehenden Kapitalbetrag für den Zeitraum ab dem Tag, an dem der Kredit gewährt wird, bis zu dem Tag, an dem der Kredit vollständig zurückgezahlt wird, mit einem jährlichen Zinssatz verzinst, der dem alternativen Basiszinssatz zuzüglich der anwendbaren Marge (1,125 %) entspricht.

Die angepasste tägliche einfache SOFR ist ein jährlicher Zinssatz, der (a) der täglichen einfachen SOFR (gemäß Definition in der Kreditvereinbarung) zuzüglich (b) 0,10 % entspricht. Jeder auf der Grundlage der angepassten täglichen einfachen SOFR verzinsten Kredit wird für den ausstehenden Kapitalbetrag ab dem Tag, an dem der Kredit gewährt oder fortgesetzt wird, bis einschließlich zu dem Tag, an dem der Kredit vollständig zurückgezahlt wird, zu einem jährlichen Satz verzinst, der der angepassten täglichen einfachen SOFR zuzüglich der anwendbaren Marge (1,125 %) entspricht.

Jeder Kredit ist, vorbehaltlich der Bedingungen der Kreditvereinbarung, innerhalb von 60 Tagen nach Inanspruchnahme rückzahlbar.

Sämtliche Kredite werden auf unbesicherter Basis gewährt, und der Rückgriff der Kreditgeber gegenüber einem Fonds ist auf die Vermögenswerte des betreffenden Fonds beschränkt.

Zum 31. Dezember 2022 und zum 31. Dezember 2021 hatte keiner der Fonds im Rahmen der Kreditvereinbarung Kredite in Anspruch genommen.

22. VERORDNUNG ÜBER WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTE

Die Richtlinie über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (Securities Financing Transactions Regulation, „SFTR“) führt Melde- und Offenlegungspflichten für Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (Securities Financing Transactions, „SFTs“) und Total Return Swaps ein. SFTs sind gemäß Artikel 3(11) der SFTR folgendermaßen konkret definiert:

- Pensionsgeschäfte/umgekehrte Pensionsgeschäfte
- Wertpapier- oder Rohstoffleihgeschäfte
- Buy-Sellback- oder Sale-Buyback-Geschäfte
- Lombardgeschäfte

(a) Globale Daten und Konzentration von SFT-Kontrahenten

Zum 31. Dezember 2022 hielten die Fonds Total Return Swaps und die folgenden Arten von SFTs:

- Pensionsgeschäfte
- Umgekehrte Pensionsgeschäfte
- Sale-Buyback-Geschäfte

Der Marktwert von Vermögenswerten/(Verbindlichkeiten) über alle SFTs und Total Return Swaps hinweg, jeweils gruppiert nach SFT-Art(en), und die zehn größten Kontrahenten gestalteten sich zum 31. Dezember 2022 wie nachfolgend angegeben (wenn weniger als zehn Kontrahenten verwendet werden, sind alle Kontrahenten aufgeführt).

Fonds	31. Dez. 2022	
	Marktwert (000S)	% des Nettovermögens
PIMCO Asia High Yield Bond Fund Pensionsgeschäfte SSB	\$ 20.572	0,69
Asia Strategic Interest Bond Fund Pensionsgeschäfte SSB	\$ 820	0,26

Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

Fonds	31. Dez. 2022	
	Marktwert (000\$)	% des Nettvermögens
PIMCO Capital Securities Fund		
Pensionsgeschäfte		
FICC	\$ 10.172	0,18
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BPS	(71.348)	(1,25)
BRC	(4.860)	(0,08)
BYR	(59.977)	(1,05)
FBF	(2.857)	(0,05)
IND	(171.111)	(2,98)
JML	(135.138)	(2,36)
SCX	(133.184)	(2,34)
Summe	(578.475)	(10,11)
PIMCO Climate Bond Fund		
Pensionsgeschäfte		
TDM	\$ 36.800	12,57
Commodity Real Return Fund		
Total Return Swaps		
BPS	\$ (2.955)	(0,21)
CBK	(2.457)	(0,18)
CIB	(334)	(0,02)
FBF	(181)	(0,01)
GST	(3.476)	(0,25)
JPM	(345)	(0,03)
MAC	1.137	0,08
MEI	(251)	(0,02)
SOG	(497)	(0,04)
Summe	(9.359)	(0,68)
Pensionsgeschäfte		
FICC	613	0,04
IND	58.500	4,28
Summe	59.113	4,32
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BOS	(485)	(0,04)
CIB	(331.976)	(24,23)
GRE	(67.687)	(4,94)
RCY	(25.154)	(1,84)
Summe	(425.302)	(31,05)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte		
BOS	(17.959)	(1,31)
PIMCO Credit Opportunities Bond Fund		
Total Return Swaps		
BPS	\$ (160)	(0,16)
Pensionsgeschäfte		
BPS	6.300	6,48
FICC	610	0,63
Summe	6.910	7,11
Diversified Income Fund		
Pensionsgeschäfte		
BOS	\$ 500.000	5,71
BRC	568.200	6,49
CIB	580.100	6,63
FICC	41.323	0,47
MBC	56.700	0,65
Summe	1.746.323	19,95
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BRC	(4.363)	(0,05)
JML	(2.283)	(0,03)
Summe	(6.646)	(0,08)
Diversified Income Duration Hedged Fund		
Pensionsgeschäfte		
FICC	\$ 102.832	18,21
Dynamic Bond Fund		
Pensionsgeschäfte		
BRC	\$ 1.055.700	30,31
FICC	2.892	0,08
SAL	87.100	2,50
Summe	1.145.692	32,89
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
DBL	(2.164)	(0,06)

Fonds	31. Dez. 2022	
	Marktwert (000\$)	% des Nettvermögens
Dynamic Multi-Asset Fund		
Total Return Swaps		
BPS	€ 440	0,01
JPM	146	0,00
MEI	80	0,00
Summe	666	0,01
Pensionsgeschäfte		
BPS	22.818	0,45
CDI	100.000	1,96
FICC	1.786	0,03
Summe	124.604	2,44
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BPS	(17.828)	(0,35)
Emerging Local Bond Fund		
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BPS	\$ (39.132)	(2,04)
BRC	(46.181)	(2,41)
Summe	(85.313)	(4,45)
Emerging Markets Bond Fund		
Pensionsgeschäfte		
FICC	\$ 9.160	0,28
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BPS	(36.659)	(1,11)
BRC	(16.023)	(0,48)
MBC	(1.622)	(0,05)
MEI	(21.052)	(0,64)
Summe	(75.356)	(2,28)
Emerging Markets Bond ESG Fund		
Pensionsgeschäfte		
FICC	\$ 9.261	0,37
NOM	35.400	1,42
Summe	44.661	1,79
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BPS	(21.023)	(0,84)
BRC	(6.168)	(0,25)
MEI	(4.460)	(0,18)
NOM	(7.189)	(0,29)
Summe	(38.840)	(1,56)
Emerging Markets Corporate Bond Fund		
Pensionsgeschäfte		
BPS	\$ 6.100	3,61
FICC	2.286	1,35
Summe	8.386	4,96
PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund		
Pensionsgeschäfte		
SSB	\$ 706	0,35
Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund		
Pensionsgeschäfte		
SAL	\$ 2.500	11,95
SSB	266	1,27
Summe	2.766	13,22
PIMCO ESG Income Fund		
Pensionsgeschäfte		
BPS	\$ 44.400	18,66
Euro Bond Fund		
Pensionsgeschäfte		
BPS	€ 10.900	0,57
FICC	615	0,03
Summe	11.515	0,60
Euro Credit Fund		
Pensionsgeschäfte		
BPS	€ 7.400	1,21
FICC	921	0,15
IND	36.300	5,95
Summe	44.621	7,31

Fonds	31. Dez. 2022	
	Marktwert (000S)	% des Nettovermögens
Euro Income Bond Fund		
Pensionsgeschäfte		
BPS	€ 16.600	1,23
COM	100.000	7,38
FICC	3.858	0,29
Summe	120.458	8,90
Euro Long Average Duration Fund		
Pensionsgeschäfte		
BPS	€ 1.500	1,36
Euro Short-Term Fund		
Pensionsgeschäfte		
BPS	€ 14.100	3,99
PIMCO European High Yield Bond Fund		
Pensionsgeschäfte		
BPS	€ 3.700	2,12
PIMCO European Short-Term Opportunities Fund		
Pensionsgeschäfte		
BPS	€ 4.400	2,08
Global Advantage Fund		
Pensionsgeschäfte		
FICC	\$ 1.408	0,34
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
MEI	(1.504)	(0,37)
Global Bond Fund		
Pensionsgeschäfte		
BPS	\$ 660.000	5,77
CIB	562.700	4,93
FICC	124.270	1,09
Summe	1.346.970	11,79
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
FBF	(1.682)	(0,01)
Global Bond ESG Fund		
Pensionsgeschäfte		
BPS	\$ 275.900	8,88
BRC	313.900	10,11
FICC	568.047	18,29
Summe	1.157.847	37,28
Global Bond Ex-US Fund		
Total Return Swaps		
BOA	\$ 182	0,03
BPS	315	0,04
MYC	21	0,00
Summe	518	0,07
Pensionsgeschäfte		
FICC	1.625	0,23
PIMCO Global Core Asset Allocation Fund		
Total Return Swaps		
BOA	\$ 384	0,05
BPS	62	0,01
BRC	(49)	(0,01)
GST	(2)	0,00
JPM	192	0,03
MBC	(33)	0,00
MEI	7	0,00
MYI	(122)	(0,03)
SOG	118	0,02
Summe	557	0,07
Pensionsgeschäfte		
BPS	7.300	0,97
FICC	11.236	1,50
Summe	18.536	2,47

Fonds	31. Dez. 2022	
	Marktwert (000S)	% des Nettovermögens
Global High Yield Bond Fund		
Pensionsgeschäfte		
FICC	\$ 7.812	0,25
NOM	3.600	0,12
Summe	11.412	0,37
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BRC	(5.516)	(0,18)
FBF	(2.419)	(0,08)
JML	(2.462)	(0,08)
Summe	(10.397)	(0,34)
Global Investment Grade Credit Fund		
Pensionsgeschäfte		
DEU	\$ 30.800	0,29
FICC	29.223	0,28
SAL	15.400	0,15
Summe	75.423	0,72
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BRC	(2.721)	(0,03)
JML	(1.433)	(0,01)
Summe	(4.154)	(0,04)
Global Investment Grade Credit ESG Fund		
Pensionsgeschäfte		
SSB	\$ 15.240	1,11
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BOS	(75.130)	(5,48)
BRC	(798)	(0,06)
Summe	(75.928)	(5,54)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte		
BPG	(75.242)	(5,49)
MSC	(684)	(0,05)
Summe	(75.926)	(5,54)
Global Low Duration Real Return Fund		
Pensionsgeschäfte		
FICC	\$ 1.053	0,08
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
CIB	(190.632)	(13,97)
DEU	(71.081)	(5,21)
Summe	(261.713)	(19,18)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte		
BRC	(69.575)	(5,10)
TDM	(10.024)	(0,73)
Summe	(79.599)	(5,83)
Global Real Return Fund		
Pensionsgeschäfte		
FICC	\$ 2.245	0,09
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BOS	(14.838)	(0,58)
BRC	(3.159)	(0,12)
BSN	(554.549)	(21,56)
CIB	(171.691)	(6,68)
GRE	(51.915)	(2,02)
Summe	(796.152)	(30,96)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte		
BOS	(9.519)	(0,37)
Income Fund		
Total Return Swaps		
BOA	\$ 80	0,00
GST	(735)	0,00
Summe	(655)	0,00
Pensionsgeschäfte		
BOS	500.000	0,86
DEU	116.100	0,20
FICC	2.037.659	3,51
MBC	644.900	1,11
SGY	113.800	0,20
SOG	9.239	0,02
Summe	3.421.698	5,90
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BRC	(5.155)	(0,01)
DBL	(10.712)	(0,02)
Summe	(15.867)	(0,03)

Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

Fonds	31. Dez. 2022	
	Marktwert (000\$)	% des Nettovermögens
Inflation Multi-Asset Fund		
Total Return Swaps		
BPS	\$ (373)	(0,09)
BRC	(21)	(0,01)
CBK	(76)	(0,02)
GST	(118)	(0,03)
JPM	17	0,00
MAC	192	0,05
MYI	(362)	(0,09)
SOG	(48)	(0,01)
Summe	(789)	(0,20)
Pensionsgeschäfte		
GSC	37.700	9,34
SSB	3.020	0,76
Summe	40.720	10,10
Low Average Duration Fund		
Pensionsgeschäfte		
FICC	\$ 956	0,09
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BOS	(128.895)	(12,01)
GRE	(15.962)	(1,49)
Summe	(144.857)	(13,50)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte		
CSN	(4.077)	(0,38)
Low Duration Global Investment Grade Credit Fund		
Pensionsgeschäfte		
FICC	\$ 1.604	0,24
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BOS	(2.415)	(0,37)
BRC	(607)	(0,09)
GRE	(9.754)	(1,49)
Summe	(12.776)	(1,95)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte		
BPG	(1.409)	(0,22)
Low Duration Income Fund		
Total Return Swaps		
GST	\$ (2)	0,00
Pensionsgeschäfte		
FICC	5.431	0,50
MBC	93.400	8,61
Summe	98.831	9,11
Low Duration Opportunities Fund		
Pensionsgeschäfte		
FICC	\$ 118.800	8,83
PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund		
Total Return Swaps		
BOA	\$ (130)	(0,10)
CBK	(8)	(0,01)
FAR	(18)	(0,01)
JPM	(1)	0,00
MYI	16	0,01
Summe	(141)	(0,11)
Pensionsgeschäfte		
SSB	811	0,68
Mortgage Opportunities Fund		
Pensionsgeschäfte		
BPS	\$ 13.700	1,61
FICC	3.618	0,43
Summe	17.318	2,04
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
CIB	(264.111)	(31,10)
JPS	(724)	(0,09)
RCY	(23.192)	(2,73)
SCX	(28.466)	(3,35)

Fonds	31. Dez. 2022	
	Marktwert (000\$)	% des Nettovermögens
Summe	(316.493)	(37,27)
StocksPLUS™ Fund		
Total Return Swaps		
FAR	\$ (1.148)	(0,11)
MBC	(120)	(0,01)
RBC	(1.063)	(0,11)
UBS	(35)	(0,01)
Summe	(2.366)	(0,24)
Pensionsgeschäfte		
BOS	20.300	2,01
FICC	14.743	1,46
NOM	60.000	5,95
SGY	24.500	2,43
TOR	36.902	3,67
Summe	156.445	15,52
PIMCO StocksPLUS™ AR Fund		
Total Return Swaps		
BRC	\$ (4)	(0,04)
FAR	(16)	(0,16)
RBC	(17)	(0,19)
Summe	(37)	(0,39)
Pensionsgeschäfte		
BPS	1.200	12,59
SSB	174	1,83
Summe	1.374	14,42
Strategic Income Fund		
Total Return Swaps		
GST	\$ (4)	0,00
Pensionsgeschäfte		
FICC	781	0,15
Total Return Bond Fund		
Pensionsgeschäfte		
BOS	\$ 26.100	0,63
FICC	144.795	3,49
Summe	170.895	4,12
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BRC	(1.745)	(0,04)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte		
BPG	(76.809)	(1,85)
PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund		
Total Return Swaps		
MEI	\$ (165)	(0,04)
Pensionsgeschäfte		
BPS	22.700	5,21
SSB	4.752	1,09
Summe	27.452	6,30
UK Corporate Bond Fund		
Pensionsgeschäfte		
FICC	£ 177	0,05
UK Long Term Corporate Bond Fund		
Pensionsgeschäfte		
FICC	£ 269	0,08
US High Yield Bond Fund		
Pensionsgeschäfte		
FICC	\$ 9.269	0,47
US Investment Grade Corporate Bond Fund		
Pensionsgeschäfte		
BOS	\$ 12.800	3,30
FICC	2.583	0,66
Summe	15.383	3,96
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte		
BPG	(38.655)	(9,95)
US Short-Term Fund		
Pensionsgeschäfte		
FICC	\$ 154.472	6,69

Zum 31. Dezember 2021 hielten die Fonds Total Return Swaps und die folgenden Arten von SFTs:

- Pensionsgeschäfte
- Umgekehrte Pensionsgeschäfte
- Sale-Buyback-Geschäfte

Der Marktwert von Vermögenswerten/(Verbindlichkeiten) über alle SFTs und Total Return Swaps hinweg, jeweils gruppiert nach SFT-Art(en), und die zehn größten Kontrahenten gestalteten sich zum Freitag, 31. Dezember 2021 wie nachfolgend angegeben (wenn weniger als zehn Kontrahenten verwendet werden, sind alle Kontrahenten aufgeführt).

Fonds	31. Dez. 2021	
	Marktwert (000\$)	% des Nettovermögens
PIMCO Asia High Yield Bond Fund		
Total Return Swaps		
DBL	\$ 69	0,00
Pensionsgeschäfte		
IND	75.000	2,20
SSB	103.712	3,04
Summe	178.712	5,24
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BPS	(9.016)	(0,27)
BRC	(34.792)	(1,01)
JML	(5.040)	(0,15)
Summe	(48.848)	(1,43)
Asia Strategic Interest Bond Fund		
Total Return Swaps		
DBL	\$ 25	0,01
Pensionsgeschäfte		
SSB	837	0,23
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BPS	(348)	(0,10)
BRC	(676)	(0,18)
Summe	(1.024)	(0,28)
PIMCO Capital Securities Fund		
Pensionsgeschäfte		
FICC	\$ 14.423	0,16
IND	48.100	0,53
Summe	62.523	0,69
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BPS	(4.109)	(0,05)
BRC	(6.687)	(0,07)
JML	(10.246)	(0,11)
TDM	(2.297)	(0,03)
Summe	(23.339)	(0,26)
Commodity Real Return Fund		
Total Return Swaps		
BPS	\$ 9.677	0,67
CBK	5.715	0,40
CIB	1.202	0,08
FBF	651	0,05
GST	11.216	0,78
JPM	20.289	1,40
MAC	1.646	0,11
MEI	2.152	0,15
SOG	859	0,06
Summe	53.407	3,70
Pensionsgeschäfte		
FICC	2.098	0,15
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
GRE	(22.915)	(1,59)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte		
MSC	(80.800)	(5,59)

Fonds	31. Dez. 2021	
	Marktwert (000\$)	% des Nettovermögens
PIMCO Credit Opportunities Bond Fund		
Pensionsgeschäfte		
FICC	\$ 1.827	1,31
Diversified Income Fund		
Pensionsgeschäfte		
BPS	\$ 76.100	0,47
FICC	81.216	0,49
Summe	157.316	0,96
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BPS	(5.516)	(0,03)
BRC	(18.608)	(0,11)
FBF	(29.496)	(0,18)
JML	(28.249)	(0,18)
Summe	(81.869)	(0,50)
Diversified Income Duration Hedged Fund		
Pensionsgeschäfte		
FICC	\$ 7.030	0,54
IND	51.900	3,97
Summe	58.930	4,51
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BPS	(1.888)	(0,14)
GST	(2.957)	(0,23)
Summe	(4.845)	(0,37)
Dynamic Bond Fund		
Pensionsgeschäfte		
FICC	\$ 9.965	0,30
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BPS	(4.539)	(0,14)
Dynamic Multi-Asset Fund		
Total Return Swaps		
BPS	€ (57)	0,00
BRC	(2)	0,00
Summe	(59)	0,00
Pensionsgeschäfte		
BPS	114.800	1,50
FICC	8.276	0,11
IND	79.200	1,04
Summe	202.276	2,65
Emerging Local Bond Fund		
Pensionsgeschäfte		
FICC	\$ 591	0,03
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BPS	(12.365)	(0,57)
BRC	(89.609)	(4,16)
DBL	(11.372)	(0,53)
JML	(112.133)	(5,22)
MBC	(35.127)	(1,63)
SCX	(99.720)	(4,64)
UBS	(14.417)	(0,67)
Summe	(374.743)	(17,42)
Emerging Markets Bond Fund		
Pensionsgeschäfte		
BPS	\$ 42.700	0,91
FICC	7.623	0,16
Summe	50.323	1,07
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BPS	(91.031)	(1,93)
BRC	(19.110)	(0,40)
FBF	(14.102)	(0,30)
JML	(28.314)	(0,61)
MEI	(13.673)	(0,29)
Summe	(166.230)	(3,53)
Emerging Markets Bond ESG Fund		
Pensionsgeschäfte		
BPS	\$ 14.600	0,55
FICC	3.343	0,13
SGY	33.200	1,26
Summe	51.143	1,94

Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

Fonds	31. Dez. 2021	
	Marktwert (000S)	% des Nettovermögens
Emerging Markets Bond ESG Fund (Fortsetzung)		
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BPS	\$ (64.683)	(2,45)
BRC	(10.692)	(0,41)
FBF	(7.843)	(0,30)
JML	(29.437)	(1,11)
NOM	(4.740)	(0,18)
SCX	(47.047)	(1,79)
TDM	(2.761)	(0,10)
Summe	(167.203)	(6,34)
Emerging Markets Corporate Bond Fund		
Pensionsgeschäfte		
FICC	\$ 487	0,23
Emerging Markets Opportunities Fund		
Pensionsgeschäfte		
SSB	\$ 688	0,24
Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund		
Pensionsgeschäfte		
SSB	\$ 193	0,65
Euro Bond Fund		
Pensionsgeschäfte		
COM	€ 22.300	0,87
FICC	2.416	0,09
Summe	24.716	0,96
Euro Credit Fund		
Pensionsgeschäfte		
FICC	€ 5.883	0,58
Euro Income Bond Fund		
Pensionsgeschäfte		
COM	€ 6.400	0,25
FICC	1.151	0,05
Summe	7.551	0,30
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
SCX	(3.195)	(0,13)
Euro Long Average Duration Fund		
Pensionsgeschäfte		
COM	€ 1.100	0,69
FICC	136	0,08
Summe	1.236	0,77
Euro Short-Term Fund		
Pensionsgeschäfte		
COM	€ 25.900	4,11
FICC	637	0,10
Summe	26.537	4,21
PIMCO European High Yield Bond Fund		
Pensionsgeschäfte		
BPS	€ 4.900	2,87
PIMCO European Short-Term Opportunities Fund		
Pensionsgeschäfte		
COM	€ 10.800	2,73
FICC	881	0,22
Summe	11.681	2,95
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
FBF	(611)	(0,15)
Global Advantage Fund		
Pensionsgeschäfte		
FICC	\$ 206	0,04
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BRC	(13.753)	(2,64)
GRE	(14.899)	(2,86)
MYI	(6.798)	(1,30)
Summe	(35.450)	(6,80)

Fonds	31. Dez. 2021	
	Marktwert (000S)	% des Nettovermögens
Global Bond Fund		
Total Return Swaps		
CIB	\$ 101	0,00
Pensionsgeschäfte		
FICC	3.378	0,02
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BRC	(12.048)	(0,09)
CIB	(611.552)	(4,35)
GRE	(189.959)	(1,35)
IND	(16.959)	(0,12)
JML	(336.833)	(2,40)
Summe	(1.166.988)	(8,31)
Global Bond ESG Fund		
Pensionsgeschäfte		
BPS	\$ 32.600	1,41
FICC	5.654	0,25
Summe	38.254	1,66
Global Bond Ex-US Fund		
Total Return Swaps		
BPS	\$ 83	0,01
CIB	1	0,00
GST	51	0,00
Summe	135	0,01
Pensionsgeschäfte		
FICC	1.246	0,14
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BRC	(26.064)	(2,86)
IND	(9.437)	(1,03)
JML	(20.622)	(2,26)
MYI	\$ (41.132)	(4,51)
UBS	(2.251)	(0,25)
Summe	(99.506)	(10,91)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte		
MSC	(8.467)	(0,93)
PIMCO Global Core Asset Allocation Fund		
Total Return Swaps		
BOA	\$ (333)	(0,03)
BPS	26	0,00
JPM	80	0,01
SOG	18	0,00
Summe	(209)	(0,02)
Pensionsgeschäfte		
FICC	511	0,05
Global High Yield Bond Fund		
Total Return Swaps		
BRC	\$ 77	0,00
MYC	739	0,02
Summe	816	0,02
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BRC	(12.814)	(0,25)
JML	(3.058)	(0,06)
Summe	(15.872)	(0,31)
Global Investment Grade Credit Fund		
Pensionsgeschäfte		
FICC	\$ 4.429	0,03
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BRC	(6.220)	(0,03)
FBF	(1.160)	(0,01)
Summe	(7.380)	(0,04)
Global Investment Grade Credit ESG Fund		
Pensionsgeschäfte		
SSB	\$ 962	0,08
Global Low Duration Real Return Fund		
Pensionsgeschäfte		
FICC	\$ 1.138	0,09
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte		
BRC	(68.642)	(5,73)
CSN	(182.164)	(15,19)
Summe	(250.806)	(20,92)

Fonds	31. Dez. 2021	
	Marktwert (000\$)	% des Nettovermögens
Global Real Return Fund		
Pensionsgeschäfte		
FICC	\$ 5.680	0,15
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
GRE	(217.149)	(5,86)
MYI	(20.667)	(0,56)
NOM	(534.885)	(14,44)
Summe	(772.701)	(20,86)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte		
BRC	(45.534)	(1,23)
MSC	(290.315)	(7,84)
Summe	(335.849)	(9,07)
Income Fund		
Total Return Swaps		
BPS	\$ 257	0,00
MYC	3.317	0,00
Summe	3.574	0,00
Pensionsgeschäfte		
BOS	2.796.100	3,79
BPS	134.300	0,18
BRC	653.100	0,89
BSN	230.400	0,31
CIB	1.500.000	2,04
FICC	14.233	0,02
JPS	130.000	0,18
MBC	608.100	0,83
NXN	250.000	0,34
TDM	49.400	0,07
Summe	6.365.633	8,65
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BPS	(43.630)	(0,06)
BRC	(10.270)	(0,01)
FBF	\$ (14.088)	(0,02)
JML	(4.228)	(0,01)
TDM	(856)	0,00
Summe	(73.072)	(0,10)
Inflation Multi-Asset Fund		
Total Return Swaps		
BOA	\$ 11	0,01
BPS	252	0,15
CBK	87	0,04
FAR	(1)	0,00
GST	89	0,06
JPM	354	0,22
MAC	4	0,00
MYI	93	0,06
SOG	39	0,02
UAG	(2)	0,00
Summe	926	0,56
Pensionsgeschäfte		
SSB	500	0,30
Low Average Duration Fund		
Pensionsgeschäfte		
FICC	\$ 2.677	0,23
RDR	21.500	1,82
Summe	24.177	2,05
Low Duration Global Investment Grade Credit Fund		
Pensionsgeschäfte		
FICC	\$ 892	0,11
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte		
BRC	(2.682)	(0,33)

Fonds	31. Dez. 2021	
	Marktwert (000\$)	% des Nettovermögens
Low Duration Income Fund		
Total Return Swaps		
BPS	\$ 2	0,00
BRC	1	0,00
MYC	4	0,00
Summe	7	0,00
Pensionsgeschäfte		
FICC	7.961	0,58
Low Duration Opportunities Fund		
Pensionsgeschäfte		
BPS	\$ 68.000	2,12
FICC	4.663	0,14
Summe	72.663	2,26
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BPS	(1.088)	(0,03)
PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund		
Total Return Swaps		
BOA	\$ (2)	0,00
CBK	302	0,31
FAR	(4)	(0,01)
MYI	11	0,01
Summe	307	0,31
Mortgage Opportunities Fund		
Pensionsgeschäfte		
FICC	\$ 2.125	0,09
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BOS	(347.158)	(15,51)
CIB	(16.761)	(0,75)
Summe	(363.919)	(16,26)
StocksPLUS™ Fund		
Total Return Swaps		
BOA	\$ 612	0,02
CBK	5.147	0,13
FAR	19.666	0,53
GST	(20)	0,00
HUS	1.674	0,04
RBC	16.517	0,44
UAG	9.318	0,25
Summe	52.914	1,41
Pensionsgeschäfte		
BPS	300.000	7,97
FICC	7.712	0,21
GSC	\$ 163.800	4,36
MFK	550.000	14,62
RVM	450.000	11,96
Summe	1.471.512	39,12
PIMCO StocksPLUS™ AR Fund		
Total Return Swaps		
FAR	\$ 213	1,83
GST	(5)	(0,04)
Summe	208	1,79
Pensionsgeschäfte		
BPS	1.300	11,19
SSB	132	1,14
Summe	1.432	12,33
Strategic Income Fund		
Total Return Swaps		
BPS	\$ 2	0,00
BRC	1	0,00
MYC	2	0,00
Summe	5	0,00
Pensionsgeschäfte		
FICC	476	0,08
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte		
BRC	(1.841)	(0,30)

Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

Fonds	31. Dez. 2021	
	Marktwert (000\$)	% des Nettovermögens
Total Return Bond Fund		
Pensionsgeschäfte		
FICC	\$ 7.152	0,14
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BRC	(11.267)	(0,24)
GRE	(119.489)	(2,41)
IND	(95.095)	(1,92)
Summe	(225.851)	(4,57)
PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund		
Total Return Swaps		
MEI	\$ 94	0,09
Pensionsgeschäfte		
SSB	800	0,79
UK Corporate Bond Fund		
Pensionsgeschäfte		
FICC	£ 526	0,09
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
FBF	(513)	(0,09)
UK Long Term Corporate Bond Fund		
Pensionsgeschäfte		
FICC	£ 442	0,10
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
FBF	(513)	(0,12)
US High Yield Bond Fund		
Total Return Swaps		
BRC	\$ 898	0,03
Pensionsgeschäfte		
FICC	1.473	0,04
US Investment Grade Corporate Bond Fund		
Pensionsgeschäfte		
FICC	\$ 686	0,08
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte		
BPG	(6.735)	(0,77)
CSN	(19.775)	(2,25)
Summe	(26.510)	(3,02)
US Short-Term Fund		
Pensionsgeschäfte		
FICC	\$ 1.571	0,06
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
SGY	(215.091)	(8,12)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte		
BRC	(56.138)	(2,12)
CSN	(181.617)	(6,85)
Summe	(237.755)	(8,97)

(b) Sicherheiten

(i) Verwahrung erhaltener Sicherheiten:

Die zum 31. Dezember 2022 und zum 31. Dezember 2021 erhaltenen Sicherheiten wurden im globalen Depotbanknetz der State Street Bank and Trust, der obersten Muttergesellschaft der Verwahrstelle, gehalten.

(ii) Konzentrationsdaten:

Die zehn größten Emittenten von Wertpapieren, die als Sicherheiten über sämtliche SFTs hinweg erhalten wurden, gestalteten sich zum 31. Dezember 2022 wie folgt. Wenn weniger als zehn Emittenten vorliegen, sind alle Emittenten nachfolgend aufgeführt:

Fonds	Zum 31. Dez. 2022	
	Sicherheitenemittent	Marktwert (000\$)
PIMCO Asia High Yield Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	\$ 20.983
Asia Strategic Interest Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	836
PIMCO Capital Securities Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	10.375
PIMCO Climate Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	38.412
Commodity Real Return Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	61.286
PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	7.060

Fonds	Zum 31. Dez. 2022	
	Sicherheitenemittent	Marktwert (000\$)
Total Return Bond Fund	Freddie Mac	\$ 139.541
	Ginnie Mae	450.224
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	1.205.939
Diversified Income Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	104.889
	Freddie Mac	139.541
	Ginnie Mae	413.154
Dynamic Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	621.400
	Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale	€ 100.270
	Europäische Union	18.150
Dynamic Multi-Asset Fund	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau	161
	Landwirtschaftliche Rentenbank	4.907
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	1.822
Emerging Markets Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	\$ 9.343
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	45.570
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	8.567
Emerging Markets Bond ESG Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	720
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	2.820
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	45.259
Emerging Markets Corporate Bond Fund	BNG Bank NV	€ 11.063
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	627
	BNG Bank NV	2.776
Euro Bond Fund	Bpifrance SACA	483
	Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale	568
	Europäische Union	25.098
Euro Credit Fund	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau	4.431
	Landwirtschaftliche Rentenbank	8.536
	Land Nordrhein-Westfalen	837
Euro Income Bond Fund	UNEDIC	1.626
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	940
	BNG Bank NV	16.819
Euro Long Average Duration Fund	Land Berlin	102.209
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	3.935
	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau	1.517
Euro Short-Term Fund	BNG Bank NV	14.286
	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau	3.743
	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau	4.454
PIMCO European High Yield Bond Fund	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau	\$ 1.436
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	1.378.007
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	1.181.854
PIMCO European Short-Term Opportunities Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	1.658
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	18.879
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	11.642
Global Advantage Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	76.925
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	15.545
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	1.074
Global Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	2.391
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	
Global Bond ESG Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	
Global Bond Ex-US Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	
PIMCO Global Core Asset Allocation Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	
Global High Yield Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	
Global Investment Grade Credit Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	
Global Investment Grade Credit ESG Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	
Global Low Duration Real Return Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	
Global Real Return Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	

Zum 31. Dez. 2022		
Fonds	Sicherheitenemittent	Marktwert (000S)
Income Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	\$ 3.498.550
Inflation Multi-Asset Fund	Freddie Mac	38.846
Low Average Duration Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	3.080
Low Duration Global Investment Grade Credit Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	1.636
Low Duration Income Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	101.947
Low Duration Opportunities Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	121.176
PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	827
Mortgage Opportunities Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	17.694
StocksPLUS™ Fund	Canada Government	36.902
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	122.051
PIMCO StocksPLUS™ AR Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	1.405
Strategic Income Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	797
Total Return Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	174.491
PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	28.016
UK Corporate Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	£ 181
UK Long Term Corporate Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	274
US High Yield Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	\$ 9.454
US Investment Grade Corporate Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	15.768
US Short-Term Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	157.561

Die zehn größten Emittenten von Wertpapieren, die als Sicherheiten über sämtliche SFTs hinweg erhalten wurden, gestalteten sich zum 31. Dezember 2021 wie folgt. Wenn weniger als zehn Emittenten vorliegen, sind alle Emittenten nachfolgend aufgeführt:

Zum 31. Dez. 2021		
Fonds	Sicherheitenemittent	Marktwert (000S)
PIMCO Asia High Yield Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	\$ 182.416
Asia Strategic Interest Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	854
PIMCO Capital Securities Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	63.857
Commodity Real Return Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	2.140
PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	1.864
Diversified Income Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	160.513
Diversified Income Duration Hedged Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	60.199
Dynamic Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	10.164
Dynamic Multi-Asset Fund	Agence Francaise de Developpement	€ 15.624
	Dexia Credit Local S.A.	7.755
	Europäische Union	22.936
	Germany Government	70.334
	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau	48.246
	SNCF Reseau	28.392
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	8.441
Emerging Local Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	\$ 603
Emerging Markets Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	51.353
Emerging Markets Bond ESG Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	52.182
Emerging Markets Corporate Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	497
PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	702
Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	197

Zum 31. Dez. 2021		
Fonds	Sicherheitenemittent	Marktwert (000S)
Euro Bond Fund	Germany Government	€ 22.175
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	2.464
Euro Credit Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	6.001
Euro Income Bond Fund	Germany Government	6.350
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	1.174
Euro Long Average Duration Fund	Germany Government	1.106
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	139
Euro Short-Term Fund	NRW Bank	25.716
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	649
PIMCO European High Yield Bond Fund	UNEDIC	5.091
PIMCO European Short-Term Opportunities Fund	Germany Government	10.750
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	899
Global Advantage Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	\$ 210
Global Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	3.446
Global Bond ESG Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	39.022
Global Bond Ex-US Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	1.271
PIMCO Global Core Asset Allocation Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	521
Global Investment Grade Credit Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	4.518
Global Investment Grade Credit ESG Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	981
Global Low Duration Real Return Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	1.161
Global Real Return Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	11.471
Income Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	6.515.251
Inflation Multi-Asset Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	510
Low Average Duration Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	24.667
Low Duration Global Investment Grade Credit Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	910
Low Duration Income Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	8.120
Low Duration Opportunities Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	74.161
Mortgage Opportunities Fund	Fannie Mae	94
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	2.168
StocksPLUS™ Fund	Fannie Mae	170.372
	Ginnie Mae	310.742
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	1.029.581
PIMCO StocksPLUS™ AR Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	1.461
Strategic Income Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	\$ 486
Total Return Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	7.295
PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	816
UK Corporate Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	£ 537
UK Long Term Corporate Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	451
US High Yield Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	\$ 1.503
US Investment Grade Corporate Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	700
US Short-Term Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	1.602

Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

(iii) Aggregierte Transaktionsdaten:

Die aggregierten Transaktionsdaten für Sicherheitenpositionen (einschließlich von Barmitteln), die über sämtliche SFTs und Total Return Swaps hinweg erhalten wurden, gestalteten sich zum 31. Dezember 2022 wie folgt:

Fonds	Wertpapierart	Beschreibung der Sicherheiten	Art der Sicherheiten	Markt-wert (000S)	Qualität	Fälligkeitsprofil der Sicherheiten	Währung der Sicherheiten	Gründungsland des Kontrahenten	Abrechnung und Clearing
PIMCO Asia High Yield Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	\$ 20.983	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	USA	FED, Bilateral
Asia Strategic Interest Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	836	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
PIMCO Capital Securities Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bills	Treasury	10.375	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	3.516	k. A.	k. A.	USD	Kanada	FED, Bilateral
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	6.877	k. A.	k. A.	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	264	k. A.	k. A.	EUR	Großbritannien	FED, Bilateral
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	7.614	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
PIMCO Climate Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bonds	Treasury	38.412	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Commodity Real Return Fund	Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	840	k. A.	k. A.	USD	Australien	FED, Bilateral
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	1.310	k. A.	k. A.	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bills	Treasury	625	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bonds	Treasury	60.504	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bonds	Treasury	157	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bills	Treasury	622	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	6.438	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
Diversified Income Fund	Pensionsgeschäfte	Freddie Mac	Mortgage Pass Thru	139.541	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		Ginnie Mae	Mortgage Pass Thru	450.224	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bills	Treasury	58.078	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bills	Treasury	42.150	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bonds	Treasury	513.516	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	592.195	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	277	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
Diversified Income Duration Hedged Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bills	Treasury	2.481	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	102.408	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Dynamic Bond Fund	Pensionsgeschäfte	Freddie Mac	Mortgage Pass Thru	139.541	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		Ginnie Mae	Mortgage Pass Thru	413.154	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bills	Treasury	2.950	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bonds	Treasury	529.681	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	88.769	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Dynamic Multi-Asset Fund	Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	€ 10.200	k. A.	k. A.	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	4.040	k. A.	k. A.	EUR	Großbritannien	FED, Bilateral
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	7.080	k. A.	k. A.	EUR	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
	Pensionsgeschäfte	Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale	Treasury	100.270	AA	3 Monate - 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		Europäischer Stabilitätsmechanismus	Treasury	18.150	AAA	1-3 Monate	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		Kreditanstalt fuer Wiederaufbau	Unternehmensanleihen	161	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		Landwirtschaftliche Rentenbank	Unternehmensanleihen	4.907	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bills	Treasury	1.822	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Emerging Markets Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bills	Treasury	\$ 9.343	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	2.609	k. A.	k. A.	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	393	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
Emerging Markets Bond ESG Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bills	Treasury	9.446	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bonds	Treasury	36.124	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	807	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral

Fonds	Wertpapierart	Beschreibung der Sicherheiten	Art der Sicherheiten	Markt-wert (000\$)	Qualität	Fälligkeitsprofil der Sicherheiten	Währung der Sicherheiten	Gründungsland des Kontrahenten	Abrechnung und Clearing		
Emerging Markets Corporate Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bills	Treasury	\$ 2.332	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral		
		U.S. Treasury Notes	Treasury	6.235	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral		
PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	720	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral		
Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	2.549	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral		
		U.S. Treasury Notes	Treasury	271	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral		
PIMCO ESG Income Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	45.259	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral		
Euro Bond Fund	Pensionsgeschäfte	BNG Bank NV	Treasury	€ 11.063	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral		
		U.S. Treasury Notes	Treasury	627	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral		
Euro Credit Fund	Pensionsgeschäfte	BNG Bank NV	Treasury	2.776	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral		
		Bpifrance SACA	Treasury	483	AA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral		
		Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale	Treasury	568	AA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral		
		Rat der Europäischen Entwicklungsbank	Treasury	784	AA+	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral		
		Europäischer Stabilitätsmechanismus	Treasury	4.996	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral		
		Europäische Investitionsbank	Treasury	6.798	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral		
		Europäische Union	Treasury	12.520	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral		
		Kreditanstalt fuer Wiederaufbau	Unternehmensanleihen	979	AAA	3 Monate - 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral		
		Kreditanstalt fuer Wiederaufbau	Unternehmensanleihen	3.452	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral		
		Landwirtschaftliche Rentenbank	Unternehmensanleihen	8.536	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral		
		Land Nordrhein-Westfalen	Treasury	837	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral		
		UNEDIC	Treasury	1.626	AA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral		
		Euro Income Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bills	Treasury	940	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
				BNG Bank NV	Treasury	16.819	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
Land Berlin	Treasury			102.209	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Deutschland	FED, Bilateral		
Euro Long Average Duration Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bills	Treasury	3.935	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral		
		Kreditanstalt fuer Wiederaufbau	Unternehmensanleihen	1.517	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral		
Euro Short-Term Fund	Pensionsgeschäfte	BNG Bank NV	Treasury	14.286	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral		
PIMCO European High Yield Bond Fund	Pensionsgeschäfte	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau	Unternehmensanleihen	3.743	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral		
PIMCO European Short-Term Opportunities Fund	Pensionsgeschäfte	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau	Unternehmensanleihen	4.454	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral		
Global Advantage Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bills	Treasury	\$ 1.436	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	USA	FED, Bilateral		
Global Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bonds	Treasury	307.187	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral		
		U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	269.857	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral		
		U.S. Treasury Notes	Treasury	674.208	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral		
		U.S. Treasury Notes	Treasury	126.755	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral		

Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

Fonds	Wertpapierart	Beschreibung der Sicherheiten	Art der Sicherheiten	Markt-wert (000\$)	Qualität	Fälligkeitsprofil der Sicherheiten	Währung der Sicherheiten	Gründungsland des Kontrahenten	Abrechnung und Clearing	
Global Bond ESG Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bonds	Treasury	\$ 320.650	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Großbritannien	FED, Bilateral	
		U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	36.147	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
		U.S. Treasury Notes	Treasury	281.796	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral	
Global Bond Ex-US Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	543.261	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
		U.S. Treasury Notes	Treasury	530	k. A.	k. A.	USD	Frankreich	FED, Bilateral	
PIMCO Global Core Asset Allocation Fund	Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	1.658	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	1.660	k. A.	k. A.	USD	Frankreich	FED, Bilateral	
	Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	1.560	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral	
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	590	k. A.	k. A.	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
Global High Yield Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bills	Treasury	11.461	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
		U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	7.418	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral	
	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bills	Treasury	7.968	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
		U.S. Treasury Bonds	Treasury	3.674	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
Global Investment Grade Credit Fund	Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	205	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral	
		U.S. Treasury Bills	Treasury	29.808	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
		U.S. Treasury Bonds	Treasury	31.422	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
Global Investment Grade Credit ESG Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	15.695	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
		U.S. Treasury Notes	Treasury	15.545	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
Global Low Duration Real Return Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bills	Treasury	1.074	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
Global Real Return Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	2.290	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
Income Fund	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bonds	Treasury	101	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
		U.S. Treasury Bills	Treasury	404.498	AAA	Bis zu 1 Monat	USD	Großbritannien	FED, Bilateral	
	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bills	Treasury	82.219	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
		U.S. Treasury Bonds	Treasury	9.894	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral	
		U.S. Treasury Bonds	Treasury	747.747	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Inflation Protected	Treasury	323.152	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
		U.S. Treasury Notes	Treasury	257.998	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Großbritannien	FED, Bilateral	
		U.S. Treasury Notes	Treasury	1.673.042	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	273	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral	
	Inflation Multi-Asset Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bonds	Treasury	1	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
			Barsicherheiten	Zahlungsmittel	240	k. A.	k. A.	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Low Average Duration Fund	Pensionsgeschäfte	Freddie Mac	Mortgage Pass Thru	38.846	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
		U.S. Treasury Notes	Treasury	3.080	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
		U.S. Treasury Notes	Treasury	975	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
Low Duration Global Investment Grade Credit Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	1.636	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
Low Duration Income Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bills	Treasury	5.540	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
		U.S. Treasury Notes	Treasury	96.407	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Großbritannien	FED, Bilateral	
Low Duration Opportunities Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	121.176	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	

Fonds	Wertpapierart	Beschreibung der Sicherheiten	Art der Sicherheiten	Markt-wert (000S)	Qualität	Fälligkeitsprofil der Sicherheiten	Währung der Sicherheiten	Gründungsland des Kontrahenten	Abrechnung und Clearing
PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	\$ 370	k. A.	k. A.	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	827	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Mortgage Opportunities Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bills	Treasury	3.690	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	14.004	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	4.656	k. A.	k. A.	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
StocksPLUS™ Fund	Pensionsgeschäfte	Province of Ontario	Treasury	36.902	AA-	Mehr als 1 Jahr	CAD	Kanada	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bills	Treasury	15.038	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
PIMCO StocksPLUS™ AR Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bonds	Treasury	107.013	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	1.227	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	178	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Strategic Income Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bills	Treasury	797	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Total Return Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bonds	Treasury	26.800	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	5.911	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	141.780	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	23.169	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	4.847	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
UK Corporate Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bills	Treasury	£ 181	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
UK Long Term Corporate Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bills	Treasury	274	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
US High Yield Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bills	Treasury	\$ 9.454	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
US Investment Grade Corporate Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bonds	Treasury	13.133	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	2.635	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
US Short-Term Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bills	Treasury	2.725	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	154.836	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral

Die aggregierten Transaktionsdaten für Sicherheitenpositionen (einschließlich von Barmitteln), die über sämtliche SFTs und Total Return Swaps hinweg erhalten wurden, gestalteten sich zum 31. Dezember 2021 wie folgt:

Fonds	Wertpapierart	Beschreibung der Sicherheiten	Art der Sicherheiten	Markt-wert (000S)	Qualität	Fälligkeitsprofil der Sicherheiten	Währung der Sicherheiten	Gründungsland des Kontrahenten	Abrechnung und Clearing
PIMCO Asia High Yield Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bonds	Treasury	\$ 76.630	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	105.786	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	USA	FED, Bilateral
Asia Strategic Interest Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	854	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
PIMCO Capital Securities Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bonds	Treasury	49.146	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	14.711	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Commodity Real Return Fund	Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	1.770	k. A.	k. A.	USD	Australien	FED, Bilateral
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	11.740	k. A.	k. A.	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	15.180	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	29.630	k. A.	k. A.	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	2.140	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	1.864	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral

Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

Fonds	Wertpapierart	Beschreibung der Sicherheiten	Art der Sicherheiten	Markt-wert (000\$)	Qualität	Fälligkeitsprofil der Sicherheiten	Währung der Sicherheiten	Gründungsland des Kontrahenten	Abrechnung und Clearing
Diversified Income Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	\$ 77.673	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	82.840	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	USA	FED, Bilateral
Diversified Income Duration Hedged Fund	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	308	k. A.	k. A.	EUR	Großbritannien	FED, Bilateral
		Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bonds	Treasury	53.028	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich
Dynamic Bond Fund	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	7.171	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	10.164	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Dynamic Multi-Asset Fund	Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	250	k. A.	k. A.	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		Agence Francaise de Developpement	Unternehmensanleihen	€ 15.624	AA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		Dexia Credit Local S.A.	Unternehmensanleihen	7.755	BBB+	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		Kreditanstalt fuer Wiederaufbau	Unternehmensanleihen	48.246	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		Europäische Union	Treasury	22.936	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		SNCF Reseau	Treasury	28.392	AA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		State of North Rhine- Westphalia	Treasury	25.432	AAA	3 Monate - 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		State of North Rhine- Westphalia	Treasury	44.902	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	8.441	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		Emerging Local Bond Fund	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	\$ 603	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD
Emerging Markets Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	7.776	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	43.577	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
Emerging Markets Bond ESG Fund	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	408	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	14.893	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich
Emerging Markets Corporate Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	3.410	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	33.879	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	1.001	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	497	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten
Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	702	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	197	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Euro Bond Fund	Pensionsgeschäfte	Land Niedersachsen	Treasury	€ 22.175	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Deutschland	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	2.464	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	USA	FED, Bilateral
Euro Credit Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	6.001	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral

Fonds	Wertpapierart	Beschreibung der Sicherheiten	Art der Sicherheiten	Markt-wert (000S)	Qualität	Fälligkeitsprofil der Sicherheiten	Währung der Sicherheiten	Gründungsland des Kontrahenten	Abrechnung und Clearing
Euro Income Bond Fund	Pensionsgeschäfte	Land Hessen	Treasury	€ 6.350	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Deutschland	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	105	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Euro Long Average Duration Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	1.069	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		Land Niedersachsen	Treasury	1.106	AAA	3 Monate - 1 Jahr	EUR	Deutschland	FED, Bilateral
Euro Short-Term Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	139	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		NRW Bank	Unternehmensanleihen	25.716	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Deutschland	FED, Bilateral
PIMCO European High Yield Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	649	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
PIMCO European Short-Term Opportunities Fund	Pensionsgeschäfte	UNEDIC	Treasury	5.091	AA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
Global Advantage Fund	Pensionsgeschäfte	Land Niedersachsen	Treasury	10.750	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Deutschland	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	899	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Global Bond Fund	Swap-Kontrakte	U.S. Treasury Notes	Treasury	\$ 210	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Global Bond ESG Fund	Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	400	k. A.	k. A.	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	3.446	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Global Bond Ex-US Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	33.255	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	5.767	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
PIMCO Global Core Asset Allocation Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	1.271	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Global High Yield Bond Fund	Swap-Kontrakte	U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	521	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Global Investment Grade Credit Fund	Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	710	k. A.	k. A.	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	4.518	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Global Investment Grade Credit ESG Fund	Pensionsgeschäfte	Umgekehrte	Zahlungsmittel	20	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	20	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
Global Low Duration Real Return Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	981	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Global Real Return Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	1.161	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	5.794	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Income Fund	Swap-Kontrakte	Umgekehrte	Zahlungsmittel	678	k. A.	k. A.	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	678	k. A.	k. A.	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Income Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bonds	Treasury	5.677	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	58.410	k. A.	k. A.	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	41.710	k. A.	k. A.	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bonds	Treasury	235.321	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Kanada	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bonds	Treasury	702.189	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bonds	Treasury	2.681.812	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Income Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	136.997	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	58.852	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Großbritannien	FED, Bilateral

Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

Fonds	Wertpapierart	Beschreibung der Sicherheiten	Art der Sicherheiten	Markt-wert (000\$)	Qualität	Fälligkeitsprofil der Sicherheiten	Währung der Sicherheiten	Gründungsland des Kontrahenten	Abrechnung und Clearing	
Inflation Multi-Asset Fund	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	\$ 225.894	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Großbritannien	FED, Bilateral	
		U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	816.286	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
		U.S. Treasury Notes	Treasury	309.469	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Großbritannien	FED, Bilateral	
		U.S. Treasury Notes	Treasury	1.348.431	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	USA	FED, Bilateral	
	Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	840	k. A.	k. A.	USD	Frankreich	FED, Bilateral	
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	1.035	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral	
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	280	k. A.	k. A.	USD	Frankreich	FED, Bilateral	
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	260	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral	
	Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	860	k. A.	k. A.	USD	USA	FED, Bilateral	
		U.S. Treasury Notes	Treasury	510	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
Low Average Duration Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	2.731	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
		U.S. Treasury Notes	Treasury	21.936	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
Low Duration Global Investment Grade Credit Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	910	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
Low Duration Income Fund	Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	1.330	k. A.	k. A.	USD	Frankreich	FED, Bilateral	
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	1.290	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral	
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	410	k. A.	k. A.	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
Low Duration Opportunities Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	8.120	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
		U.S. Treasury Notes	Treasury	69.405	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral	
		U.S. Treasury Notes	Treasury	4.756	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	610	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral	
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	730	k. A.	k. A.	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
Mortgage Opportunities Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	2.168	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
StocksPLUS™ Fund	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	Fannie Mae Mortgage Pass Thru		94	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	35.390	k. A.	k. A.	USD	Kanada	FED, Bilateral	
	Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	2.240	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral	
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	69.635	k. A.	k. A.	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
		Pensionsgeschäfte	Fannie Mae Mortgage Pass Thru		170.372	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
	PIMCO StocksPLUS™ AR Fund	Pensionsgeschäfte	Ginnie Mae Mortgage Pass Thru		310.742	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
			U.S. Treasury Bonds	Treasury	562.569	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Swap-Kontrakte		U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	7.866	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	
		U.S. Treasury Notes	Treasury	459.146	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Cayman-Inseln	FED, Bilateral	
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	530	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral	
Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	270	k. A.	k. A.	USD	USA	FED, Bilateral		
	U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	1.326	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral		
		U.S. Treasury Notes	Treasury	135	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral	

Fonds	Wertpapierart	Beschreibung der Sicherheiten	Art der Sicherheiten	Marktwert (000S)	Qualität	Fälligkeitsprofil der Sicherheiten	Währung der Sicherheiten	Gründungsland des Kontrahenten	Abrechnung und Clearing
Strategic Income Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	\$ 486	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Total Return Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	7.295	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	816	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
UK Corporate Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	£ 537	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
UK Long Term Corporate Bond Fund	Pensionsgeschäfte Umgekehrte	U.S. Treasury Notes	Treasury	451	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
US High Yield Bond Fund	Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	58	k. A.	k. A.	USD	Kanada	FED, Bilateral
	Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	\$ 970	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	1.503	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
US Investment Grade Corporate Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	700	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
US Short-Term Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	1.602	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral

Der Marktwert der Sicherheiten für Pensionsgeschäfte umfasst aufgelaufenen Zinsen.

Rahmenverträge für Termingeschäfte decken eine Kombination aus Buy-Sellback-Geschäften, Sale-Buyback-Geschäften und sonstigen Finanzierungsgeschäften ab, die oben nicht enthalten sind. Der Gesamtbetrag der zum 31. Dezember 2022 und zum 31. Dezember 2021 für alle Sicherheiten, die für gemäß diesen Vereinbarungen abgeschlossene Geschäfte erhalten wurden, ist oben enthalten. Es ist nicht möglich, die Sicherheiten für jedes einzelne Wertpapierfinanzierungsgeschäft separat zu analysieren.

ISDA-Vereinbarungen decken eine Kombination von Swap-Kontrakten ab, und der Gesamtbetrag der Sicherheiten für diese Vereinbarungen ist in den obigen Angaben enthalten.

Ein Teil der angegebenen Sicherheiten bezieht sich auf Derivate, die nicht unter die SFTR fallen.

(iv) Angaben zur Wiederverwendung von Sicherheiten:

Als Sicherheiten erhaltene Wertpapiere wurden zum 31. Dezember 2022 und zum 31. Dezember 2021 nicht wiederverwendet.

Die zum 31. Dezember 2022 und zum 31. Dezember 2021 erhaltenen Sicherheiten wurden im Depotbanknetz der State Street Bank and Trust gehalten.

(v) Verwahrung gestellter Sicherheiten:

Die von den Fonds zum 31. Dezember 2022 und zum 31. Dezember 2021 verpfändeten Sicherheiten werden von den Kontrahenten in Konten gehalten, bei denen es sich nicht um getrennte oder Sammelkonten handelt.

(c) Rendite/Kosten

Die nachfolgenden Tabellen liefern detaillierte Angaben zur Rendite und den Kosten jeder Art von SFT und Total Return Swap für die Geschäftsjahre zum 31. Dezember 2022 und zum 31. Dezember 2021. Die Beträge sind in der Basiswährung der Fonds ausgewiesen.

Fonds	31. Dez. 2022							
	Pensionsgeschäfte		Umgekehrte Pensionsgeschäfte		Buy-Sellback-Finanzierungs-geschäfte		Rückkauf-Finanzierungs-geschäfte	
	Renditen (000S)	Kosten (000S)	Renditen (000S)	Kosten (000S)	Renditen (000S)	Kosten (000S)	Renditen (000S)	Kosten (000S)
PIMCO Asia High Yield Bond Fund	\$ 1.057	\$ 0	\$ 818	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 0
Asia Strategic Interest Bond Fund	33	0	29	0	0	0	0	0
PIMCO Capital Securities Fund	195	0	401	(9.618)	0	0	0	0
PIMCO Climate Bond Fund	271	0	0	(4)	0	0	0	(1)
Commodity Real Return Fund	327	0	0	(4.073)	0	(105)	0	(1.859)
PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	127	0	0	0	0	0	0	0
Diversified Income Fund	15.705	0	3.046	(7)	0	0	0	0
Diversified Income Duration Hedged Fund	1.358	0	60	0	0	0	0	0
Dynamic Bond Fund	8.310	0	43	0	0	0	0	0
Dynamic Multi-Asset Fund	€ 148	€ 0	€ 0	€ (6)	€ 0	€ 0	€ 0	€ 0
Emerging Local Bond Fund	\$ 141	\$ (91)	\$ 0	\$ (6.016)	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 0
Emerging Markets Bond Fund	240	0	0	(994)	0	0	0	(87)
Emerging Markets Bond ESG Fund	888	0	137	(245)	0	0	0	0
Emerging Markets Corporate Bond Fund	33	0	0	(1)	0	0	0	0
PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	324	0	0	0	0	0	0	0
Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	12	0	0	0	0	0	0	0
PIMCO ESG Income Fund	514	0	0	0	0	0	0	0

Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

31. Dez. 2022

Fonds	Pensions-geschäfte		Umgekehrte Pensions-geschäfte		Buy-Sellback-Finanzierungs-geschäfte		Rückkauf-Finanzierungs-geschäfte	
	Renditen (000S)	Kosten (000S)	Renditen (000S)	Kosten (000S)	Renditen (000S)	Kosten (000S)	Renditen (000S)	Kosten (000S)
Euro Bond Fund	€ 9	€ (36)	€ 14	€ 0	€ 0	€ 0	€ 0	€ 0
Euro Credit Fund	56	0	4	0	0	0	0	0
Euro Income Bond Fund	13	(5)	44	0	0	0	0	0
Euro Long Average Duration Fund	0	(1)	0	0	0	0	0	0
Euro Short-Term Fund	0	(41)	0	0	0	0	0	0
PIMCO European High Yield Bond Fund	0	(15)	2	0	0	0	0	0
PIMCO European Short-Term Opportunities Fund	0	(29)	4	0	0	0	0	0
Global Advantage Fund	\$ 7	\$ 0	\$ 130	\$ (189)	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ (59)
Global Bond Fund	9.293	0	2.787	(1.200)	0	0	0	(31)
Global Bond ESG Fund	6.766	0	0	(8)	0	0	0	(1)
Global Bond Ex-US Fund	9	0	313	(50)	0	0	0	(12)
PIMCO Global Core Asset Allocation Fund	144	0	0	0	0	0	0	0
Global High Yield Bond Fund	1.677	0	387	(93)	0	0	0	0
Global Investment Grade Credit Fund	325	0	0	(70)	0	0	0	(7)
Global Investment Grade Credit ESG Fund	90	0	0	(830)	0	0	0	(234)
Global Low Duration Real Return Fund	28	0	0	(431)	0	(3)	0	(3.169)
Global Real Return Fund	108	0	58	(12.072)	0	0	0	(272)
Income Fund	93.412	(70)	1.457	0	0	0	0	(89)
Income Fund II	14	(1)	0	0	0	0	0	0
Inflation Multi-Asset Fund	1.101	0	0	(1)	0	0	0	(2)
Low Average Duration Fund	448	0	0	(959)	0	0	0	(199)
Low Duration Global Investment Grade Credit Fund	13	0	0	(150)	0	0	0	(45)
Low Duration Income Fund	1.256	0	0	0	0	0	0	0
Low Duration Opportunities Fund	2.501	0	8	(102)	0	0	0	0
PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	10	0	0	0	0	0	0	0
Mortgage Opportunities Fund	126	0	0	(6.518)	0	0	0	(7)
StocksPLUS™ Fund	2.323	0	0	0	0	0	0	0
PIMCO StocksPLUS™ AR Fund	26	0	0	0	0	0	0	0
Strategic Income Fund	7	0	0	(6)	0	0	0	(1)
Total Return Bond Fund	3.214	0	20	(353)	0	0	0	(22)
PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	174	0	0	0	0	0	0	0
UK Corporate Bond Fund	£ 145	£ 0	£ 0	£ (195)	£ 0	£ 0	£ 0	£ 0
UK Long Term Corporate Bond Fund	30	0	0	(86)	0	0	0	0
US High Yield Bond Fund	\$ 1.076	\$ 0	\$ 29	\$ (58)	\$ 0	\$ 0	\$ 1	\$ 0
US Investment Grade Corporate Bond Fund	45	0	0	(8)	0	0	0	(9)
US Short-Term Fund	1.315	0	0	(683)	0	0	0	(391)

31. Dez. 2021

Fonds	Pensions-geschäfte		Umgekehrte Pensions-geschäfte		Buy-Sellback-Finanzierungs-geschäfte		Rückkauf-Finanzierungs-geschäfte	
	Renditen (000S)	Kosten (000S)	Renditen (000S)	Kosten (000S)	Renditen (000S)	Kosten (000S)	Renditen (000S)	Kosten (000S)
PIMCO Asia High Yield Bond Fund	\$ 6	\$ 0	\$ 316	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 0
Asia Strategic Interest Bond Fund	0	0	4	0	0	0	0	0
PIMCO Capital Securities Fund	130	0	613	(1.519)	0	0	0	0
PIMCO Climate Bond Fund	13	(10)	0	0	0	0	0	0
Commodity Real Return Fund	5	0	2	(37)	0	0	12	0
Diversified Income Fund	164	(27)	1.615	0	0	0	0	0
Diversified Income Duration Hedged Fund	13	0	51	0	0	0	0	0
Dynamic Bond Fund	41	0	35	(28)	0	0	12	0
Dynamic Multi-Asset Fund	€ 17	€ (2.979)	€ 13	€ 0	€ 0	€ 0	€ 0	€ 0
Emerging Local Bond Fund	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ (5.769)	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 0
Emerging Markets Bond Fund	1	0	40	(371)	0	0	0	0
Emerging Markets Bond ESG Fund	28	0	85	(800)	0	0	0	0
Emerging Markets Corporate Bond Fund	0	0	6	(1)	0	0	0	(1)
PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	0	0	1	(10)	0	0	0	0
Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	1	0	0	0	0	0	0	0
PIMCO ESG Income Fund	0	0	0	(5)	0	0	0	0
Euro Bond Fund	€ 0	€ (275)	€ 0	€ 0	€ 0	€ 0	€ 0	€ 0
Euro Credit Fund	0	(46)	2	0	0	0	0	0
Euro Income Bond Fund	0	(99)	2	(36)	0	0	0	0

31. Dez. 2021

Fonds	Pensions- geschäfte		Umgekehrte Pensionsgeschäfte		Buy-Sellback- Finanzierungs- geschäfte		Rückkauf- Finanzierungs- geschäfte	
	Renditen (000S)	Kosten (000S)	Renditen (000S)	Kosten (000S)	Renditen (000S)	Kosten (000S)	Renditen (000S)	Kosten (000S)
Euro Long Average Duration Fund	€ 0	€ (13)	€ 17	€ 0	€ 0	€ 0	€ 0	€ 0
Euro Short-Term Fund	0	(205)	4	0	0	0	0	0
PIMCO European High Yield Bond Fund	0	(39)	0	0	0	0	0	0
PIMCO European Short-Term Opportunities Fund	0	(52)	14	0	0	0	0	0
Global Advantage Fund	\$ 0	\$ 0	\$ 63	\$ (27)	\$ 0	\$ 0	\$ 2	\$ 0
Global Bond Fund	0	(2)	168	(33)	0	0	0	(20)
Global Bond ESG Fund	9	0	0	(5)	0	0	0	(2)
Global Bond Ex-US Fund	0	0	378	(40)	0	0	0	(1)
PIMCO Global Core Asset Allocation Fund	1	0	0	0	0	0	0	0
Global High Yield Bond Fund	5	0	154	0	0	0	8	0
Global Investment Grade Credit Fund	24	0	279	0	0	0	86	0
Global Investment Grade Credit ESG Fund	2	0	1	(4)	0	0	0	(5)
Global Low Duration Real Return Fund	0	0	0	0	0	(2)	0	(149)
Global Real Return Fund	1	0	16	(583)	0	0	0	(17)
Income Fund	760	(138)	751	(1.147)	0	0	131	0
Inflation Multi-Asset Fund	0	0	0	(5)	0	0	0	(1)
Low Average Duration Fund	6	0	0	0	0	0	0	0
Low Duration Global Investment Grade Credit Fund	1	0	0	0	0	0	0	(2)
Low Duration Income Fund	4	0	1	0	0	0	0	0
Low Duration Opportunities Fund	19	0	9	0	0	0	1	0
Mortgage Opportunities Fund	3	0	0	(133)	0	0	0	0
StocksPLUS™ Fund	449	(33)	0	0	0	0	0	0
PIMCO StocksPLUS™ AR Fund	1	0	0	0	0	0	0	0
Strategic Income Fund	0	0	0	(20)	0	0	0	(5)
Total Return Bond Fund	20	0	2	0	0	0	0	(4)
PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	1	0	0	0	0	0	0	0
UK Corporate Bond Fund	£ 14	£ 0	£ 0	£ (32)	£ 0	£ 0	£ 0	£ 0
UK Long Term Corporate Bond Fund	1	0	0	(26)	0	0	0	0
US High Yield Bond Fund	6	0	38	0	0	0	7	0
US Investment Grade Corporate Bond Fund	0	0	1	(7)	0	0	0	(19)
US Short-Term Fund	61	0	0	0	0	0	0	0

Alle Renditen aus SFT-Derivatgeschäften laufen zugunsten des Fonds auf und fallen nicht unter Ertragsteilungsvereinbarungen mit der Verwaltungsgesellschaft der Gesellschaft oder sonstigen Dritten.

Für Total Return Swaps lassen sich die Transaktionskosten nicht separat identifizieren. Für diese Anlagen sind die Transaktionskosten im Kauf- und Verkaufspreis enthalten und bilden Teil des Bruttoanlageergebnisses jedes Fonds. Renditen werden als realisierte Gewinne und Veränderungen der nicht realisierten Gewinne auf den Swap-Kontrakt während des Geschäftsjahres identifiziert und sind in der Betriebsergebnisrechnung im realisierten Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten sowie in der Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten enthalten.

23. WESENTLICHE EREIGNISSE

Am 1. Januar 2022 änderte der Diversified Income Fund die Dividendenerklärungs- und -ausschüttungspolitik der Administrative Class von vierteljährlicher auf monatliche Basis.

Am 20. Januar 2022 wurde von der Verwaltungsgesellschaft eine Zeichnung in Höhe von 7.000.000 USD im US Short-Term Fund durchgeführt.

Im Februar 2022 startete Russland eine Invasion in der Ukraine, die zu Sanktionen gegen verschiedene russische Einrichtungen und Personen führte. Die Fonds können in Wertpapiere und Instrumente investieren, die wirtschaftlich an Russland gebunden sind. Solche Anlagen könnten durch die Sanktionen und Gegensanktionen Russlands beeinträchtigt worden sein, z. B. durch Wertverluste und Liquiditätsrückgänge. Die Verringerung der Liquidität von Anlagen, die an Russland gebunden sind, kann dazu führen, dass die Fonds Portfoliobestände zu

einem ungünstigen Zeitpunkt oder Preis verkaufen oder weiterhin an Russland gebundene Anlagen halten, die die Fonds möglicherweise nicht mehr halten wollen. PIMCO wird diese Positionen weiterhin aktiv im besten Interesse der Fonds und ihrer Anteilhaber verwalten.

Am 13. April 2022 wurde der Inflation Strategy Fund in Inflation Multi-Asset Fund umbenannt. Am selben Tag wurde die Benchmark in 45 % Bloomberg Global Inflation Linked 1-30yrs Index (USD Hedged), 15 % JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (USD Unhedged), 20 % Bloomberg Commodity Total Return Index, 10 % FTSE NAREIT Global Real Estate Developed Total Return Index (USD Unhedged) und 10 % Bloomberg Gold Subindex Total Return geändert. Der Satz der Verwaltungsgebühr für die Anteilklassen Administrative, Institutional, G Institutional und Investor wurde in 0,79 %, für die Anteilklasse H Institutional in 0,96 % und für die Anteilklassen E und Retail in 1,69 % geändert.

Am 13. April 2022 änderte der PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund die Verwaltungsgebühr für die Anteilklasse E von 2,20 % in 1,89 %.

Am 25. April 2022 wurde von der Verwaltungsgesellschaft eine Rücknahme in Höhe von 11.500.000 USD im US Short-Term Fund durchgeführt.

Am 1. Juli 2022 wurde der Global Libor Plus Bond Fund in Low Duration Opportunities Fund umbenannt. Am selben Tag wurde die Benchmark für den PIMCO Capital Securities Fund, den PIMCO Credit Opportunities Bond Fund, den Dynamic Bond Fund, den Dynamic Multi-Asset Fund, den Low Duration Opportunities Fund, den Mortgage Opportunities Fund und den PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund in den ICE BofA SOFR Overnight Rate Index geändert.

Am 27. Juli 2022 wurden der Diversified Income ESG Fund, der Emerging Local Bond ESG Fund und der Low Duration Opportunities ESG Fund aufgelegt.

Am 29. Juli 2022 wurde die Benchmark für den Strategic Income Fund in 75 % Bloomberg U.S. Aggregate Bond Index / 25 % MSCI ACWI High Dividend Yield Index geändert. Der Satz der Verwaltungsgebühr für die Anteilsklassen Administration, Institutional, G Institutional und Investor wurde in 0,79 %, für die Anteilsklasse H Institutional in 0,96 %, für die Anteilsklassen R in 0,93 % und für die Anteilsklassen E, R, T und Retail in 1,69 % geändert.

Zum Zeitpunkt der Erstellung dieses Berichts steigen die Zinssätze in den USA und in vielen Teilen der Welt, einschließlich einiger europäischer Länder, weiter an. In ihrem Bemühen, die Inflation zu bekämpfen, hat die US-Notenbank Fed die Zinssätze im Jahr 2022 mehrfach erhöht und die Erwartung geäußert, dass sie die Zinssätze im Jahr 2023 weiter anheben werde. Daher sind die Fonds derzeit einem erhöhten Risiko in Zusammenhang mit steigenden Zinssätzen und/oder Anleiherenditen ausgesetzt.

Abgesehen von den oben erwähnten Ereignissen waren während des Geschäftsjahres keine wesentlichen Ereignisse zu verzeichnen.

24. EREIGNISSE NACH ABSCHLUSS DES BERICHTSZEITRAUMS

Am 1. Januar 2023 lief der bisher geltende Verzicht auf die Verwaltungsgebühr für den Income Fund II aus. Am gleichen Tag wurde der Verzicht auf die Verwaltungsgebühr für den Low Duration Income Fund in einen unbefristeten Verzicht geändert. Die Gebühren haben sich nicht geändert, da die neue Verwaltungsgebühr der vorherigen Gebühr einschließlich des Verzichts entspricht.

Am 26. Januar 2023 wurde der Sekretär der Gesellschaft von State Street Fund Services (Ireland) Limited in Walkers Corporate Services (Ireland) Limited geändert.

Am 20. März 2023 stimmte USB dem Kauf von Credit Suisse zu. Da es sich hierbei um ein nicht berücksichtigungspflichtiges Ereignis handelt, wurden seine Auswirkungen nach dem Ende des Geschäftsjahres bei der Erfassung und Bewertung der Vermögenswerte oder Verbindlichkeiten der Fonds zum 31. Dezember 2022 nicht berücksichtigt.

Am 6. April 2023 wurde vom Manager eine Zeichnung in Höhe von 5.000.000 USD im US Short-Term Fund getätigt.

Abgesehen von den oben erwähnten Ereignissen waren nach Abschluss des Geschäftsjahres keine wesentlichen Ereignisse zu verzeichnen.

25. GENEHMIGUNG VON FINANZABSCHLÜSSEN

Dieser Abschluss wurde am 25. April 2023 vom Verwaltungsrat genehmigt.

Bericht des Verwaltungsrats

Der Verwaltungsrat legt den Anteilhabern den geprüften Jahresabschluss der Gesellschaft für das zum 31. Dezember 2022 endende Geschäftsjahr vor.

VERANTWORTUNG DES VERWALTUNGSRATS

Der Verwaltungsrat ist für die Erstellung des Jahresberichts und des Jahresabschlusses gemäß geltendem irischem Recht und den in Irland allgemein anerkannten Rechnungslegungsgrundsätzen verantwortlich, darunter dem vom Financial Reporting Council herausgegebenen Financial Reporting Standard 102 („FRS 102“), dem „The Financial Reporting Standard applicable in the United Kingdom and Republic of Ireland“, dem Companies Act 2014 und den UCITS Regulations.

Nach irischem Recht darf der Verwaltungsrat den Abschluss nur dann genehmigen, wenn er der Ansicht ist, dass dieser ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild der Vermögenswerte, der Verbindlichkeiten und der Finanzlage des Fonds zum Ende des Geschäftsjahres und des Gewinns oder Verlusts der Gesellschaft für das Geschäftsjahr widerspiegelt.

Bei der Erstellung des Abschlusses muss der Verwaltungsrat:

- geeignete Bilanzierungs- und Bewertungsmethoden auswählen und diese konsequent anwenden;
- vernünftige, vorsichtige Beurteilungen und Schätzungen vornehmen;
- angeben, ob der Abschluss in Übereinstimmung mit den geltenden Bilanzierungsgrundsätzen erstellt wurde, die entsprechenden Standards identifizieren und wesentliche Abweichungen von diesen Richtlinien in den Erläuterungen zum Abschluss angeben und erläutern; und
- den Abschluss auf der Basis der Unternehmensfortführung erstellen, es sei denn, es ist unangemessen, davon auszugehen, dass die Gesellschaft ihre Geschäftstätigkeit fortsetzen wird.

Der Verwaltungsrat ist für die Führung ordnungsgemäßer Geschäftsbücher verantwortlich, die ausreichend sind, um:

- die Transaktionen der Gesellschaft korrekt zu erfassen und zu erläutern;
- jederzeit die Ermittlung der Vermögenswerte, der Verbindlichkeiten, der Finanzlage und des Gewinns oder Verlusts der Gesellschaft mit angemessener Genauigkeit zu ermöglichen; und
- den Verwaltungsrat in die Lage zu versetzen, sicherzustellen, dass der Abschluss dem Companies Act von 2014 entspricht, und eine Prüfung dieses Abschlusses zu ermöglichen.

Darüber hinaus ist der Verwaltungsrat für den Schutz des Vermögens der Gesellschaft und somit für das Ergreifen angemessener Maßnahmen verantwortlich, um Betrug und anderen Regelwidrigkeiten vorzubeugen und diese aufzudecken.

Der Verwaltungsrat ist für die Pflege und Integrität der Unternehmens- und Finanzinformationen auf der Website der Gesellschaft verantwortlich. Die Gesetzgebung Irlands, die die Erstellung und Verteilung der Abschlüsse regelt, kann sich von der Gesetzgebung anderer Rechtsräume unterscheiden.

ENTSPRECHENERKLÄRUNG DES VERWALTUNGSRATS

Die Gesellschaft verfolgt die Politik, ihre maßgeblichen Pflichten (gemäß Definition im Companies Act von 2014) zu erfüllen. Wie gemäß Section 225(2) des Companies Act von 2014 erforderlich, bestätigt der Verwaltungsrat, dass er dafür verantwortlich ist, die Erfüllung der maßgeblichen Pflichten durch die Gesellschaft sicherzustellen. Der Verwaltungsrat hat eine Compliance-Grundsatzklärung im Sinne von Section 225(3)(a) des Companies Act von 2014 sowie eine Compliance-Richtlinie erarbeitet, die sich auf die Vorkehrungen und Strukturen bezieht, die eingerichtet wurden und nach Einschätzung des Verwaltungsrats darauf ausgelegt sind, eine wesentliche Erfüllung der maßgeblichen Pflichten der Gesellschaft sicherzustellen. Zudem hat der Verwaltungsrat während dieses Geschäftsjahres eine Prüfung entsprechender Vorkehrungen und Strukturen, die eingerichtet wurden, durchgeführt. Bei der Erfüllung seiner Verantwortlichkeiten gemäß Section 225 hat sich der Verwaltungsrat unter anderem auf bereitgestellte Dienste, Ratschläge und/oder Erklärungen von Dritten verlassen, die nach Einschätzung des Verwaltungsrats über das erforderliche Wissen und die Erfahrung verfügen, um eine wesentliche Erfüllung der maßgeblichen Pflichten der Gesellschaft sicherzustellen.

ANGESTELLTE

Die Gesellschaft hatte während der Geschäftsjahre zum 31. Dezember 2022 oder 31. Dezember 2021 keine Angestellten.

ERKLÄRUNG ZU PRÜFUNGSRELEVANTEN ANGABEN

Die zum Datum dieses Berichts amtierenden Verwaltungsratsmitglieder haben jeweils bestätigt, dass:

- es nach ihrer Kenntnis keine relevanten Prüfungsinformationen gibt, die dem Abschlussprüfer der Gesellschaft nicht vorliegen; und

- sie alle Schritte unternommen haben, die von ihnen als Mitglieder des Verwaltungsrats erwartet werden, um Kenntnis aller prüfungsrelevanten Informationen zu erlangen und zu gewährleisten, dass der Abschlussprüfer der Gesellschaft diese Informationen erhält.

ERGEBNISSE, AKTIVITÄTEN UND ZUKÜNFTIGE ENTWICKLUNGEN

Die Betriebsergebnisse und festgesetzten Dividenden werden in der Betriebsergebnisrechnung auf den Seiten 92 bis 110 ausgewiesen. Die Seiten 6 bis 66 enthalten einen Überblick über die Entwicklung der Anlagen der Fonds und ihrer Portfolios.

HAUPTTRISIKEN UND UNGEWISSEHEITEN

Einzelheiten zu den Risikomanagementzielen und -grundsätzen der Gesellschaft und dem Marktpreis-, Fremdwährungs-, Zins-, Liquiditäts- und Kredit- und Kontrahentenrisiko der Gesellschaft sind in Erläuterung 16 in den Erläuterungen zum Abschluss angegeben.

WESENTLICHE EREIGNISSE

Eine Liste der wesentlichen Ereignisse, die während des Geschäftsjahres Einfluss auf die Gesellschaft hatten, ist in Erläuterung 23 angegeben.

EREIGNISSE NACH DEM BILANZSTICHTAG

Eine Liste der Ereignisse nach dem Bilanzstichtag, die nach Ende des Geschäftsjahres Einfluss auf die Gesellschaft hatten, ist in Erläuterung 24 angegeben.

GESCHÄFTSBÜCHER

Die vom Verwaltungsrat ergriffenen Maßnahmen mit dem Ziel, die Erfüllung der Pflicht der Gesellschaft zur Führung ordnungsgemäßer Geschäftsbücher zu gewährleisten, umfassen den Einsatz geeigneter Systeme und Verfahren sowie den Einsatz kompetenter Personen. Die Geschäftsbücher werden bei State Street Fund Services (Ireland) Limited, 78 Sir John Rogerson's Quay, Dublin D02 HD32, Irland aufbewahrt.

CORPORATE GOVERNANCE

Die Gesellschaft unterliegt irischem Recht und ist mit diesem konform, einschließlich des Companies Acts von 2014, der European Communities (Undertakings for Collective Investment in Transferable Securities) Regulations 2011 (S.I. Nr. 352 aus 2011) (die „UCITS Regulations“) sowie den für Investmentfonds geltenden Regeln für die Notierung am Global Exchange Market („GEM“) der Euronext Dublin. Der Verwaltungsrat (der „Verwaltungsrat“) hat die Maßgaben geprüft, die in dem von der Irish Fund Industry Association im Dezember 2011 veröffentlichten freiwilligen Corporate Governance Code for Collective Investment Schemes and Management Companies enthalten sind (der „IFIA-Code“). Der Verwaltungsrat hat sämtliche Governance-Praktiken und -Verfahren des IFIA-Code angenommen.

Der Verwaltungsrat hat erklärt, dass die Maßnahmen im IFIA-Code mit seinen Corporate-Governance-Praktiken und -verfahren für das Geschäftsjahr übereinstimmen. Die einzelnen, von der Gesellschaft engagierten Dienstleister unterliegen ihren eigenen Corporate-Governance-Anforderungen.

Finanzberichterstattung – Beschreibung der wichtigsten Merkmale

Der Verwaltungsrat muss für die Finanzberichterstattung angemessene interne Systeme zur Kontrolle und Verwaltung des Risikos der Gesellschaft einführen und aufrechterhalten. Derartige Systeme haben nicht zum Ziel, das Risiko, dass die Gesellschaft ihre Ziele im Zusammenhang mit der Finanzberichterstattung nicht erreicht, völlig auszuschalten, sondern es zu verwalten. Sie bieten keine vollständige, jedoch eine angemessene Absicherung gegen falsche Darstellungen und Verluste.

Der Verwaltungsrat verfügt über bewährte Verfahren im Zusammenhang mit Systemen für interne die Kontrolle und das Risikomanagement, um die effiziente Überwachung des Finanzberichterstattungsverfahrens zu gewährleisten. Dies schließt die Bestellung des Administrators, State Street Fund Administration Services (Ireland) Limited, zur Führung der Bücher und Aufzeichnungen ein. Der Administrator ist von der Zentralbank zugelassen und reguliert und muss sich an die von ihr erlassenen Regeln halten. Darüber hinaus ist der Administrator vertraglich verpflichtet, den Jahresbericht, einschließlich des Abschlusses, der ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild der Geschäftslage der Gesellschaft geben soll, sowie die Halbjahresabschlüsse zu erstellen, die durch den Verwaltungsrat überprüft und genehmigt werden.

Der Verwaltungsrat beurteilt und diskutiert bei Bedarf wesentliche Probleme im Zusammenhang mit der Rechnungslegung und Berichterstattung. Darüber hinaus untersucht und beurteilt der Verwaltungsrat von Zeit zu Zeit die Finanzbuchhaltungs- und Berichterstattungsprozeduren des Administrators und überwacht und bewertet die Leistung, Qualifikation und Unabhängigkeit des externen Abschlussprüfers. Der Administrator hat die operative Verantwortung für seine internen Kontrollen im Zusammenhang mit dem Finanzberichterstattungsverfahren und dem Bericht des Administrators an den Verwaltungsrat.

Risikobewertung

Der Verwaltungsrat ist für die Beurteilung des Risikos von Regelwidrigkeiten verantwortlich, unabhängig davon, ob diese auf Betrug oder Fehler in der Finanzberichterstattung zurückzuführen sind. Darüber hinaus muss er gewährleisten, dass entsprechende Verfahren zur rechtzeitigen Identifizierung interner und externer Angelegenheiten existieren, die sich möglicherweise auf die Finanzberichterstattung auswirken. Darüber hinaus hat der Verwaltungsrat Verfahren zur Identifizierung von Änderungen der Rechnungslegungsregeln und -empfehlungen eingeführt, und um zu gewährleisten, dass diesen Veränderungen in den Abschlüssen der Gesellschaft entsprechend Rechnung getragen wird.

Kontrollaktivitäten

Der Administrator verfügt über Kontrollstrukturen zur Verwaltung der mit der Finanzberichterstattung verbundenen Risiken. Diese Kontrollstrukturen umfassen die angemessene Teilung der Verantwortung und spezifischen Kontrollaktivitäten mit dem Ziel, für alle wichtigen Konten im Abschluss und in den entsprechenden Erläuterungen im Jahresbericht der Gesellschaft wesentliche Mängel in der Finanzberichterstattung aufzudecken oder solchen vorzubeugen. Beispiele für die durch den Administrator durchgeführten Kontrollen sind analytische Prüfungen, Abgleiche und automatische Kontrollen der IT-Systeme. Die Methode zur Bewertung von Wertpapieren und anderen Vermögenswerten, wenn keine Kurse aus externen, unabhängigen Quellen verfügbar sind, wird in Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss beschrieben.

Information und Kommunikation

Um zu gewährleisten, dass die Anforderungen an die Informationen über die Finanzberichterstattung vollständig und angemessen erfüllt werden, werden die Grundsätze der Gesellschaft und die Anweisungen des Verwaltungsrats, die Auswirkungen auf die Finanzberichterstattung haben, über geeignete Kanäle aktualisiert und mitgeteilt, z. B. über E-Mail, Schriftverkehr und Versammlungen.

Überwachung

Der Verwaltungsrat erhält regelmäßig Präsentationen und Kontrollberichte von der Verwahrstelle, der Anlageberatungsgesellschaft und dem Administrator. Des Weiteren verfügt der Verwaltungsrat über ein jährliches Verfahren, um angemessene Reaktionen auf vom unabhängigen Abschlussprüfer identifizierte Mängel und empfohlene Maßnahmen zu gewährleisten.

Kapitalstruktur

Niemand hält eine wesentliche direkte oder indirekte Beteiligung an der Gesellschaft. Niemand verfügt über besondere Kontrollrechte am Grundkapital der Gesellschaft.

Die Stimmrechte sind in keiner Weise eingeschränkt.

Befugnisse des Verwaltungsrats

Im Hinblick auf die Ernennung und Ersetzung von Verwaltungsratsmitgliedern unterliegt die Gesellschaft ihrer Satzung, den irischen Gesetzen einschließlich dem Companies Act von 2014, den UCITS Regulations und den für Investmentfonds geltenden Notierungsregeln am GEM der Euronext Dublin. Die Satzung der Gesellschaft kann durch besonderen Beschluss der Anteilinhaber geändert werden.

Der Verwaltungsrat ist dafür verantwortlich, die Geschäfte der Gesellschaft in Übereinstimmung mit der Satzung zu führen. Der Verwaltungsrat kann bestimmte Aufgaben an den Administrator und andere Parteien übertragen, wobei diese der Überwachung und Leitung des Verwaltungsrats unterstehen. Der Verwaltungsrat hat den Administrator mit der täglichen Verwaltung der Gesellschaft beauftragt und hat die Anlageverwaltung und die Vertriebsfunktionen an die Anlageverwaltungsgesellschaft übertragen. Kein Verwaltungsratsmitglied ist daher ein geschäftsführendes Verwaltungsratsmitglied.

Gemäß der Satzung darf der Verwaltungsrat die Befugnisse der Gesellschaft wahrnehmen, wie z. B. Kredite aufnehmen oder vergeben, das Unternehmen, dessen Eigentum oder einen Teil davon hypothekarisch oder anderweitig belasten, oder sie an die Anlageverwaltungsgesellschaft übertragen.

In den folgenden Situationen darf der Verwaltungsrat jederzeit und zu gegebener Zeit die Berechnung des Nettoinventarwerts eines bestimmten Fonds sowie die Ausgabe, die Rücknahme und den Umtausch von Anteilen vorübergehend aussetzen:

(a) während Zeiträumen (mit Ausnahme von gesetzlichen Feiertagen oder üblichen Schließungen an Wochenenden), in denen ein Markt oder eine anerkannte Börse geschlossen oder der Handel an ihm/ihr eingeschränkt ist, der/die den Hauptmarkt für einen wesentlichen Teil der Anlagen des betreffenden Fonds bildet;

(b) während Zeiträumen, in denen eine Notsituation vorliegt, die dazu führt, dass die Gesellschaft Anlagen, die einen wesentlichen Teil des Vermögens einer bestimmten Klasse bilden, praktisch nicht veräußern kann, die Übertragung von Geldern für den Erwerb oder die Veräußerung von Anlagen zu normalen Wechselkursen nicht möglich ist oder der Verwaltungsrat oder dessen Bevollmächtigter praktisch nicht in der Lage ist, den Wert von Anlagen des betreffenden Fonds angemessen zu bestimmen;

(c) während eines Ausfalls der normalerweise zur Bestimmung des Preises irgendeiner Anlage des betreffenden Fonds oder der aktuellen Kurse an einem beliebigen Markt oder einer anerkannten Börse verwendeten Kommunikationsmittel;

(d) wenn aus irgendeinem Grund die Preise einer Anlage der betreffenden Klasse nicht angemessen, umgehend oder genau ermittelt werden können;

(e) während Zeiträumen, in denen die Überweisung von Geldern für die Zahlung einer der Anlagen der betreffenden Klasse nach Meinung des Verwaltungsrats nicht zu normalen Wechselkursen möglich ist;

(f) bei Abwicklung der Gesellschaft oder Beendigung eines Fonds; oder

(g) wenn dem Bevollmächtigten die angemessene Bestimmung des Wertes eines wesentlichen Teils der Anlagen der Gesellschaft oder eines Fonds aus einem anderen Grund unmöglich oder undurchführbar ist.

Die Zentralbank und die Euronext Dublin müssen umgehend über eine derartige Aussetzung und über das Ende einer derartigen Aussetzung informiert werden. Darüber hinaus muss sie die Anteilzeichnern und Anteilinhabern, die die Rücknahme ihrer Anteile beantragen, bei Antragstellung oder Registrierung des schriftlichen Antrags auf Rücknahme mitgeteilt werden. Soweit möglich werden alle angemessenen Schritte unternommen, um die Aussetzung so schnell wie möglich zu beenden.

Eingetragene Anteile können schriftlich übertragen werden. Der schriftlichen Übertragung muss eine Bescheinigung des Übertragungsempfängers beiliegen, dass er die Anteile nicht für eine oder zugunsten einer US-Person erwirbt. Im Falle des Todes eines Mitanteilinhabers sind die anderen Mitanteilinhaber die einzigen Personen, die laut Administrator Anspruch auf das Eigentum oder eine Beteiligung an den auf den Namen der Mitanteilinhaber eingetragenen Anteile haben. Der Verwaltungsrat kann die Eintragung einer Übertragung ablehnen, wenn er darüber informiert oder davon überzeugt ist, dass die Übertragung dazu führen würde, dass das wirtschaftliche Eigentum einer Person zufällt, die damit gegen die vom Verwaltungsrat auferlegten Einschränkungen für den Besitz verstößt oder rechtliche, aufsichtsrechtliche, geldliche, steuerliche oder wesentliche administrative Nachteile für den entsprechenden Fonds oder die Anteilinhaber allgemein zur Folge hätte.

Versammlungen der Anteilinhaber

Die Jahreshauptversammlung der Gesellschaft findet normalerweise im Mai, an einem vom Verwaltungsrat festgelegten Datum in Dublin statt. Die Einladung zur Jahreshauptversammlung, auf der jedes Jahr der geprüfte Jahresabschluss der Gesellschaft (und die Berichte des Verwaltungsrats und der Abschlussprüfer) vorgelegt wird, wird den Anteilinhabern mindestens 21 volle Tage vor dem Datum der Versammlung an ihre eingetragene Anschrift zugesandt. Der Verwaltungsrat kann zu gegebener Zeit gemäß irischem Recht andere Hauptversammlungen einberufen.

Jeder Anteil berechtigt seinen Inhaber, an den Hauptversammlungen der Gesellschaft und des Fonds, den die Anteile repräsentieren, teilzunehmen und auf diesen abzustimmen. Auf Versammlungen der Anteilinhaber kann die Abstimmung per Handzeichen erfolgen, es sei denn, ein Anteilinhaber mit Stimmrecht auf der Versammlung oder der Vorsitzende der Versammlung verlangt eine Abstimmung per Stimmzettel. Bei einer Abstimmung per Handzeichen verfügt jeder Anteilinhaber über eine Stimme. Bei Angelegenheiten im Zusammenhang mit der Gesellschaft, die den Anteilinhabern zur Abstimmung per Stimmzettel vorgelegt werden, verleiht jeder Anteil seinem Inhaber eine Stimme.

Keine Anteilsklasse verleiht ihren Anteilinhabern Vorzugs- oder Vorrechte oder Rechte auf Beteiligung an den Gewinnen oder Dividenden einer anderen Anteilsklasse oder Stimmrechte im Zusammenhang mit Angelegenheiten, die sich ausschließlich auf eine andere Anteilsklasse beziehen.

Beschlüsse zur Änderung der mit einer Anteilsklasse verbundenen Rechte erfordern die Zustimmung von drei Vierteln der Inhaber der Anteile, die auf der Hauptversammlung der Anteilsklasse anwesend oder vertreten sind und an der Abstimmung teilnehmen. Die beschlussfähige Mehrheit für Hauptversammlungen von Anteilsklassen, auf denen über eine Änderung der mit der Klasse verbundenen Rechte entschieden wird, beträgt mindestens zwei Personen, deren Anteilsbesitz ein Drittel der Anteile ausmacht.

Alle Anteile mit Ausnahme der Zeichneranteile geben dem Anteilinhaber Anspruch auf eine anteilmäßige Beteiligung an den Dividenden und am Nettovermögen des Fonds, der die Anteile ausgegeben hat. Dies gilt nicht für Dividenden, die vor dem Erwerb der Anteile durch den Anteilinhaber festgesetzt wurden.

Zeichneranteile berechtigen ihre Inhaber zur Teilnahme an und Abstimmung auf allen Hauptversammlungen der Gesellschaft, verleihen jedoch keinen Anspruch auf eine Beteiligung an den Dividenden oder am Nettovermögen der Gesellschaft.

Zusammensetzung und Funktionsweise des Verwaltungsrats und seiner Ausschüsse
Der Verwaltungsrat besteht derzeit aus sechs Mitgliedern, von denen keines geschäftsführende Aufgaben übernimmt und von denen drei von den Anlageberatungsgesellschaften unabhängig sind. Die Verwaltungsratsmitglieder können durch einen ordentlichen Beschluss der Anteilinhaber gemäß den durch den Irish Companies Act von 2014 festgelegten Verfahren ihres Amtes enthoben werden. Der Verwaltungsrat tritt während jedes Kalenderjahres mindestens einmal pro Quartal zusammen. Der Verwaltungsrat verfügt über einen für die Abschlussprüfung zuständigen Prüfungsausschuss, der derzeit aus drei unabhängigen Mitgliedern besteht und im Laufe des Berichtsjahres viermal zusammengetreten ist.

TRANSAKTIONEN MIT VERBUNDENEN PERSONEN

Transaktionen, die mit der Verwaltungsgesellschaft oder Verwahrstelle eines OGAW, den Beauftragten oder Unterbeauftragten einer solchen Verwaltungsgesellschaft oder Verwahrstelle (unter Ausschluss von konzernfremden, von einer Verwahrstelle bestellten Unterverwahrstellen) oder angeschlossenen Unternehmen oder Konzerngesellschaften einer solchen Verwaltungsgesellschaft, Verwahrstelle oder von entsprechenden Beauftragten oder Unterbeauftragten („verbundene Personen“) durchgeführt werden, müssen so durchgeführt werden, als wären sie unter gewöhnlichen geschäftlichen Bedingungen ausgehandelt worden, und nur dann, wenn sie im besten Interesse der Anteilinhaber sind. Der Verwaltungsrat ist davon überzeugt, dass Vorkehrungen (durch schriftliche Verfahren nachgewiesen) getroffen wurden, um sicherzustellen, dass Transaktionen mit verbundenen Personen wie oben beschrieben durchgeführt werden, und dass diese Vorkehrungen während des Geschäftsjahres eingehalten wurden.

MITGLIEDER DES VERWALTUNGSRATS

Im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 setzte sich der Verwaltungsrat aus folgenden Mitgliedern zusammen:

V. Mangala Ananthanarayanan – ernannt am 30. Juni 2016
Ryan P. Blute – ernannt am 30. Mai 2014
John Bruton – ernannt am 28. Februar 2018
Craig A. Dawson – ernannt am 6. Mai 2009
David M. Kennedy – ernannt am 16. April 1999
Frances Ruane – ernannt am 28. Februar 2018

Die Satzung sieht keinen turnusmäßigen Rücktritt der Verwaltungsratsmitglieder vor.

SEKRETÄR

State Street Fund Services (Ireland) Limited war während des zum 31. Dezember 2022 endenden Geschäftsjahres Sekretär der Gesellschaft.

BETEILIGUNGEN DER VERWALTUNGSRATSMITGLIEDER UND DES SEKRETÄRS AN ANTEILEN UND VERTRÄGEN

Zum 31. Dezember 2022 hielt V. Mangala Ananthanarayanan 8.187,77 (31. Dezember 2021: 8.187,77) Anteile des PIMCO Asia High Yield Bond Fund, 5.319,15 (31. Dezember 2021: Null) Anteile des PIMCO Capital Securities Fund, 8.757,87 (31. Dezember 2021: 8.757,87) Anteile des Dynamic Multi-Asset Fund, 3.619,69 (31. Dezember 2021: 0) Anteile des Emerging Markets Bond Fund und 27.543,65 (31. Dezember 2021: 22.028,26) Anteile des Income Fund, wobei es sich jeweils um Fonds der Gesellschaft handelt.

Zum 31. Dezember 2022 hielt Ryan P. Blute 5.387,93 (31. Dezember 2021: 5.387,93) Anteile des PIMCO Asia High Yield Bond Fund, 24.131,27 (31. Dezember 2021: 24.131,27) Anteile des Low Average Duration Fund und 82.494,63 (31. Dezember 2021: 72.957,20) Anteile des Low Duration Income Fund, wobei es sich jeweils um Fonds der Gesellschaft handelt.

Zum 31. Dezember 2022 hielt Craig A. Dawson 18.118,23 (31. Dezember 2021: 18.118,23) Anteile des PIMCO Capital Securities Fund, 97.370,98 (31. Dezember 2021: 97.370,98) Anteile des Duration Income Fund und 92.850,51 (31. Dezember 2021: 92.850,51) Anteile des Low Duration Opportunities Fund, wobei es sich jeweils um Fonds der Gesellschaft handelt.

Zum 31. Dezember 2022 hielt David M. Kennedy 4.449,56 (31. Dezember 2021: 4.729,05) Anteile des Emerging Markets Bond Fund und 16.786,79 (31. Dezember 2021: 16.786,79) Anteile des PIMCO Global Core Asset Allocation Fund. Beide sind Fonds der Gesellschaft.

Während der zum 31. Dezember 2022 bzw. zum 31. Dezember 2021 endenden Geschäftsjahre hielt der Sekretär keine Beteiligung an Anteilen der Gesellschaft.

Keines der Verwaltungsratsmitglieder verfügte über einen Dienstleistungsvertrag mit der Gesellschaft.

RECHTSBERATER FÜR IRISCHES RECHT

Dillon Eustace LLP war während des Geschäftsjahres zum 31. Dezember 2022 Rechtsberater (für irisches Recht) der Gesellschaft.

UNABHÄNGIGE ABSCHLUSSPRÜFER

Die unabhängigen Abschlussprüfer, PricewaterhouseCoopers, haben ihre Bereitschaft bestätigt, ihre Aufgabe weiterhin gemäß § 383 des Companies Act von 2014 wahrzunehmen.

Für den Verwaltungsrat

Verwaltungsratsmitglied: Craig A. Dawson

Verwaltungsratsmitglied: David M. Kennedy

Datum: 25. April 2023

Bericht des unabhängigen Abschlussprüfers an die Anteilhaber der Pimco Funds: Global Investors Series plc

The German version of the audit report represents a translation, for information purposes, of the original Auditor's report issued in the English language. In the event that the English version of this report and a translation of it into a language other than English differ, the English version shall prevail.

Bericht über die Prüfung des Abschlusses

Testat

Nach unserer Einschätzung

- vermittelt der Abschluss von PIMCO Funds: Global Investor Series plc ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild der Vermögenswerte, der Verbindlichkeiten und der Finanzlage der Gesellschaft und der Fonds zum 31. Dezember 2022 sowie der Ergebnisse für das an diesem Tag abgelaufene Geschäftsjahr;
- wurde der Abschluss ordnungsgemäß im Einklang mit den in Irland allgemein anerkannten Bilanzierungsrichtlinien (die vom Financial Reporting Council des Vereinigten Königreichs ausgegebenen Rechnungslegungsstandards, einschließlich Financial Reporting Standard 102 „The Financial Reporting Standard applicable in the UK and Republic of Ireland“ und irisches Recht) erstellt; und
- wurde der Abschluss in Übereinstimmung mit den Vorschriften des Companies Acts von 2014 und den European Communities (Undertakings for Collective Investment in Transferable Securities) Regulations von 2011 (in der jeweils gültigen Fassung) ordnungsgemäß erstellt.

Wir haben den im Jahresbericht enthaltenen Abschluss geprüft, der Folgendes umfasst:

- den Finanzstatus zum 31. Dezember 2022;
- die Betriebsergebnisrechnung für das an diesem Tag abgelaufene Geschäftsjahr;
- den Ausweis der Veränderungen im Nettovermögen für das an diesem Tag abgelaufene Geschäftsjahr;
- die Aufstellung der Wertpapieranlagen jedes Teilfonds zum 31. Dezember 2022; und
- die Erläuterungen zum Abschluss für die Gesellschaft sowie für sämtliche Teilfonds, einschließlich einer Beschreibung der wichtigsten Bilanzierungs- und Bewertungsmethoden.

Grundlage unseres Bestätigungsvermerks

Wir haben unsere Prüfung gemäß den International Standards on Auditing (Ireland) („ISAs (Ireland)“) und geltendem Recht durchgeführt.

Unsere Verantwortlichkeiten im Rahmen der ISAs (Ireland) sind im Abschnitt „Verantwortung der Abschlussprüfer für die Prüfung des Abschlusses“ unseres Berichts näher beschrieben. Wir sind der Auffassung, dass die von uns erlangten Prüfungsnachweise ausreichend und angemessen sind, um eine Grundlage für unser Prüfungsurteil zu bilden.

Unabhängigkeit

Wir sind gemäß den ethischen Anforderungen, die für unsere Prüfung des Abschlusses in Irland relevant sind und die den Ethikstandard der IAASA, wie er auf börsennotierte Unternehmen anzuwenden ist, umfassen, von der Gesellschaft unabhängig geblieben und haben unsere sonstigen ethischen Verpflichtungen gemäß mit diesen Anforderungen erfüllt.

Unser Prüfungsansatz

Überblick



Wesentlichkeit

- Allgemeine Wesentlichkeit: 50 Basispunkte (2021: 50 Basispunkte) des Nettoinventarwerts („NIW“) zum 31. Dezember 2022 (2021: 31. Dezember 2021) für jeden Teilfonds der Gesellschaft.
- Toleranzwesentlichkeit: 75 % der allgemeinen Wesentlichkeit.

Prüfungsumfang

- Bei der Gesellschaft handelt es sich um eine offene Investmentgesellschaft mit variablem Kapital. Sie hat PIMCO Global Advisors (Ireland) Limited (die „Verwaltungsgesellschaft“) mit der Verwaltung bestimmter Pflichten und Verantwortlichkeiten im Zusammenhang mit der täglichen Verwaltung der Gesellschaft beauftragt. Bei der Bestimmung des Umfangs unserer Prüfung haben wir die Arten von Anlagen der Fonds, die Beteiligung der unten bzw. umseitig aufgeführten Dritten, die bilanziellen Verfahren und Kontrollen sowie die Branche, in der die Gesellschaft tätig ist, berücksichtigt. Wir betrachten jeden Fonds einzeln.

Wesentliche Prüfungsschwerpunkte

- Bewertung der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und finanziellen Verbindlichkeiten.
- Vorliegen der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten.

Umfang unserer Prüfung

Im Rahmen der Planung unserer Prüfung haben wir die Wesentlichkeit ermittelt und die Risiken wesentlicher Falschangaben im Abschluss beurteilt. Insbesondere haben wir Bereiche untersucht, in denen der Verwaltungsrat subjektive Beurteilungen vorgenommen hat, beispielsweise bei der Auswahl von Preisquellen für die Bewertung des Anlageportfolios. Wie in unseren Prüfungen üblich, sind wir auch auf das Risiko eingegangen, dass die Unternehmensleitung interne Kontrollmaßnahmen umgehen könnte. Unter anderem haben wir untersucht, ob Hinweise auf eine Voreingenommenheit des Verwaltungsrats vorliegen, wodurch sich ein Risiko wesentlicher Falschangaben aufgrund von Betrug ergeben könnte.

Wesentliche Prüfungsschwerpunkte

Bei den wesentlichen Prüfungsschwerpunkten handelt es sich um diejenigen Sachverhalte, die nach pflichtgemäßem Ermessen der Abschlussprüfer für die Prüfung des Abschlusses für den aktuellen Berichtszeitraum von größter Bedeutung waren. Sie umfassen die erheblichsten von den Abschlussprüfern ermittelten Risiken wesentlicher Falschdarstellungen (sei es aufgrund von Betrug oder anderweitig), einschließlich der Risiken mit den stärksten Auswirkungen auf die Prüfungsstrategie insgesamt, die Zuteilung von Ressourcen im Rahmen der Prüfung und die Steuerung der Anstrengungen des Prüfungsteams. Diese Sachverhalte und alle Bemerkungen, die wir zu den Ergebnissen unserer diesbezüglichen Verfahren machen, wurden im Rahmen unserer Prüfung des Abschlusses als Ganzes und bei der Erstellung unseres Bestätigungsvermerks behandelt, und wir geben zu diesen Sachverhalten kein gesondertes Prüfungsurteil ab. Hierbei handelt es sich nicht um eine vollständige Liste sämtlicher im Rahmen unserer Prüfung identifizierten Risiken.

Wesentlicher Prüfungsschwerpunkt

Bewertung der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten.

Informationen hierzu finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen für den jeweiligen Fonds, unter „Wichtige Bilanzierungs- und Bewertungsmethoden“ in Erläuterung 2 und unter „Anlagen zum Marktwert und Marktbewertungshierarchie“ in Erläuterung 3. Die im Finanzstatus enthaltenen erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten zum 31. Dezember 2022 werden gemäß den in Irland allgemein anerkannten Bilanzierungsrichtlinien zum beizulegenden Zeitwert bewertet. Wir betrachteten die erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert erfolgte Bewertung von finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten als wesentlichen Prüfungsschwerpunkt, da diese das Hauptelement des Abschlusses darstellt.

Umgang mit dem Prüfungsschwerpunkt im Rahmen unserer Prüfung

Wir prüften die Bewertung der übertragbaren Wertpapiere, Einlagen bei Kreditinstituten und den Marktwert der leer verkauften Wertpapiere zum 31. Dezember 2022 unter Einbeziehung von Quellen von Drittanbietern, soweit verfügbar. Aufgrund des Fehlens von Quellen von Drittanbietern für bestimmte Wertpapiere der Stufe 1 oder 2 haben wir alternative Prüfverfahren durchgeführt, die u. a. das Einholen von Bestätigungen für Brokerangebote oder Unterstützung bei der Preisfindung durch die Geschäftsführung umfassten. Wir überprüften den beizulegenden Zeitwert der übertragbaren Wertpapiere, die als Anlagen der Stufe 3 ausgewiesen wurden, indem wir die Methoden und Daten berücksichtigten, die von der Geschäftsleitung zur Entwicklung der geschätzten Marktwerte verwendet wurden. Für bestimmte Positionen der Stufe 3, die in der Aufstellung der Wertpapieranlagen für den Emerging Local Bond Fund ausgewiesen sind, haben wir den Marktwert von Wertpapieren, die von der Geschäftsleitung durch den Einsatz unseres internen Bewertungsexperten geprüft, um eine unabhängige Schätzung des Marktwerts zu entwickeln. Wir haben die Ergebnisse unserer unabhängigen Bewertung mit der Schätzung der Geschäftsleitung verglichen, um festzustellen, ob die Schätzung des Marktwerts durch die Geschäftsleitung angemessen war. Investmentfonds umfassen börsengehandelte Fonds und Organismen für gemeinsame Anlagen. Wir haben die Bewertung börsengehandelter Fonds anhand von Drittanbieter-Quellen überprüft. In Bezug auf Organismen für gemeinsame Anlagen haben wir den Marktwert mit einer unabhängigen Bestätigung der zugrunde liegenden Transferstelle abgestimmt. Wir prüften den Marktwert von Pensionsgeschäften durch Abstimmung des Marktwertes mit Angaben von Gegenparteien. Wir haben die Bewertung der derivativen Finanzinstrumente überprüft, indem wir unseren internen Bewertungsexperten damit beauftragten, eine unabhängige Schätzung des Marktwerts zu entwickeln und festzustellen, ob die Schätzung des Marktwerts durch die Geschäftsleitung angemessen war, oder indem wir Preise von Drittanbietern einholten, sofern verfügbar. Bei der Durchführung dieser Verfahren wurden keine wesentlichen Fehldarstellungen festgestellt.

Vorliegen der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten.

Informationen hierzu finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen für den jeweiligen Fonds, unter „Wichtige Bilanzierungs- und Bewertungsmethoden“ in Erläuterung 2 und unter „Anlagen zum Marktwert und Marktbewertungshierarchie“ in Erläuterung 3. Die im Finanzstatus ausgewiesenen erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und finanziellen Verbindlichkeiten der jeweiligen Fonds wurden zum 31. Dezember 2022 im Namen der einzelnen Fonds gehalten. Wir betrachteten das Vorhandensein von erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und finanziellen Verbindlichkeiten als wesentlichen Prüfungsschwerpunkt, da dieses das Hauptelement des Abschlusses darstellt.

Wir haben von der Verwahrstelle oder unabhängigen Kontrahenten unabhängige Bestätigungen bezüglich der Bestände an übertragbaren

Wertpapieren und Einlagen bei Kreditinstituten zum 31. Dezember 2022 erhalten. Wir haben die Bestände gemäß den Bestätigungen mit den Beständen gemäß den Geschäftsbüchern abgeglichen, und eine Stichprobe der aufgeführten Abgleichspositionen wurde mit den zugrunde liegenden Belegen verglichen.

In Bezug auf den Marktwert der leer verkauften Wertpapiere haben wir unabhängige Bestätigungen von den Kontrahenten eingeholt. Investmentfonds umfassen börsengehandelte Fonds und Organismen für gemeinsame Anlagen. Bei börsengehandelten Fonds haben wir eine unabhängige Bestätigung von der Verwahrstelle eingeholt. Bei Organismen für gemeinsame Anlagen haben wir eine unabhängige Bestätigung von der zugrunde liegenden Transferstelle eingeholt.

Bei Pensionsgeschäften haben wir unabhängige Bestätigungen der Kontrahenten eingeholt.

Bei Finanzderivatinstrumenten haben wir, wo möglich, unabhängige Bestätigungen der Kontrahenten eingeholt. In den Fällen, in denen eine unabhängige Bestätigung der Gegenpartei nicht möglich war, führten wir alternative Prüfverfahren durch.

Bei Devisenterminkontrakten haben wir, soweit möglich, eine Liquidation gemäß den Kontoauszügen vorgenommen. In wesentlichen Fällen und wenn das Fälligkeitsdatum nach dem Datum der Prüfungsabnahme lag, haben wir unabhängig die Bestätigung von Kontrahenten eingeholt.

Bei der Durchführung dieser Verfahren wurden keine wesentlichen Fehldarstellungen festgestellt.

Bestimmung des Prüfungsumfangs

Wir haben den Umfang unserer Prüfung so bemessen, dass gewährleistet ist, dass wir ausreichende Leistungen erbracht haben, um ein Prüfungsurteil über den Jahresabschluss als Ganzes unter Berücksichtigung der Struktur der Gesellschaft, der Rechnungslegungsprozesse und -kontrollen sowie der Branche, in der sie tätig ist, abgeben zu können.

Zum 31. Dezember 2022 waren 56 Teilfonds in Betrieb. Der Finanzstatus, die Betriebsergebnisrechnung und der Ausweis der Veränderungen im Nettovermögen der Gesellschaft sind eine Zusammenfassung der Positionen und Ergebnisse der einzelnen Fonds.

Der Verwaltungsrat kontrolliert die Geschäfte der Gesellschaft und ist für die allgemeine Anlagepolitik verantwortlich, die von ihm festgelegt wird. Die Gesellschaft hat die Verwaltungsgesellschaft mit der Verwaltung bestimmter Pflichten und Verantwortlichkeiten im Zusammenhang mit der täglichen Verwaltung der Gesellschaft beauftragt. Die Verwaltungsgesellschaft hat bestimmte Verantwortlichkeiten an die Anlageberatungsgesellschaften sowie an State Street Fund Services (Ireland) Limited (den „Administrator“) delegiert. Der Abschluss, der weiterhin in der Verantwortung des Verwaltungsrats liegt, wird in seinem Namen vom Administrator erstellt. Die Gesellschaft hat State Street Custodial Services (Ireland) Limited (die „Verwahrstelle“) zur Verwahrstelle für das Vermögen der Gesellschaft bestellt. Bei der Festlegung des globalen Ansatzes für unsere Prüfung haben wir das Risiko wesentlicher Falschangaben auf Teilfondsebene beurteilt. Hierbei haben wir die Art, die Wahrscheinlichkeit und das potenzielle Ausmaß möglicher Falschangaben berücksichtigt. Im Rahmen unserer Risikobeurteilung haben wir die Interaktion der Gesellschaft mit dem Administrator berücksichtigt und das beim Administrator vorliegende Kontrollumfeld beurteilt.

Wesentlichkeit

Der Umfang unserer Prüfung wurde durch Anwendung von Wesentlichkeitskriterien bestimmt. Wir haben bestimmte quantitative Wesentlichkeitsgrenzen angesetzt, die uns gemeinsam mit qualitativen Überlegungen geholfen haben, den Umfang unserer Prüfung und die Art, die zeitliche Gestaltung und das Ausmaß unserer Prüfverfahren für die einzelnen Posten des Abschlusses und die darin enthaltenen Angaben festzulegen und die Auswirkungen von Falschangaben sowohl individuell betrachtet als auch bezüglich des Abschlusses insgesamt zu beurteilen.

Nach unserem pflichtgemäßen Ermessen haben wir Wesentlichkeit für die Abschlüsse der einzelnen Teilfonds der Gesellschaft folgendermaßen bestimmt:

<i>Allgemeine Wesentlichkeit und Art der Bestimmung</i>	50 Basispunkte (2021: 50 Basispunkte) des Nettoinventarwerts („NIW“) zum 31. Dezember 2022 (2021: 31. Dezember 2021) für jeden Teilfonds der Gesellschaft.
<i>Begründung für den angewandten Vergleichswert</i>	Wir haben diesen Vergleichswert herangezogen, da das Hauptziel der Gesellschaft darin besteht, den Anlegern eine Gesamtrendite auf Teilfondsebene unter Berücksichtigung der Kapital- und Ertragsrenditen zu bieten.

Wir nutzen die Toleranzwesentlichkeit, um die Wahrscheinlichkeit, dass die Summe nicht korrigierter und nicht entdeckter falscher Darstellungen die allgemeine Wesentlichkeit übersteigt, auf ein angemessen niedriges Niveau zu reduzieren. Insbesondere nutzen wir die Toleranzwesentlichkeit bei der Bestimmung des Umfangs unserer Prüfung sowie der Art und des Umfangs unserer Prüfung von Kontensalden, Transaktionsklassen und Offenlegungen, zum Beispiel bei der Festlegung des Stichprobenumfangs. Unsere Toleranzwesentlichkeit betrug 75 % der allgemeinen Wesentlichkeit.

Bei der Ermittlung der Toleranzwesentlichkeit haben wir eine Reihe von Faktoren berücksichtigt – frühere Fehldarstellungen, die Risikobewertung und das Aggregationsrisiko sowie die Wirksamkeit der Kontrollen – und kamen zu dem Schluss, dass ein Betrag am oberen Ende unseres Normalbereichs angemessen war.

Wir haben mit dem Verwaltungsrat vereinbart, diesem sämtliche bei unserer Prüfung ermittelten Falschangaben mit Auswirkung auf den NIW je Anteil in Höhe von mehr als 10 % der allgemeinen Wesentlichkeit (2021: 10 % der allgemeinen Wesentlichkeit bei Differenzen mit Auswirkung auf den NIW je Anteil) zu melden, ebenso wie Falschangaben unterhalb dieses Betrags, die unserer Einschätzung nach aus qualitativen Gründen zu melden sind.

Schlussfolgerungen zur Unternehmensfortführung

Unsere Bewertung der Beurteilung des Verwaltungsrats hinsichtlich der Fähigkeit der Gesellschaft und der Fonds zur Fortführung der Rechnungslegung unter der Annahme der Unternehmensfortführung umfasste Folgendes:

- Erlangung eines Verständnisses der wichtigsten Indikatoren, die im Hinblick auf die Annahme der Unternehmensfortführung und die Zukunftspläne der Geschäftsleitung für die Fonds während des Zeitraums der Unternehmensfortführung (12 Monate ab dem Datum der Genehmigung des Jahresabschlusses) überwacht werden;
- Prüfung der verfügbaren Protokolle des Verwaltungsrats während des Prüfungszeitraums und der bis zum Datum dieses Berichts verfügbaren Protokolle;
- Berücksichtigung der in den zugrunde liegenden Geschäftsbüchern ausgewiesenen Kapitalaktivitäten nach Abschluss des Geschäftsjahres;
- Erkundigungen bei der Geschäftsleitung über geplante erhebliche Rücknahmen, über die sie informiert wurden;
- Berücksichtigung der Techniken zur Steuerung des Liquiditätsrisikos, die der Gesellschaft und den Fonds zur Verfügung stehen.

Im Rahmen unserer Prüfung haben wir keine wesentlichen Unsicherheiten in Bezug auf Ereignisse oder Bedingungen festgestellt, die einzeln oder zusammen erhebliche Zweifel an der Fähigkeit der Gesellschaft und der Fonds aufwerfen, für einen Zeitraum von mindestens zwölf Monaten ab dem Datum, an dem der Abschluss zur Veröffentlichung genehmigt wird, weiter zu bestehen.

Bei der Prüfung des Abschlusses sind wir zu dem Schluss gekommen, dass die Anwendung des Grundsatzes der Unternehmensfortführung als Grundlage der Rechnungslegung für die Erstellung des Abschlusses angemessen ist.

Da es jedoch nicht möglich ist, alle künftigen Ereignisse oder Schlussfolgerung vorherzusagen, ist diese Erklärung keine Garantie für die Fähigkeit der Gesellschaft bzw. der Fonds zur Fortsetzung des Geschäftsbetriebs.

Unsere Verantwortlichkeiten und die Verantwortlichkeiten des Verwaltungsrats im Hinblick auf die Unternehmensfortführung werden in den jeweiligen Abschnitten dieses Berichts beschrieben.

Berichterstattung über sonstige Informationen

Die sonstigen Informationen umfassen die im Jahresbericht enthaltenen Informationen, nicht jedoch den Abschluss und unseren diesbezüglichen Prüfungsbericht. Der Verwaltungsrat ist für die sonstigen Informationen verantwortlich. Unser Bestätigungsvermerk zum Abschluss erstreckt sich nicht auf die sonstigen Informationen, und dementsprechend geben wir auch weder einen Bestätigungsvermerk noch, sofern in diesem Bericht nicht ausdrücklich etwas anderes angegeben ist, eine Zusicherung jeglicher Art darüber ab. In Verbindung mit unserer Prüfung des Abschlusses liegt es in unserer Verantwortung, die sonstigen Informationen zu lesen und dabei zu erwägen, ob die sonstigen Informationen wesentliche Widersprüche zum Abschluss oder unseren im Rahmen der Prüfung erlangten Kenntnissen enthalten oder anderweitig wesentlich fehlerhaft zu sein scheinen. Wenn wir offensichtliche wesentliche Widersprüchlichkeiten oder wesentliche Fehldarstellungen feststellen, sind wir verpflichtet, Verfahren durchzuführen, um zu bestimmen, ob eine wesentliche Fehldarstellung des Abschlusses oder eine wesentliche Fehldarstellung der sonstigen Informationen vorliegt. Wenn wir aufgrund der von uns geleisteten Arbeit zu dem Schluss kommen, dass eine wesentliche Fehldarstellung dieser sonstigen Informationen vorliegt, sind wir verpflichtet, diese Tatsache zu melden. Wir haben diesbezüglich nichts zu berichten.

Im Hinblick auf den Bericht des Verwaltungsrats haben wir zudem geprüft, ob die vom Companies Act 2014 geforderten Angaben enthalten sind.

Beruhend auf den oben beschriebenen Verantwortlichkeiten und unserer Arbeit im Rahmen der Abschlussprüfung sind wir gemäß den ISAs (Irland) und dem Companies Act 2014 zudem verpflichtet, bestimmte Meinungen und Sachverhalte, wie nachfolgend beschrieben, offenzulegen:

- Auf Basis der bei der Prüfung gewonnenen Erkenntnisse entsprechen die Angaben im Bericht des Verwaltungsrats für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 unseres Erachtens dem Jahresabschluss und wurden in Übereinstimmung mit den anwendbaren gesetzlichen Vorschriften erstellt.
- Auf Basis unserer Kenntnis und unseres Verständnisses der Gesellschaft und ihres Umfelds, die wir im Rahmen unserer Prüfung erlangt haben, haben wir keine wesentlichen Fehldarstellungen im Bericht des Verwaltungsrats identifiziert.

Verantwortung für den Abschluss und die Prüfung

Verantwortung des Verwaltungsrats für den Abschluss

Wie in den auf Seite [848] dargelegten Aufgaben des Verwaltungsrats ausführlicher erläutert, sind die Verwaltungsratsmitglieder für die Erstellung des Jahresabschlusses in Übereinstimmung mit den anwendbaren Bilanzierungsrichtlinien verantwortlich und müssen sich davon überzeugen, dass dieser ein wahrheitsgemäßes und angemessenes Bild vermittelt.

Der Verwaltungsrat ist außerdem für interne Kontrollmaßnahmen verantwortlich, die er für notwendig erachtet, um die Erstellung von Abschlüssen zu ermöglichen, die frei von wesentlichen Fehldarstellungen sind, sei es aufgrund von Betrug oder Irrtum.

Bei der Erstellung des Abschlusses ist der Verwaltungsrat dafür verantwortlich, die Fähigkeit der Gesellschaft und der Fonds zur Unternehmensfortführung zu beurteilen, wobei er gegebenenfalls Angelegenheiten in Bezug auf die Unternehmensfortführung oder die Anwendung des Fortführungsprinzips offenlegen muss, sofern der Verwaltungsrat nicht die Auflösung der Gesellschaft oder die Einstellung des Betriebs beabsichtigt oder keine realistische Alternative dazu hat.

Verantwortung der Abschlussprüfer für die Prüfung des Abschlusses

Unsere Zielsetzung ist es, eine hinreichende Sicherheit darüber zu erlangen, ob der Abschluss insgesamt frei von wesentlichen Fehldarstellungen ist, sei es aufgrund von Betrug oder Irrtum, und einen Prüfbericht zu erstellen, der unseren Bestätigungsvermerk enthält. Eine hinreichende Sicherheit ist ein hohes Maß an Sicherheit, jedoch keine Garantie dafür, dass eine gemäß den ISAs (Irland) durchgeführte Prüfung stets eine eventuell vorliegende wesentliche Fehldarstellung aufdeckt. Fehldarstellungen können aufgrund von Betrug oder Irrtum entstehen und werden als wesentlich angesehen, wenn angemessenerweise davon ausgegangen werden könnte, dass sie einzeln oder insgesamt die auf der Grundlage dieses Abschlusses getroffenen wirtschaftlichen Entscheidungen von Benutzern beeinflussen könnten.

Unregelmäßigkeiten, einschließlich Betrug, sind Fälle von Nichteinhaltung von Gesetzen und Vorschriften. Wir entwickeln die Verfahren im Einklang mit unseren oben beschriebenen Verantwortlichkeiten, um wesentliche Fehldarstellungen in Bezug auf Unregelmäßigkeiten, einschließlich Betrug, aufzudecken. Der Umfang, in dem unsere Verfahren Unregelmäßigkeiten, einschließlich Betrug, aufdecken können, ist nachstehend näher beschrieben.

Basierend auf unserem Verständnis der Gesellschaft und der Branche haben wir festgestellt, dass die Hauptrisiken der Nichteinhaltung von Gesetzen und Vorschriften in Bezug auf Unregelmäßigkeiten, einschließlich Betrug, in Fällen von Nichteinhaltung von Gesetzen und Vorschriften bestanden. Wir entwickeln die Verfahren im Einklang mit unseren oben beschriebenen Verantwortlichkeiten, um wesentliche Fehldarstellungen in Bezug auf Unregelmäßigkeiten, einschließlich Betrug, aufzudecken. Der Umfang, in dem unsere Verfahren Unregelmäßigkeiten, einschließlich Betrug, aufdecken können, ist nachstehend näher beschrieben, und wir haben geprüft, inwieweit die Nichteinhaltung einen wesentlichen Einfluss auf den Abschluss haben könnte. Wir haben auch die Gesetze und Vorschriften berücksichtigt, die einen direkten Einfluss auf die Erstellung des Abschlusses haben, z. B. der Companies Act von 2014 und die European Communities (Undertakings for Collective Investment in Transferable Securities) Regulations von 2011 (in der jeweils gültigen Fassung). Wir haben die Anreize und Möglichkeiten der Geschäftsleitung für eine betrügerische Manipulation des Jahresabschlusses (einschließlich des Risikos der Außerkraftsetzung von Kontrollen) bewertet und festgestellt, dass die Hauptrisiken in Bezug auf das Risiko der Außerkraftsetzung von Kontrollen durch die Geschäftsleitung bestanden.

Die vom Prüfungsteam durchgeführten Prüfungsverfahren umfassten:

- Untersuchung durch die Geschäftsleitung, um alle Fälle von Nichteinhaltung von Gesetzen und Vorschriften zu identifizieren;
- Identifizieren und Prüfen von Journaleinträgen, die unseren speziellen Risikokriterien entsprechen;
- Prüfen von Bilanzierungsschätzungen und -beurteilungen sowie von potentieller Voreingenommenheit der Geschäftsleitung;
- Entwickeln von Prüfverfahren, die die Unvorhersehbarkeit in Bezug auf die Art, die zeitliche Gestaltung und das Ausmaß unserer Prüfverfahren berücksichtigen; und
- Prüfen der Protokolle von Verwaltungsratssitzungen.

Die oben beschriebenen Prüfungshandlungen unterliegen inhärenten Einschränkungen. Es ist weniger wahrscheinlich, dass wir auf Verstöße gegen Gesetze und Vorschriften aufmerksam werden, die nicht in engem Zusammenhang mit Ereignissen und Transaktionen stehen, die in den Jahresabschlüssen wiedergegeben werden. Außerdem ist das Risiko, dass eine wesentliche Fehldarstellung aufgrund von Betrug nicht aufgedeckt wird, höher als das Risiko, dass eine Fehldarstellung aufgrund von Irrtum nicht aufgedeckt wird, da Betrug eine vorsätzliche Verschleierung, z. B. durch Fälschung oder absichtliche Fehldarstellung oder durch geheime Absprachen, beinhalten kann.

Zu den Prüfungen im Rahmen unserer Abschlussprüfung kann die Prüfung vollständiger Bestände bestimmter Transaktionen und Salden zählen, möglicherweise unter Verwendung von Datenprüfungstechniken. Üblicherweise wird jedoch eine beschränkte Anzahl von Elementen für die Prüfung ausgewählt, statt vollständige Bestände zu prüfen. Oftmals sind wir bestrebt, uns bei der Prüfung auf bestimmte Elemente zu konzentrieren, basierend auf deren Umfang oder Risikomerkmale. In anderen Fällen führen wir eine stichprobenbasierte Prüfung durch, um Schlussfolgerungen hinsichtlich des Bestandes zu ziehen, aus dem die Stichprobe ausgewählt wurde.

Eine weitere Beschreibung unserer Verantwortlichkeiten für die Prüfung des Abschlusses finden sich auf der IAASA-Website unter

https://www.iaasa.ie/getmedia/b2389013-1cf6-458b-9b8f-a98202dc9c3a/Description_of_auditors_responsibilities_for_audit.pdf.

Diese Beschreibung ist Bestandteil unseres Berichts des Abschlussprüfers.

Verwendung dieses Berichts

Dieser Bericht einschließlich des Testats wurde ausschließlich für die Anteilhaber der Gesellschaft als Organ gemäß § 391 des Companies Act von 2014 und zu keinem anderen Zweck erstellt. Mit unserer Stellungnahme akzeptieren oder übernehmen wir keine Verantwortung für andere Zwecke oder gegenüber anderen Personen, die von diesem Bericht Kenntnis erhalten oder in deren Hände er gerät, es sei denn, dies wurde von uns vorab ausdrücklich schriftlich zugesichert.

Sonstige Berichtspflichten

Stellungnahmen zu anderen Angelegenheiten gemäß dem Companies Act 2014

- Wir haben alle Informationen und Erklärungen erhalten, die wir für unsere Prüfung für notwendig halten.
- Unserer Auffassung nach waren die Geschäftsbücher der Gesellschaft ausreichend, um eine problemlose und ordnungsgemäße Prüfung des Abschlusses zu ermöglichen.
- Der Abschluss stimmt mit den Geschäftsbüchern überein.

Ausnahmemeldungen gemäß dem Companies Act 2014

Vergütung und Transaktionen der Verwaltungsratsmitglieder

Gemäß dem Companies Act von 2014 müssen wir Ihnen mitteilen, wenn unserer Auffassung nach die von den Paragraphen 305 bis 312 dieses Gesetzes geforderten Angaben zur Vergütung und den Transaktionen der Verwaltungsratsmitglieder nicht gemacht wurden. Wir haben diesbezüglich keine Ausnahmen zu melden.

Mary Ruane
für und im Namen von PricewaterhouseCoopers
Chartered Accountants und Statutory Audit Firm
Dublin
26. April 2023

Wir haben das Geschäftsgebaren der PIMCO Funds: Global Investors Series plc (die „Gesellschaft“) für das zum 31. Dezember 2022 endende Geschäftsjahr in unserer Eigenschaft als Verwahrstelle der Gesellschaft untersucht.

Dieser Bericht, einschließlich des Bestätigungsvermerks, wurde ausschließlich für die Anteilhaber der Gesellschaft als Körperschaft im Einklang mit Verordnung 34, (1), (3) und (4) in Teil 5 der European Communities (Undertakings for Collective Investment in Transferable Securities) Regulations von 2011 in ihrer jeweils geltenden Fassung („UCITS Regulations“) und zu keinem anderen Zweck erstellt. Mit diesem Testat übernehmen und akzeptieren wir keinerlei Verantwortung zu anderen Zwecken oder gegenüber anderen Personen, die Kenntnis von diesem Bericht erhalten.

VERANTWORTUNG DER VERWAHRSTELLE

Unsere Pflichten und unsere Verantwortung sind in Verordnung 34, (1), (3) und (4) in Teil 5 der UCITS Regulations dargelegt. Eine dieser Pflichten ist die Untersuchung des Geschäftsgebarens der Gesellschaft für jeden Rechnungslegungszeitraum von einem Jahr und die Berichterstattung hierüber an die Anteilhaber.

Aus unserem Bericht geht hervor, ob die Gesellschaft unserer Meinung nach während dieses Zeitraums in Übereinstimmung mit den Bestimmungen der Satzung der Gesellschaft (die „Satzung“) und den UCITS Regulations verwaltet wurde. Die Gesellschaft ist dafür verantwortlich, diese Bestimmungen einzuhalten. Sollte die Gesellschaft nicht für eine derartige Übereinstimmung gesorgt haben, ist es unsere Pflicht als Verwahrstelle, hierüber zu berichten und die von uns getroffenen Abhilfemaßnahmen aufzuführen.

GRUNDLAGE DES TESTATS DER VERWAHRSTELLE

Die Verwahrstelle führt alle Prüfungen durch, die ihrer Meinung nach angemessen sind, um ihre in Verordnung 34, (1), (3) und (4) in Teil 5 der UCITS Regulations erwähnten Pflichten zu erfüllen und zu gewährleisten, dass die Gesellschaft unter allen wesentlichen Gesichtspunkten folgendermaßen verwaltet wurde: (i) unter Einhaltung der von ihrer Satzung und den UCITS Regulations auferlegten Anlagegrenzen und Kreditaufnahmebefugnisse und (ii) ansonsten in Übereinstimmung mit der Satzung und den entsprechenden Vorschriften.

TESTAT

Unserer Meinung nach wurde die Gesellschaft während des Berichtszeitraums unter allen wesentlichen Gesichtspunkten folgendermaßen verwaltet:

- (i) unter Einhaltung der von ihrer Satzung, den UCITS Regulations und den Central Bank (Supervision and Enforcement) Act 2013 (Section 48(1)) (Undertakings for Collective Investment in Transferable Securities) Regulations 2019 (die „Central Bank UCITS Regulations“) auferlegten Anlagegrenzen und Kreditaufnahmebefugnisse; und
- (ii) ansonsten in Übereinstimmung mit den Bestimmungen der Satzung, den UCITS Regulations und den Central Bank UCITS Regulations.

State Street Custodial Services (Ireland) Limited,
78 Sir John Rogerson's Quay,
Dublin D02 HD32
Irland

Datum: 25. April 2023

PIMCO Global Advisors (Ireland) Limited (die „Verwaltungsgesellschaft“) ist im Rahmen ihren Pflichten gemäß Richtlinie 2009/65/EG in ihrer jeweils geltenden Fassung (die „OGAW-Richtlinie“) verpflichtet, für diejenigen Mitarbeiterkategorien, einschließlich Geschäftsleitung, Risikoträger und Mitarbeiter mit Kontrollfunktionen und aller Mitarbeiter, die eine Gesamtvergütung erhalten, aufgrund derer sie sich in derselben Einkommensstufe befinden wie Mitglieder der Geschäftsleitung und Risikoträger, deren Tätigkeit sich wesentlich auf die Risikoprofile der Verwaltungsgesellschaft oder von dieser verwalteter Organismen für gemeinsame Anlagen („OGAW“) auswirkt, Vergütungsrichtlinien und -praktiken vorzuhalten, die mit einem soliden und wirksamen Risikomanagement vereinbar und diesem förderlich sind und keine Anreize zur Eingehung von Risiken setzen, die nicht mit dem Risikoprofil, den Vorschriften oder der Gründungsurkunde der Verwaltungsgesellschaft oder von PIMCO Funds: Global Investors Series plc (die „Gesellschaft“) vereinbar sind.

Die Vergütungsrichtlinie enthält auch Informationen über die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken in die Vergütungsverfahren der Verwaltungsgesellschaft, wie in der EU-Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten (2019/2088) gefordert.

Die Vergütung besteht aus allen Arten von Zahlungen oder Leistungen, die unmittelbar durch die oder mittelbar, jedoch im Auftrag der Verwaltungsgesellschaft als Gegenleistung für von Mitarbeitern erbrachte berufliche Dienstleistungen gewährt werden. Hierzu zählen, je nach Sachlage: (i) alle Arten von Zahlungen oder Leistungen, die durch die Verwaltungsgesellschaft gezahlt werden; (ii) jeder Betrag, der durch die Gesellschaft gezahlt wird, einschließlich jedes Anteils an Erfolgsgebühren; und/oder (iii) jede Übertragung von Anteilen oder Aktien einer Gesellschaft als Gegenleistung für durch die identifizierten Mitarbeiter erbrachte berufliche Dienstleistungen. Bei einer festen Vergütung erfolgen Zahlungen oder Leistungen ohne Berücksichtigung von Leistungskriterien. Bei einer variablen Vergütung erfolgen zusätzliche Zahlungen oder Leistungen in Abhängigkeit von der Leistung oder ggf. anderen vertraglich vereinbarten Kriterien.

Angaben erfolgen in Bezug auf (a) die Mitarbeiter der Verwaltungsgesellschaft; (b) Mitarbeiter, die der Geschäftsleitung angehören; und (c) Mitarbeiter mit der Fähigkeit, wesentlichen Einfluss auf das Risikoprofil des Fonds zu nehmen, einschließlich natürlicher Personen, die zwar nicht unmittelbar durch die Verwaltungsgesellschaft beschäftigt sind, jedoch von ihrem Arbeitgeber für die Erbringung von Dienstleistungen unmittelbar für die Verwaltungsgesellschaft abgestellt sind („Beauftragte“).

Der Betrag der Gesamtvergütung, die die Verwaltungsgesellschaft ihren Mitarbeitern gewährt und die dem OGAW-bezogenen Geschäft der Verwaltungsgesellschaft im Hinblick auf das Geschäftsjahr der Verwaltungsgesellschaft zum 31. Dezember 2022 zugerechnet wurde, beläuft sich auf 180.000 EUR. Dieser Wert umfasst die feste Vergütung in Höhe von 180.000 EUR und die variable Vergütung in Höhe von 0 EUR. Insgesamt gab es drei Begünstigte bezüglich der vorstehend beschriebenen Vergütung.

Der Betrag der durch die Verwaltungsgesellschaft gewährten Gesamtvergütung, die dem OGAW-bezogenen Geschäft der Verwaltungsgesellschaft im Hinblick auf das Geschäftsjahr der Verwaltungsgesellschaft zum 31. Dezember 2022 zugerechnet wurde, belief sich für ihre Geschäftsleitung auf 0 USD und für andere Mitglieder ihrer Belegschaft, deren Handlungen eine wesentliche Auswirkung auf das Risikoprofil des OGAW-bezogenen Geschäft der Verwaltungsgesellschaft haben, auf 0 USD.

Der Betrag der ihren identifizierten Mitarbeitern durch Beauftragte gewährten Gesamtvergütung, der den Teilfonds im Hinblick auf das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 zugerechnet wird, beläuft sich auf 9.907.534 USD. Diese Zahl umfasst eine feste Vergütung in Höhe von 82.946 USD und eine variable Vergütung in Höhe von 9.824.588 USD. Insgesamt gab es 61 Begünstigte bezüglich der vorstehend beschriebenen Vergütung.

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2022			VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2022		
PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	78.176.958	\$ 777.876	PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	88.240.050	\$ 878.027
	PARI (000S)			PARI (000S)	
1MDB Global Investments Ltd. 4,400 % fällig am 09.03.2023	\$ 60.100	59.799	Malaysia Government International Bond 3,900 % fällig am 30.11.2026	MYR 135.700	32.874
NWD Finance BVI Ltd. 6,150 % fällig am 16.03.2025	58.900	58.796	ReNew Power Pvt Ltd. 6,450 % fällig am 27.09.2022	\$ 30.754	30.626
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.01.2032 (b)	47.626	45.922	Singapore Airlines Ltd. 3,375 % fällig am 19.01.2029	33.300	29.719
Periama Holdings LLC 5,950 % fällig am 19.04.2026	43.611	41.051	Vedanta Resources Finance PLC 13,875 % fällig am 21.01.2024	29.195	28.584
Greenko Wind Projects Mauritius Ltd. 5,500 % fällig am 06.04.2025	39.900	39.436	China Development Bank 4,040 % fällig am 06.07.2028	CNY 167.700	28.001
Malaysia Government International Bond 3,900 % fällig am 30.11.2026	MYR 135.700	33.181	CNAC HK Finbridge Co. Ltd. 4,625 % fällig am 14.03.2023	\$ 23.360	23.858
Singapore Airlines Ltd. 3,375 % fällig am 19.01.2029	\$ 33.300	32.563	JSW Steel Ltd. 5,050 % fällig am 05.04.2032	27.400	23.427
Muthoot Finance Ltd. 4,400 % fällig am 02.09.2023	31.162	30.736	ReNew Power Pvt Ltd. 5,875 % fällig am 05.03.2027	22.600	21.292
Sands China Ltd. 5,625 % fällig am 08.08.2025	33.300	30.510	Industrial & Commercial Bank of China Ltd. 3,200 % fällig am 24.09.2026	21.200	20.470
Indika Energy Capital Pte. Ltd. 8,250 % fällig am 22.10.2025	26.300	26.617	ABJA Investment Co. Pte. Ltd. 5,450 % fällig am 24.01.2028	19.700	20.453
Mong Duong Finance Holdings BV 5,125 % fällig am 07.05.2029	30.159	26.187	Celestial Miles Ltd. 5,750 % fällig am 31.01.2024	19.500	19.663
Standard Chartered PLC 7,750 % fällig am 15.08.2027	26.300	25.297	Shriram Transport Finance Co. Ltd. 5,950 % fällig am 24.10.2022	18.600	18.546
ReNew Power Pvt Ltd. 5,875 % fällig am 05.03.2027	26.820	25.131	Cathay Pacific Finance Ltd. 2,750 % fällig am 05.02.2026	HKD 138.000	18.544
India Toll Roads 5,500 % fällig am 19.08.2024	23.043	22.538	JSW Steel Ltd. 5,375 % fällig am 04.04.2025	\$ 17.681	17.805
West China Cement Ltd. 4,950 % fällig am 08.07.2026	28.475	22.064	NWD Finance BVI Ltd. 5,250 % fällig am 22.03.2026	18.000	17.649
Bank of East Asia Ltd. 4,875 % fällig am 22.04.2032	22.100	21.852	ICBCIL Finance Co. Ltd. 1,880 % fällig am 25.01.2027	17.700	17.336
Industrial & Commercial Bank of China Ltd. 3,200 % fällig am 24.09.2026	21.200	21.405	Central China Real Estate Ltd. 6,875 % fällig am 08.08.2022	23.000	16.936
Freeport Indonesia PT 5,315 % fällig am 14.04.2032	21.800	21.363	1MDB Global Investments Ltd. 4,400 % fällig am 09.03.2023	17.500	16.877
Melco Resorts Finance Ltd. 5,750 % fällig am 21.07.2028	25.577	20.902	Muthoot Finance Ltd. 6,125 % fällig am 31.10.2022	16.086	16.017

(a) Der PIMCO Asia High Yield Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000\$)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000\$)
KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2022			VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2022		
PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	11.910.872	\$ 118.533	PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	12.245.104	\$ 121.876
	PARI (000\$)			PARI (000\$)	
Indonesia Government International Bond 4,650 % fällig am 20.09.2032	\$ 6.900	6.758	AIA Group Ltd. 2,700 % fällig am 07.04.2023	\$ 4.800	4.511
U.S. Treasury Notes 3,250 % fällig am 31.08.2024	6.100	6.080	China Construction Bank Corp. 2,850 % fällig am 21.01.2032	4.400	4.138
Korea Electric Power Corp. 5,375 % fällig am 06.04.2026	6.000	6.056	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia 4,700 % fällig am 06.06.2032	4.000	3.972
Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd. 4,602 % fällig am 15.06.2032	5.800	5.794	Sunny Express Enterprises Corp. 2,950 % fällig am 01.03.2027	3.900	3.869
Korea National Oil Corp. 2,125 % fällig am 18.04.2027	5.300	5.101	Malaysia Government International Bond 3,900 % fällig am 30.11.2026	MYR 14.300	3.464
China Construction Bank Corp. 2,850 % fällig am 21.01.2032	4.400	4.390	Geely Automobile Holdings Ltd. 3,625 % fällig am 25.01.2023	\$ 3.240	3.218
Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia 4,700 % fällig am 06.06.2032	4.000	4.057	Pertamina Persero PT 2,300 % fällig am 09.02.2031	3.800	3.193
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.01.2032 (b)	4.083	3.899	KB Kookmin Card Co. Ltd. 4,000 % fällig am 09.06.2025	3.200	3.155
Misc Capital Two Labuan Ltd. 3,625 % fällig am 06.04.2025	3.900	3.897	Development Bank of the Philippines 2,375 % fällig am 11.03.2031	3.410	2.903
Sunny Express Enterprises Corp. 2,950 % fällig am 01.03.2027	3.900	3.891	Shriram Transport Finance Co. Ltd. 5,950 % fällig am 24.10.2022	2.900	2.898
Reliance Industries Ltd. 2,875 % fällig am 12.01.2032	3.700	3.691	Tencent Holdings Ltd. 4,602 % fällig am 19.01.2028	3.100	2.775
Airport Authority Hong Kong 2,500 % fällig am 12.01.2032	3.600	3.597	Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd. 4,602 % fällig am 15.06.2032	2.900	2.752
Shinhan Card Co. Ltd. 2,500 % fällig am 27.01.2027	3.600	3.530	Reliance Industries Ltd. 2,875 % fällig am 12.01.2032	3.000	2.615
Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara 3,375 % fällig am 05.02.2030	3.600	3.528	Mizuho Financial Group, Inc. 2,564 % fällig am 13.09.2031	2.900	2.428
Malaysia Government International Bond 3,900 % fällig am 30.11.2026	MYR 14.300	3.497	NWD Finance BVI Ltd. 6,150 % fällig am 16.03.2025	2.400	2.364
Pertamina Persero PT 2,300 % fällig am 09.02.2031	\$ 3.800	3.482	Indonesia Government International Bond 1,300 % fällig am 23.03.2034	€ 2.800	2.293
Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT 4,625 % fällig am 20.07.2023	3.200	3.235	Dianjian Haiyu Ltd. 4,300 % fällig am 20.06.2024	\$ 2.200	2.244
Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia 4,400 % fällig am 06.06.2027	3.200	3.200	Prudential PLC 2,950 % fällig am 03.11.2033	2.300	2.107
KB Kookmin Card Co. Ltd. 4,000 % fällig am 09.06.2025	3.200	3.198	Bangkok Bank PCL 3,466 % fällig am 23.09.2036	2.300	2.010

(a) Der Asia Strategic Interest Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2022			VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2022		
Credit Suisse Group AG 9,750 % fällig am 23.06.2027	\$	77.000	PIMCO ETFs plc – PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (a)	4.576.800	\$ 459.765
Stichting AK Rabobank Certificaten 6,500 %	€	50.300	Bank of America Corp.	3.585.748	156.263
BNP Paribas S.A. 4,625 % fällig am 12.01.2027	\$	78.900	JPMorgan Chase & Co.	720.500	97.236
Societe Generale S.A. 6,221 % fällig am 15.06.2033		70.100	Wells Fargo & Co.	1.929.696	95.435
				PARI (000S)	
Wells Fargo & Co.		1.197.200	UBS AG 1,750 % fällig am 21.04.2022	\$	85.273
Bank of America Corp.		1.429.200	Deutsche Bank AG 5,625 % fällig am 19.05.2031	€	76.100
JPMorgan Chase & Co.		438.400	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. 6,000 % fällig am 29.03.2024		72.400
				AKTIEN	
BNP Paribas S.A. 7,750 % fällig am 16.08.2029	\$	56.800	PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	7.092.484	70.601
BNP Paribas S.A. 6,875 % fällig am 06.12.2029	€	55.800		PARI (000S)	
			UniCredit SpA 6,625 % fällig am 03.06.2023	€	65.600
PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		5.288.582	Telefonica Europe BV 4,375 % fällig am 14.12.2024		58.700
				AKTIEN	
Cooperatieve Rabobank UA 4,875 % fällig am 29.06.2029	€	51.000	Goldman Sachs Group, Inc.	146.782	53.847
Bank of America Corp. 1,843 % fällig am 04.02.2025	\$	44.500		PARI (000S)	
Barclays PLC 8,875 % fällig am 15.09.2027	£	36.200	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. 5,875 % fällig am 24.09.2023	€	44.000
BNP Paribas S.A. 9,250 % fällig am 17.11.2027	\$	43.500	Vodafone Group PLC 7,000 % fällig am 04.04.2079	\$	51.600
UBS Group AG 4,875 % fällig am 12.02.2027		42.000		AKTIEN	
Barclays PLC 8,000 % fällig am 15.03.2029		40.000	Lloyds Banking Group PLC	70.635.700	50.317
Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen 5,875 % fällig am 23.05.2042		39.400		PARI (000S)	
Intesa Sanpaolo SpA 8,248 % fällig am 21.11.2033		36.700	Stichting AK Rabobank Certificaten 6,500 %	€	46.252
Deutsche Bank AG 3,742 % fällig am 07.01.2033		49.100	UBS AG 7,625 % fällig am 17.08.2022	\$	41.200
Erste Group Bank AG 4,250 % fällig am 15.10.2027	€	34.200	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. 6,000 % fällig am 15.01.2026	€	42.600
Intesa Sanpaolo SpA 6,375 % fällig am 30.03.2028		29.000	Lloyds Banking Group PLC 7,625 % fällig am 27.06.2023	£	28.400
AIB Group PLC 6,250 % fällig am 23.06.2025		27.400	Permanent TSB Group Holdings PLC 2,125 % fällig am 26.09.2024	€	34.000
NN Group NV 5,250 % fällig am 01.03.2043		29.100	UniCredit SpA 9,250 % fällig am 03.06.2022		30.000
Deutsche Bank AG 6,750 % fällig am 30.10.2028		26.200	(a) Der PIMCO Capital Securities Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.		
Deutsche Bank AG 10,000 % fällig am 01.12.2027		28.400	Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.		
ING Groep NV 4,125 % fällig am 24.08.2033		27.500	Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.		
Deutsche Bank AG 4,000 % fällig am 24.06.2032		25.000			
Bank of Ireland Group PLC 7,500 % fällig am 19.05.2025		25.400			
Lloyds Banking Group PLC 4,947 % fällig am 27.06.2025		24.800			
Permanent TSB Group Holdings PLC 13,250 % fällig am 26.10.2027		24.600			
Lloyds Banking Group PLC 8,500 % fällig am 27.09.2027	£	19.500			
Nordea Bank Abp 3,750 % fällig am 01.03.2029	\$	26.200			
Electricite de France S.A. 2,875 % fällig am 15.12.2026	€	21.600			
Societe Generale S.A. 3,337 % fällig am 21.01.2033	\$	30.100			
Deutsche Bank AG 3,729 % fällig am 14.01.2032		30.350			

BESCHREIBUNG		PARI (000S)		KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG		PARI (000S)		ERLÖSE (000S)
KAUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2022					VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2022				
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 1,375 % fällig am 07.06.2032	€	15.600	\$	15.026	Volkswagen International Finance NV 4,250 % fällig am 15.02.2028	€	2.400	\$	2.403
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 2,000 % fällig am 15.11.2029		10.400		10.330	Realty Income Corp. 1,125 % fällig am 13.07.2027	£	1.800		2.266
Europäische Investitionsbank 1,500 % fällig am 15.06.2032		5.600		5.927	CTP NV 0,625 % fällig am 27.09.2026	€	2.100		2.228
Canada Government International Bond 2,250 % fällig am 01.12.2029	CAD	6.400		4.621	Kojamo Oyj 0,875 % fällig am 28.05.2029		2.900		2.177
U.S. Treasury Notes 1,125 % fällig am 15.01.2025	\$	3.600		3.583	NextEra Energy Capital Holdings, Inc. 2,200 % fällig am 02.12.2026	AUD	3.350		1.936
Vonovia SE 2,375 % fällig am 25.03.2032	€	2.700		2.954	Union Pacific Corp. 4,950 % fällig am 09.09.2052	\$	1.820		1.885
NTT Finance Corp. 4,239 % fällig am 25.07.2025	\$	2.900		2.900	Vmed O2 UK Financing PLC 4,750 % fällig am 15.07.2031		2.400		1.848
United Kingdom Gilt 0,875 % fällig am 31.07.2033	£	3.000		2.417	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0,750 % fällig am 30.09.2030		2.100		1.743
Volkswagen International Finance NV 4,250 % fällig am 15.02.2028	€	2.400		2.395	T-Mobile USA, Inc. 2,625 % fällig am 15.04.2026		1.900		1.734
UniCredit SpA 5,850 % fällig am 15.11.2027		2.200		2.213	Telus Corp. 3,400 % fällig am 13.05.2032		1.900		1.729
Compass Group PLC 4,375 % fällig am 08.09.2032	£	1.900		2.192	Woolworths Group Ltd. 0,375 % fällig am 15.11.2028	€	2.100		1.683
Deutsche Bank AG 1,875 % fällig am 23.02.2028	€	1.900		2.149	UBS AG 5,125 % fällig am 15.05.2024	\$	1.700		1.675
GoodLeap Sustainable Home Solutions Trust 4,950 % fällig am 20.07.2049	\$	2.000		1.999	NatWest Group PLC 4,067 % fällig am 06.09.2028	€	1.600		1.673
CaixaBank S.A. 3,750 % fällig am 07.09.2029	€	1.900		1.898	Holding d'Infrastructures des Metiers de l'Environnement 0,125 % fällig am 16.09.2025		1.400		1.530
Telus Corp. 3,400 % fällig am 13.05.2032	\$	1.900		1.895	Sunnova Energy Corp. 5,875 % fällig am 01.09.2026	\$	1.600		1.487
ABN AMRO Bank NV 2,470 % fällig am 13.12.2029		2.000		1.812	AES Corp. 2,450 % fällig am 15.01.2031		1.859		1.484
Union Pacific Corp. 4,950 % fällig am 09.09.2052		1.820		1.808	BNP Paribas S.A. 0,500 % fällig am 04.06.2026	€	1.500		1.462
NatWest Group PLC 4,067 % fällig am 06.09.2028	€	1.600		1.598	Kilroy Realty LP 2,500 % fällig am 15.11.2032	\$	2.000		1.458
NE Property BV 2,000 % fällig am 20.01.2030		1.400		1.584	Boston Properties LP 3,400 % fällig am 21.06.2029		1.400		1.451
Bundesrepublik Deutschland 0,000 % fällig am 15.08.2031		1.400		1.464	HAT Holdings LLC 3,375 % fällig am 15.06.2026		1.500		1.365
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc. 2,472 % fällig am 14.01.2029	\$	1.300		1.300	Banco de Sabadell S.A. 0,875 % fällig am 16.06.2028	€	1.500		1.296
Mizuho Financial Group, Inc. 3,490 % fällig am 05.09.2027	€	1.300		1.299	Intesa Sanpaolo SpA 0,750 % fällig am 16.03.2028		1.400		1.261
Amgen, Inc. 3,000 % fällig am 22.02.2029	\$	1.300		1.296	Hilton Domestic Operating Co., Inc. 4,875 % fällig am 15.01.2030	\$	1.200		1.180
					Enel Finance International NV 2,650 % fällig am 10.09.2024		1.200		1.170
					Europäische Bank für Wiederaufbau und Entwicklung 1,500 % fällig am 13.02.2025		1.240		1.170
					Santander Holdings USA, Inc. 5,807 % fällig am 09.09.2026		1.160		1.157
					Iberdrola Finanzas S.A. 1,000 % fällig am 07.03.2024	€	1.100		1.146
					Contemporary Ruiding Development Ltd. 1,500 % fällig am 09.09.2026	\$	1.300		1.129
					KBC Group NV 0,250 % fällig am 01.03.2027	€	1.300		1.092
					Rayonier LP 2,750 % fällig am 17.05.2031	\$	1.300		1.090
					Wesfarmers Ltd. 0,954 % fällig am 21.10.2033	€	1.200		1.079
					Tesco Corporate Treasury Services PLC 0,375 % fällig am 27.07.2029		1.300		1.067
					Johnson Controls International PLC 2,000 % fällig am 16.09.2031	\$	1.400		1.052
					Dell International LLC 6,200 % fällig am 15.07.2030		1.000		1.041

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarriere genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	ERLÖSE (000S)
KAUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2022			VERKAUFE BIS 31. DEZEMBER 2022		
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.10.2026 (a)	\$	122.432	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.10.2026 (a)	\$	72.896
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.01.2024 (a)		61.007	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2022 (a)		61.472
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,500 % fällig am 15.01.2028 (a)		46.911	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.01.2023 (a)		59.450
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2027 (a)		47.872	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2031 (a)		55.318
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.01.2032 (a)		42.711	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,400 % fällig am 15.05.2030	€	45.115
United Kingdom Gilt 1,250 % fällig am 22.11.2027	£	29.721	France Government International Bond 0,250 % fällig am 25.07.2024		45.613
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,250 % fällig am 15.01.2025 (a)	\$	31.808	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2027 (a)	\$	49.131
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.10.2025 (a)		29.633	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.01.2032 (a)		44.334
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.10.2024 (a)		27.416	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.04.2023 (a)		41.746
Spain Government International Bond 0,650 % fällig am 30.11.2027	€	24.564	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,375 % fällig am 15.07.2027 (a)		22.868
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,625 % fällig am 15.10.2027 (a)	\$	26.747	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,100 % fällig am 15.05.2033	€	23.940
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,100 % fällig am 15.05.2033	€	22.885	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.10.2024 (a)	\$	17.343
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.04.2023 (a)	\$	25.206	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,750 % fällig am 15.07.2028 (a)		16.355
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,400 % fällig am 26.05.2025	€	21.190	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.10.2025 (a)		14.730
France Government International Bond 0,100 % fällig am 25.07.2031		18.355	France Government International Bond 1,500 % fällig am 25.05.2031	€	11.800
France Government International Bond 0,100 % fällig am 01.03.2025		18.245	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2025 (a)	\$	11.484
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,375 % fällig am 15.07.2027 (a)	\$	19.033	France Government International Bond 0,100 % fällig am 25.07.2031	€	10.039
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,375 % fällig am 15.07.2025 (a)		18.135	OCP Euro CLO DAC 2,198 % fällig am 15.01.2032		10.100
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.01.2023 (a)		18.081	France Government International Bond 0,100 % fällig am 01.03.2029		8.694
Nykredit Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK	119.700	Carlyle Euro CLO DAC 2,428 % fällig am 15.08.2030		7.382
Spain Government International Bond 0,150 % fällig am 30.11.2023	€	12.305			
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,350 % fällig am 15.09.2024		11.607	(a) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.		
Bundesrepublik Deutschland 0,100 % fällig am 15.04.2023		12.523	Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.		
France Government International Bond 1,500 % fällig am 25.05.2031		11.800	Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.		
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2026 (a)	\$	11.042			
OCP Euro CLO DAC 2,198 % fällig am 15.01.2032	€	10.100			

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2022			VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2022		
U.S. Treasury Notes 3,125 % fällig am 31.08.2027	\$ 3.825	\$ 3.688	PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	573.132	\$ 5.703
U.S. Treasury Notes 2,750 % fällig am 15.08.2032	3.800	3.429		PARI (000S)	
Wells Fargo & Co. 4,897 % fällig am 25.07.2033	2.300	2.300	U.S. Treasury Notes 2,750 % fällig am 15.08.2032	\$ 3.000	2.748
U.S. Treasury Notes 2,875 % fällig am 15.05.2032	2.100	2.098	U.S. Treasury Notes 2,875 % fällig am 15.05.2032	2.100	2.084
U.S. Treasury Notes 2,750 % fällig am 30.04.2027	2.100	2.087	U.S. Treasury Notes 2,750 % fällig am 30.04.2027	2.100	2.068
South Africa Government International Bond 10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR 26.800	1.962	U.S. Treasury Notes 2,500 % fällig am 30.04.2024	1.900	1.877
U.S. Treasury Notes 2,500 % fällig am 30.04.2024	\$ 1.900	1.895	Caesars Entertainment, Inc. 6,250 % fällig am 01.07.2025	1.500	1.550
	AKTIEN		U.S. Treasury Bonds 1,875 % fällig am 15.11.2051	1.759	1.536
PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	178.332	1.775	Carnival Corp. 4,000 % fällig am 01.08.2028	1.600	1.488
	PARI (000S)		Cornerstone Building Brands, Inc. 7,568 % fällig am 12.04.2028	1.440	1.333
Morgan Stanley 4,889 % fällig am 20.07.2033	\$ 1.700	1.745	U.S. Treasury Bonds 1,875 % fällig am 15.02.2041	1.347	1.293
JPMorgan Chase & Co. 4,912 % fällig am 25.07.2033	1.700	1.707	U.S. Treasury Bonds 2,000 % fällig am 15.11.2041	1.400	1.201
U.S. Treasury Bonds 1,875 % fällig am 15.11.2051	1.759	1.649	Spirit AeroSystems, Inc. 7,500 % fällig am 15.04.2025	1.100	1.099
Bank of America Corp. 5,015 % fällig am 22.07.2033	1.600	1.616	Wells Fargo & Co. 4,897 % fällig am 25.07.2033	1.200	1.092
Netflix, Inc. 5,375 % fällig am 15.11.2029	1.500	1.530	U.S. Treasury Notes 1,875 % fällig am 15.02.2032	1.187	1.078
Citigroup, Inc. 3,785 % fällig am 17.03.2033	1.600	1.503	Live Nation Entertainment, Inc. 6,500 % fällig am 15.05.2027	1.000	1.054
Venture Global Calcasieu Pass LLC 3,875 % fällig am 15.08.2029	1.425	1.266	Viking Cruises Ltd. 13,000 % fällig am 15.05.2025	900	978
MSCI, Inc. 3,625 % fällig am 01.11.2031	1.400	1.232	Triumph Group, Inc. 8,875 % fällig am 01.06.2024	885	887
U.S. Treasury Bonds 2,000 % fällig am 15.11.2041	1.200	1.179	Endeavor Energy Resources LP 5,750 % fällig am 30.01.2028	700	724
U.S. Treasury Notes 1,875 % fällig am 15.02.2032	1.187	1.112	PUG LLC 7,884 % fällig am 12.02.2027	771	721
Crown Castle International Corp. 2,250 % fällig am 15.01.2031	1.400	1.079	Intercontinental Exchange, Inc. 3,000 % fällig am 15.09.2060	975	711
Weyerhaeuser Co. 4,000 % fällig am 09.03.2052	1.125	998			
American Tower Corp. 2,950 % fällig am 15.01.2051	1.425	948	(a) Der PIMCO Credit Opportunities Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.		
Goldman Sachs Group, Inc. 4,482 % fällig am 23.08.2028	900	900	Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.		
Citigroup, Inc. 6,270 % fällig am 17.11.2033	900	900	Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.		

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
KAUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2022			VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2022		
PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	58.696.293	\$ 584.096	PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	57.583.875	\$ 573.000
	PARI (000S)			PARI (000S)	
Federal Home Loan Bank 4,345 % fällig am 06.03.2023	\$ 100.000	100.000	PIMCO ETFs plc – PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (a)	5.083.800	506.390
U.S. Treasury Bonds 4,000 % fällig am 15.11.2042	98.500	99.646	PIMCO Funds: Global Investors Series plc – US Short-Term Fund (a)	20.706.660	209.000
Nexi SpA 2,125 % fällig am 30.04.2029	€ 43.300	47.439			
Organon & Co. 2,875 % fällig am 30.04.2028	39.000	42.644	Saudi Arabia Government International Bond 4,500 % fällig am 26.10.2046	\$ 125.200	118.350
Volvo Car AB 4,250 % fällig am 31.05.2028	31.900	33.996	Qatar Government International Bond 4,400 % fällig am 16.04.2050	58.900	56.894
Atlantia SpA 1,875 % fällig am 12.02.2028	28.800	31.235	Occidental Petroleum Corp. 5,500 % fällig am 01.12.2025	52.000	53.474
Banco de Sabadell S.A. 5,375 % fällig am 08.09.2026	23.700	23.781	South Africa Government International Bond 5,750 % fällig am 30.09.2049	55.900	48.665
Corsair International Ltd. 5,473 % fällig am 28.01.2027	18.800	20.989	AT&T, Inc. 3,650 % fällig am 15.09.2059	53.173	45.787
Vmed O2 UK Financing PLC 4,000 % fällig am 31.01.2029	£ 15.600	19.959	Emirate of Abu Dhabi Government International Bond 2,700 % fällig am 02.09.2070	55.300	45.379
Prosus NV 3,680 % fällig am 21.01.2030	\$ 20.200	19.911	UniCredit SpA 2,200 % fällig am 22.07.2027	€ 42.250	43.392
Market Bidco Finco PLC 4,750 % fällig am 04.11.2027	€ 21.200	19.425	UPC Broadband Finco BV 4,875 % fällig am 15.07.2031	\$ 51.900	43.372
Albion Financing SARL 5,250 % fällig am 15.10.2026	16.700	18.641	Intesa Sanpaolo SpA 5,500 % fällig am 01.03.2028	€ 45.129	40.066
Banco Bilbao Vizcaya Argentina S.A. 6,138 % fällig am 14.09.2028	\$ 16.800	16.800	Gazprom PJSC Via Gaz Finance PLC 3,000 % fällig am 29.06.2027	\$ 77.600	38.883
Uniform Mortgage-Backed Security 5,500 % fällig am 01.12.2052	16.400	16.306	Abertis Infraestructuras S.A. 3,375 % fällig am 27.11.2026	£ 27.500	38.225
Russia Government International Bond 5,250 % fällig am 23.06.2047	28.000	15.715	Indonesia Government International Bond 0,900 % fällig am 14.02.2027	€ 37.483	38.074
Deutsche Bank AG 2,552 % fällig am 07.01.2028	15.600	15.600	Towd Point Mortgage Funding PLC 3,826 % fällig am 20.07.2045	£ 28.193	37.867
TDC Net A/S 5,056 % fällig am 31.05.2028	€ 12.800	13.730	Indonesia Government International Bond 4,625 % fällig am 15.04.2043	\$ 35.100	37.450
Intelsat Jackson Holdings S.A. 6,500 % fällig am 25.01.2030	\$ 13.710	13.367	Iliad Holding SASU 6,500 % fällig am 15.10.2036	37.150	36.370
CPI Property Group S.A. 1,750 % fällig am 14.01.2030	€ 10.800	11.936	Albion Financing SARL 6,752 % fällig am 17.08.2026	€ 32.354	34.855
			CGG S.A. 8,750 % fällig am 01.04.2027	\$ 39.100	34.740

(a) Der Diversified Income Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarriere genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2022			VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2022		
PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	3.415.911	\$ 33.995	PIMCO ETFs plc – PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (a)	580.700	\$ 57.791
	PARI (000S)		PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	2.844.863	28.309
Organon & Co. 2,875 % fällig am 30.04.2028	€ 4.200	4.584	PIMCO Funds: Global Investors Series plc – US Short-Term Fund (a)	1.585.189	16.000
SIG Combibloc Purchase Co. SARL 1,875 % fällig am 18.06.2023	3.900	4.102		PARI (000S)	
Nexi SpA 2,125 % fällig am 30.04.2029	3.600	3.944	Saudi Arabia Government International Bond 4,500 % fällig am 26.10.2046	\$ 11.900	12.530
Petroleos Mexicanos 4,875 % fällig am 21.02.2028	2.500	2.839	INEOS Finance PLC 3,898 % fällig am 01.04.2024	€ 9.718	9.626
Volvo Car AB 4,250 % fällig am 31.05.2028	2.600	2.771	Madison Park Euro Funding DAC 2,128 % fällig am 15.01.2032	7.000	6.606
Deutsche Bank AG 1,750 % fällig am 19.11.2030	3.600	2.691	Harvest CLO DAC 2,775 % fällig am 26.06.2030	6.823	6.521
Syngenta Finance NV 3,375 % fällig am 16.04.2026	2.600	2.328	EQT Corp. 6,125 % fällig am 01.02.2025	\$ 6.200	6.373
Banco de Sabadell S.A. 5,375 % fällig am 08.09.2026	2.300	2.308	Asset-Backed Funding Certificates Trust 4,609 % fällig am 25.10.2036	7.629	6.208
CPI Property Group S.A. 1,750 % fällig am 14.01.2030	2.200	2.251	Soundview Home Loan Trust 4,854 % fällig am 25.06.2036	7.208	6.084
HSBC Holdings PLC 5,210 % fällig am 11.08.2028	\$ 2.200	2.200	Countrywide Asset-Backed Certificates Trust 5,379 % fällig am 25.02.2036	6.000	5.253
AA Bond Co. Ltd. 5,500 % fällig am 31.07.2050	£ 2.200	2.188	Qatar Government International Bond 4,400 % fällig am 16.04.2050	5.500	5.225
Atlantia SpA 1,875 % fällig am 12.02.2028	€ 1.900	2.058	Deutsche Bank AG 1,625 % fällig am 20.01.2027	€ 4.500	5.161
Altice Financing S.A. 3,000 % fällig am 15.01.2028	2.000	1.952	HSBC Holdings PLC 4,300 % fällig am 08.03.2026	\$ 3.900	4.188
Corsair International Ltd. 5,473 % fällig am 28.01.2027	1.600	1.786	Park Aerospace Holdings Ltd. 4,500 % fällig am 15.03.2023	4.000	3.978
Albion Financing SARL 5,250 % fällig am 15.10.2026	1.600	1.786	Gazprom PJSC Via Gaz Finance PLC 3,000 % fällig am 29.06.2027	7.800	3.925
Prosus NV 3,680 % fällig am 21.01.2030	\$ 1.700	1.676	AerCap Ireland Capital DAC 3,150 % fällig am 15.02.2024	3.800	3.873
Market Bidco Finco PLC 4,750 % fällig am 04.11.2027	€ 1.700	1.558	Pertamina Persero PT 6,500 % fällig am 07.11.2048	3.700	3.780
Virgin Money UK PLC 4,000 % fällig am 03.09.2027	£ 1.400	1.414	Petroleos Mexicanos 4,875 % fällig am 21.02.2028	€ 4.000	3.771
Nova Kreditna Banka Maribor d.d. 1,875 % fällig am 27.01.2025	€ 1.200	1.361	Intesa Sanpaolo SpA 5,500 % fällig am 01.03.2028	4.600	3.748
Indonesia Government International Bond 1,100 % fällig am 12.03.2033	2.000	1.308			
TDC Net A/S 5,056 % fällig am 31.05.2028	1.100	1.180			

(a) Der Diversified Income Duration Hedged Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2022			VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2022		
PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	20.095	\$ 200	PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	20.095	\$ 200
	PARI (000S)			PARI (000S)	
Ford Motor Credit Co. LLC 4,063 % fällig am 01.11.2024	\$ 200	196	Azure Power Solar Energy Pvt Ltd. 5,650 % fällig am 24.12.2024	\$ 200	196
Azure Power Solar Energy Pvt Ltd. 5,650 % fällig am 24.12.2024	200	194	Ford Motor Credit Co. LLC 4,063 % fällig am 01.11.2024	200	196
ReNew Power Pvt Ltd. 5,875 % fällig am 05.03.2027	200	191	Shriram Transport Finance Co. Ltd. 4,400 % fällig am 13.03.2024	200	190
Shriram Transport Finance Co. Ltd. 4,400 % fällig am 13.03.2024	200	189	Skandinaviska Enskilda Banken AB 4,000 % fällig am 09.11.2026	€ 100	108
HSBC Holdings PLC 3,973 % fällig am 22.05.2030	200	187	Sunnova Energy Corp. 5,875 % fällig am 01.09.2026	\$ 100	94
Banco BTG Pactual S.A. 2,750 % fällig am 11.01.2026	200	178	Kilroy Realty LP 4,750 % fällig am 15.12.2028	100	92
BNP Paribas S.A. 1,675 % fällig am 30.06.2027	200	178	VICI Properties LP 3,750 % fällig am 15.02.2027	100	90
U.S. Treasury Bonds 4,000 % fällig am 15.11.2042	175	176	INEOS Finance PLC 2,875 % fällig am 01.05.2026	€ 100	88
Oman Government International Bond 6,750 % fällig am 17.01.2048	200	172	Ontex Group NV 3,500 % fällig am 15.07.2026	100	84
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc. 2,472 % fällig am 14.01.2029	200	171			
Natura Cosmeticos S.A. 4,125 % fällig am 03.05.2028	200	164	(a) Der Diversified Income ESG Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.		
Dominican Republic Government International Bond 6,500 % fällig am 15.02.2048	200	156	Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.		
Chile Government International Bond 3,100 % fällig am 07.05.2041	200	155	Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.		
Colombia Government International Bond 5,000 % fällig am 15.06.2045	200	140			
GE Capital UK Funding Unlimited Co. 5,875 % fällig am 18.01.2033	£ 100	137			
Morocco Government International Bond 4,000 % fällig am 15.12.2050	\$ 200	130			
Abertis Infraestructuras S.A. 3,375 % fällig am 27.11.2026	£ 100	115			
Ally Financial, Inc. 8,000 % fällig am 01.11.2031	\$ 100	113			
Panama Government International Bond 6,700 % fällig am 26.01.2036	100	109			
Marks & Spencer PLC 4,500 % fällig am 10.07.2027	£ 100	106			
Dell International LLC 6,020 % fällig am 15.06.2026	\$ 100	106			
Virgin Media Secured Finance PLC 4,125 % fällig am 15.08.2030	£ 100	104			
NXP BV 5,350 % fällig am 01.03.2026	\$ 100	103			
TDC Net A/S 5,056 % fällig am 31.05.2028	€ 100	102			
VMware, Inc. 4,500 % fällig am 15.05.2025	\$ 100	101			
Nokia Oyj 3,125 % fällig am 15.05.2028	€ 100	100			
Wells Fargo & Co. 4,540 % fällig am 15.08.2026	\$ 100	100			
CaixaBank S.A. 3,750 % fällig am 07.09.2029	€ 100	100			
Lincoln Financing SARRL 3,625 % fällig am 01.04.2024	100	100			
Kilroy Realty LP 4,750 % fällig am 15.12.2028	\$ 100	99			
Bellis Acquisition Co. PLC 3,250 % fällig am 16.02.2026	£ 100	99			
Aviation Capital Group LLC 5,500 % fällig am 15.12.2024	\$ 100	99			
Skandinaviska Enskilda Banken AB 4,000 % fällig am 09.11.2026	€ 100	98			
Flex Ltd. 4,875 % fällig am 15.06.2029	\$ 100	97			
Crown European Holdings S.A. 2,875 % fällig am 01.02.2026	€ 100	97			
Edgewell Personal Care Co. 5,500 % fällig am 01.06.2028	\$ 100	97			

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2022			VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2022		
PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	30.009.500	\$ 298.612	PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	26.435.944	\$ 263.070
	PARI (000S)			PARI (000S)	
Deutsche Bank AG 6,119 % fällig am 14.07.2026	\$ 12.202	12.202	U.S. Treasury Notes 1,875 % fällig am 31.07.2022	\$ 46.570	46.592
Eurosail PLC 4,461 % fällig am 13.06.2045	£ 11.226	11.766	U.S. Treasury Notes 1,375 % fällig am 31.10.2028	41.550	40.065
Stratton Mortgage Funding PLC 4,426 % fällig am 20.07.2060	10.705	11.546	U.S. Treasury Notes 0,875 % fällig am 15.11.2030	35.600	33.048
OCP Euro CLO DAC 0,000 % fällig am 20.01.2033	€ 10.000	10.323	U.S. Treasury Notes 0,500 % fällig am 28.02.2026	30.100	28.181
Palmer Square European Loan Funding DAC 3,993 % fällig am 12.04.2032	9.700	9.639	Lloyds Banking Group PLC 7,625 % fällig am 27.06.2023	£ 20.128	27.598
Madison Park Euro Funding DAC 2,128 % fällig am 15.01.2032	9.800	9.453	U.S. Treasury Notes 2,000 % fällig am 31.07.2022	\$ 19.900	19.915
Harmony French Home Loans 2,558 % fällig am 27.05.2062	7.500	8.412	NatWest Group PLC 0,750 % fällig am 15.11.2025	€ 13.300	12.635
Eurosail PLC 3,761 % fällig am 13.03.2045	£ 7.250	7.149	Peru Government International Bond 6,150 % fällig am 12.08.2032	PEN 53.300	12.243
Clarinda Park CLO DAC 2,698 % fällig am 15.02.2034	€ 7.550	7.027	U.S. Treasury Notes 2,375 % fällig am 15.05.2029	\$ 7.700	8.046
Resloc UK PLC 3,742 % fällig am 15.12.2043	£ 6.492	6.719	U.S. Treasury Notes 1,750 % fällig am 15.07.2022	7.740	7.743
Eurosail PLC 3,984 % fällig am 10.06.2044	6.316	6.659	U.S. Treasury Notes 0,250 % fällig am 30.09.2025	7.600	7.105
JPMorgan Chase & Co. 2,595 % fällig am 22.02.2026	\$ 6.400	6.400	Peru Government International Bond 6,350 % fällig am 12.08.2028	PEN 27.500	6.898
Babson CLO Ltd. 5,233 % fällig am 20.01.2031	5.700	5.659	Transocean, Inc. 7,250 % fällig am 01.11.2025	\$ 8.000	6.700
Aurium CLO DAC 3,152 % fällig am 23.03.2032	€ 5.000	5.487	Deutsche Bank AG 1,375 % fällig am 03.09.2026	€ 6.400	6.118
Stratton BTL Mortgage Funding 3,656 % fällig am 20.01.2054	£ 3.800	5.151	Hilton Domestic Operating Co., Inc. 4,000 % fällig am 01.05.2031	\$ 7.200	5.976
Dryden Euro CLO DAC 2,358 % fällig am 17.01.2033	€ 5.000	4.923	Coty, Inc. 5,000 % fällig am 15.04.2026	6.300	5.802
Barings CLO Ltd. 5,029 % fällig am 15.04.2031	\$ 5.000	4.835	Darrowby PLC 1,000 % fällig am 20.12.2057	£ 4.195	5.506
Credit Suisse Group AG 6,442 % fällig am 11.08.2028	4.750	4.750	Qatar Government International Bond 4,500 % fällig am 23.04.2028	\$ 5.100	5.247
Banco Santander S.A. 5,147 % fällig am 18.08.2025	4.400	4.400	Qatar Government International Bond 3,875 % fällig am 23.04.2023	4.900	4.909

(a) Der Dynamic Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
KAUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2022			VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2022		
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 30.05.2022	¥ 13.700.000	€ 104.930	Evergreen Marine Corp Taiwan Ltd.	14.474.222	€ 66.490
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 27.06.2022	13.690.000	104.065	JinkoSolar Holding Co. Ltd.	1.087.412	65.720
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 24.10.2022	13.250.000	95.237	Stora Enso Oyj 'R'	3.280.700	52.565
Bundesrepublik Deutschland 1,750 % fällig am 04.07.2022	€ 71.900	72.302	Arista Networks, Inc.	401.300	50.546
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 01.08.2022	¥ 9.030.000	65.254	Alphabet, Inc.	107.750	42.987
			UPM-Kymmene Oyj	1.315.900	41.800
			First Solar, Inc.	288.200	41.619
			Apple, Inc.	254.600	40.709
PIMCO Funds: Global Investors Series plc – Income Fund (a)	4.085.684	65.150		PARI (000S)	
Generac Holdings, Inc.	162.200	35.909	France Treasury Bills 0,000 % fällig am 04.05.2022	€ 38.200	38.227
				AKTIEN	
France Government International Bond 2,250 % fällig am 25.10.2022	€ 34.500	34.654	Mondi PLC	2.138.349	36.549
			COSCO Shipping Holdings Co. Ltd. 'H'	16.606.137	28.378
			Regeneron Pharmaceuticals, Inc.	47.600	28.362
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund (a)	2.716.001	31.316	Merck & Co., Inc.	287.200	27.597
Micron Technology, Inc.	481.100	31.136	AbbVie, Inc.	192.600	27.381
Merck & Co., Inc.	364.700	29.252		PARI (000S)	
			Spain Treasury Bills 0,000 % fällig am 13.01.2023	€ 26.300	26.276
France Treasury Bills 0,000 % fällig am 16.03.2022	€ 29.000	29.005		AKTIEN	
Europäische Union 0,000 % fällig am 05.05.2022	27.800	27.844	Baidu, Inc.	193.550	25.544
			Tokyo Electron Ltd.	57.800	25.286
Exxon Mobil Corp.	263.000	27.804	PIMCO Funds: Global Investors Series plc – PIMCO Capital Securities Fund (a)	2.401.802	25.060
				PARI (000S)	
European Union Treasury Bills 0,000 % fällig am 05.08.2022	€ 27.000	27.036	Bundesrepublik Deutschland 1,750 % fällig am 04.07.2022	€ 24.900	24.952
Italy Treasury Bills 0,000 % fällig am 31.03.2023	27.000	26.856		AKTIEN	
GXO Logistics, Inc.	416.900	26.589	Fortum Oyj	1.135.200	24.717
			Vertex Pharmaceuticals, Inc.	80.600	24.393
Spain Treasury Bills 0,000 % fällig am 13.01.2023	€ 26.300	26.255	Coinbase Global, Inc.	144.300	22.903
			AP Moller - Maersk A/S 'B'	7.781	22.659
Hanwha Solutions Corp.	680.800	25.043	Genscript Biotech Corp.	6.344.400	21.951
			Humana, Inc.	43.100	21.791
Bundesrepublik Deutschland 0,010 % fällig am 08.04.2022	€ 23.900	23.907	Cigna Corp.	76.900	21.417
Japan Government International Bond 0,100 % fällig am 01.03.2023	¥ 3.091.000	21.433	Mastercard, Inc.	64.600	20.834
OCP Euro CLO DAC 0,000 % fällig am 20.01.2023	€ 20.900	20.796	Rohm Co. Ltd.	289.100	20.628
			Lotes Co. Ltd.	861.336	20.603
Incyte Corp.	262.900	19.290	Holmen AB 'B'	418.600	20.230
Vestas Wind Systems A/S	684.000	18.277	Automatic Data Processing, Inc.	97.500	19.798
			Skyworks Solutions, Inc.	189.000	18.629
Goldman Sachs Group, Inc. 2,732 % fällig am 07.02.2025	€ 17.700	17.861	West Fraser Timber Co. Ltd.	227.300	18.595
Cigna Corp.	76.900	17.747			
SK Innovation Co. Ltd.	128.100	17.046			

(a) Der Dynamic Multi-Asset Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Emerging Local Bond Fund

31. Dezember 2022 (ungeprüft)

BESCHREIBUNG		AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG		AKTIEN	ERLÖSE (000S)
KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2022				VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2022			
PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		181.524.166	\$ 1.806.501	PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		187.081.375	\$ 1.861.830
		PARI (000S)				PARI (000S)	
Indonesia Government International Bond 6,375 % fällig am 15.04.2032	IDR	1.918.414.000	125.021	Indonesia Government International Bond 6,375 % fällig am 15.04.2032	IDR	1.918.414.000	123.739
Colombian TES 6,250 % fällig am 26.11.2025	COP	523.528.500	105.641	Colombian TES 6,250 % fällig am 26.11.2025	COP	601.928.500	109.633
Malaysia Government Investment Issue 3,990 % fällig am 15.10.2025	MYR	267.690	60.918	China Development Bank 3,000 % fällig am 07.08.2023	CNY	510.900	81.460
Indonesia Government International Bond 8,375 % fällig am 15.03.2034	IDR	809.508.000	58.315	Thailand Government International Bond 1,585 % fällig am 17.12.2035	THB	2.954.000	69.306
Thailand Government International Bond 2,000 % fällig am 17.12.2031	THB	1.852.310	51.311	Colombian TES 5,750 % fällig am 03.11.2027	COP	370.098.100	62.996
Colombian TES 5,750 % fällig am 03.11.2027	COP	275.048.100	49.751	Bonos de la Tesorería de la República en Pesos 5,000 % fällig am 01.10.2028	CLP	54.900.000	61.660
Mexico Government International Bond 5,500 % fällig am 04.03.2027	MXN	1.083.900	47.310	Malaysia Government Investment Issue 4,369 % fällig am 31.10.2028	MYR	255.460	58.895
Indonesia Government International Bond 6,375 % fällig am 15.08.2028	IDR	749.139.000	47.062	QNB Finance Ltd. 6,800 % fällig am 04.03.2030	IDR	951.700.000	58.619
Bonos de la Tesorería de la República en Pesos 5,000 % fällig am 01.10.2028	CLP	40.410.000	45.824	Indonesia Government International Bond 8,375 % fällig am 15.03.2034		733.486.000	53.869
Singapore Government International Bond 1,625 % fällig am 01.07.2031	SGD	61.700	44.253	Thailand Government International Bond 2,000 % fällig am 17.12.2031	THB	1.855.810	51.395
Indonesia Government International Bond 9,000 % fällig am 15.03.2029	IDR	516.966.000	40.816	Indonesia Government International Bond 6,375 % fällig am 15.08.2028	IDR	714.852.000	45.878
Thailand Government International Bond 3,390 % fällig am 17.06.2037	THB	1.471.700	40.774	Thailand Government International Bond 2,650 % fällig am 17.06.2028	THB	1.493.583	43.141
Thailand Government International Bond 2,650 % fällig am 17.06.2028		1.493.583	39.232	China Development Bank 3,420 % fällig am 02.07.2024	CNY	260.700	42.006
Malaysia Government International Bond 3,582 % fällig am 15.07.2032	MYR	153.064	34.224	Singapore Government International Bond 1,625 % fällig am 01.07.2031	SGD	61.700	41.482
Thailand Government International Bond 1,585 % fällig am 17.12.2035	THB	1.352.900	33.286	Indonesia Government International Bond 9,000 % fällig am 15.03.2029	IDR	516.966.000	40.590
Singapore Government International Bond 2,875 % fällig am 01.09.2030	SGD	40.900	32.942	Bonos de la Tesorería de la República en Pesos 2,500 % fällig am 01.03.2025	CLP	31.660.000	35.236
Colombian TES 7,500 % fällig am 26.08.2026	COP	144.215.700	32.695	Thailand Government International Bond 3,775 % fällig am 25.06.2032	THB	1.099.807	34.995
Indonesia Government International Bond 7,000 % fällig am 15.02.2033	IDR	502.143.000	32.672	Singapore Government International Bond 3,375 % fällig am 01.09.2033	SGD	40.850	34.728
Malaysia Government International Bond 3,899 % fällig am 16.11.2027	MYR	143.240	32.105	Malaysia Government International Bond 3,733 % fällig am 15.06.2028	MYR	143.800	33.551

(a) Der Emerging Local Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Emerging Local Bond ESG Fund

31. Dezember 2022 (ungeprüft)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	ERLÖSE (000S)
KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2022			VERKAUFE BIS 31. DEZEMBER 2022		
Colombian TES 7,000 % fällig am 26.03.2031	COP	1.603.200 \$	244	Malaysia Government International Bond 4,837 % fällig am 15.07.2025	MYR 900 \$ 209
Mexico Government International Bond 7,500 % fällig am 03.06.2027	MXN	4.700	216	Colombian TES 6,250 % fällig am 26.11.2025	COP 735.300 131
Malaysia Government International Bond 4,837 % fällig am 15.07.2025	MYR	900	209	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 9,000 % fällig am 08.07.2024	HUF 50.000 120
Malaysia Government Investment Issue 4,369 % fällig am 31.10.2028		900	206	Thailand Government International Bond 1,585 % fällig am 17.12.2035	THB 4.504 100
Thailand Government International Bond 1,585 % fällig am 17.12.2035	THB	8.230	186	Thailand Government International Bond 3,350 % fällig am 17.06.2033	2.630 80
Inter-American Development Bank 5,500 % fällig am 07.02.2023	IDR	2.720.000	181	Thailand Government International Bond 2,125 % fällig am 17.12.2026	2.600 74
South Africa Government International Bond 10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR	2.900	180	Republic of Colombia 1,000 % fällig am 26.11.2025	COP 418.100 72
Internationale Bank für Wiederaufbau und Entwicklung 4,750 % fällig am 21.01.2027	IDR	2.880.000	180	Republic of Colombia 1,000 % fällig am 26.11.2025	418.100 70
Czech Republic Government International Bond 2,400 % fällig am 17.09.2025	CZK	4.800	180	Republic of Colombia 1,000 % fällig am 26.11.2025	418.200 70
Malaysia Government Investment Issue 4,130 % fällig am 09.07.2029	MYR	850	177	Republic of Colombia 1,000 % fällig am 26.11.2025	418.200 69
South Africa Government International Bond 8,750 % fällig am 28.02.2048	ZAR	3.900	169	Republic of Colombia 1,000 % fällig am 26.11.2025	418.100 68
Romania Government International Bond 3,250 % fällig am 29.04.2024	RON	800	151	Indonesia Government International Bond 6,375 % fällig am 15.08.2028	IDR 1.042.000 66
Israel Treasury Bills 0,000 % fällig am 08.02.2023	ILS	500	143	Malaysia Government Investment Issue 4,369 % fällig am 31.10.2028	MYR 290 63
Israel Government International Bond 0,150 % fällig am 31.07.2023		500	140	Mexico Government International Bond 7,500 % fällig am 03.06.2027	MXN 1.300 62
Internationale Bank für Wiederaufbau und Entwicklung 9,750 % fällig am 21.01.2027	BRL	750	132	Thailand Government International Bond 4,875 % fällig am 22.06.2029	THB 1.600 54
Colombian TES 6,250 % fällig am 26.11.2025	COP	735.300	127	Poland Government International Bond 3,750 % fällig am 25.05.2027	PLN 300 52
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 9,000 % fällig am 08.07.2024	HUF	50.000	121	South Africa Government International Bond 8,000 % fällig am 31.01.2030	ZAR 900 48
Asian Development Bank 6,000 % fällig am 05.02.2026	BRL	750	120	Inter-American Development Bank 5,500 % fällig am 07.02.2023	IDR 610.000 39
Internationale Bank für Wiederaufbau und Entwicklung 4,500 % fällig am 22.01.2026	ZAR	2.200	118	Malaysia Government International Bond 2,632 % fällig am 15.04.2031	MYR 200 38
South Africa Government International Bond 6,500 % fällig am 28.02.2041		3.000	110	Thailand Government International Bond 2,000 % fällig am 17.06.2042	THB 1.520 32
Europäische Bank für Wiederaufbau und Entwicklung 3,010 % fällig am 13.03.2028	PLN	600	108	Malaysia Government International Bond 4,696 % fällig am 15.10.2042	MYR 100 22
Thailand Government International Bond 3,390 % fällig am 17.06.2037	THB	3.900	104	Malaysia Government International Bond 3,582 % fällig am 15.07.2032	90 20
Czech Republic Government International Bond 0,050 % fällig am 29.11.2029	CZK	3.400	102	Poland Government International Bond 1,750 % fällig am 25.04.2032	PLN 150 19
Asian Development Bank 4,700 % fällig am 12.03.2024	MXN	2.200	99		
South Africa Government International Bond 8,000 % fällig am 31.01.2030	ZAR	1.900	97		
Mexico Government International Bond 8,500 % fällig am 18.11.2038	MXN	2.100	97		
Thailand Government International Bond 3,350 % fällig am 17.06.2033	THB	3.438	96		
Indonesia Government International Bond 8,750 % fällig am 15.05.2031	IDR	1.386.000	95		
Indonesia Government International Bond 8,250 % fällig am 15.05.2036		1.335.000	94		
Malaysia Government International Bond 3,582 % fällig am 15.07.2032	MYR	410	90		
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0,625 % fällig am 25.07.2025	PLN	500	89		
Poland Government International Bond 2,500 % fällig am 25.07.2026		500	85		
South Africa Government International Bond 8,250 % fällig am 31.03.2032	ZAR	1.700	84		
Hungary Government International Bond 4,500 % fällig am 27.05.2032	HUF	46.600	83		
Europäische Bank für Wiederaufbau und Entwicklung 5,080 % fällig am 15.12.2025	MXN	1.900	82		
Malaysia Government International Bond 2,632 % fällig am 15.04.2031	MYR	400	81		
Czech Republic Government International Bond 2,000 % fällig am 13.10.2033	CZK	2.300	76		
Thailand Government International Bond 2,125 % fällig am 17.12.2026	THB	2.600	70		
Peru Government International Bond 6,350 % fällig am 12.08.2028	PEN	300	70		
Republic of Colombia 1,000 % fällig am 26.11.2025	COP	418.100	70		
Indonesia Government International Bond 6,375 % fällig am 15.04.2042	IDR	1.175.000	70		
Republic of Colombia 1,000 % fällig am 26.11.2025	COP	418.200	70		
Republic of Colombia 1,000 % fällig am 26.11.2025		418.100	69		
Uruguay Government International Bond 8,500 % fällig am 15.03.2028	UYU	3.200	69		
Republic of Colombia 1,000 % fällig am 26.11.2025	COP	418.200	68		
Republic of Colombia 1,000 % fällig am 26.11.2025		418.100	68		

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Emerging Markets Bond Fund

31. Dezember 2022 (ungeprüft)

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2022			VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2022		
PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	117.315.602	\$ 1.167.346	PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	157.831.793	\$ 1.570.551
	PARI (000S)			PARI (000S)	
U.S. Treasury Bonds 3,250 % fällig am 15.05.2042	\$ 113.500	112.064	Hazine Mustesarligi Varlik Kiralama A/S 7,250 % fällig am 24.02.2027	\$ 34.400	34.017
U.S. Treasury Notes 3,125 % fällig am 31.08.2029	52.000	50.309		AKTIEN	
	AKTIEN		PIMCO Funds: Global Investors Series plc – PIMCO Asia High Yield Bond Fund (a)	3.053.291	28.396
PIMCO Global Investors Series PLC – Emerging Markets Opportunities Fund (a)	4.473.752	43.950		PARI (000S)	
	PARI (000S)		Ukraine Government International Bond 7,750 % fällig am 01.09.2024	\$ 26.600	25.689
Hazine Mustesarligi Varlik Kiralama A/S 7,250 % fällig am 24.02.2027	\$ 34.400	34.400	Chile Government International Bond 3,100 % fällig am 07.05.2041	27.300	24.316
Israel Government International Bond 1,500 % fällig am 30.11.2023	ILS 108.000	31.232	Chalco Hong Kong Investment Co. Ltd. 2,100 % fällig am 28.07.2026	23.800	21.419
U.S. Treasury Notes 2,625 % fällig am 31.07.2029	\$ 30.000	29.947	Ivory Coast Government International Bond 5,250 % fällig am 22.03.2030	€ 22.250	20.501
Republic of Angola Via Avenir Issuer Ireland DAC 6,927 % fällig am 19.02.2027	27.212	25.335		AKTIEN	
Gaci First Investment Co. 5,000 % fällig am 13.10.2027	22.200	21.993	PIMCO Global Investors Series PLC – Emerging Markets Opportunities Fund (a)	2.116.402	20.000
U.S. Treasury Bonds 2,375 % fällig am 15.02.2042	25.000	21.225		PARI (000S)	
Angolan Government International Bond 8,750 % fällig am 14.04.2032	20.500	20.470	Angolan Government International Bond 8,750 % fällig am 14.04.2032	\$ 20.200	19.828
South Africa Government International Bond 10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR 330.100	20.245	Indonesia Asahan Aluminium Persero PT 5,450 % fällig am 15.05.2030	16.800	17.917
Chile Government International Bond 4,340 % fällig am 07.03.2042	\$ 19.800	19.196	Ecuador Government International Bond 2,500 % fällig am 31.07.2035	27.400	17.444
Hungary Government International Bond 5,250 % fällig am 16.06.2029	17.800	17.585	Nigeria Government International Bond 8,747 % fällig am 21.01.2031	20.850	16.863
Dominican Republic Government International Bond 5,500 % fällig am 22.02.2029	18.100	17.528	Saudi Arabia Government International Bond 3,750 % fällig am 21.01.2055	22.200	16.608
Corsair International Ltd. 5,473 % fällig am 28.01.2027	€ 15.600	17.416	Argentina Government International Bond 1,500 % fällig am 09.07.2035	81.200	16.430
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc. 5,063 % fällig am 12.09.2025	\$ 16.500	16.500	SPIC MTN Co. Ltd. 1,625 % fällig am 27.07.2025	17.000	16.028
Guatemala Government International Bond 5,250 % fällig am 10.08.2029	16.500	16.310	MAF Sukuk Ltd. 4,638 % fällig am 14.05.2029	15.000	13.915
Qatar Energy 3,300 % fällig am 12.07.2051	22.900	16.115	KSA Sukuk Ltd. 2,250 % fällig am 17.05.2031	14.100	13.265
BOI Finance BV 7,500 % fällig am 16.02.2027	€ 14.400	15.996	Indonesia Government International Bond 6,750 % fällig am 15.01.2044	9.650	13.191
			Egypt Government International Bond 7,600 % fällig am 30.06.2029	13.700	13.084
			Petronas Capital Ltd. 3,404 % fällig am 28.04.2061	17.000	12.583

(a) Der Emerging Markets Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Emerging Markets Bond ESG Fund

31. Dezember 2022 (ungeprüft)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	ERLÖSE (000S)
KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2022			VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2022		
U.S. Treasury Bonds 3,250 % fällig am 15.05.2042	\$ 66.400	\$ 65.747	Egypt Government International Bond 5,250 % fällig am 06.10.2025	\$ 22.400	\$ 20.520
U.S. Treasury Notes 3,125 % fällig am 31.08.2029	37.800	36.571	Hazine Mustesarligi Varlik Kiralama A/S 7,250 % fällig am 24.02.2027	20.300	20.097
Israel Treasury Bills 0,000 % fällig am 08.02.2023	ILS 116.500	33.360	Ecuador Government International Bond 5,500 % fällig am 31.07.2030	13.200	11.450
Israel Government International Bond 1,500 % fällig am 30.11.2023	89.900	25.418	Indonesia Government International Bond 4,350 % fällig am 11.01.2048	11.400	11.022
U.S. Treasury Bonds 3,375 % fällig am 15.08.2042	\$ 25.500	22.311	Mongolia Government International Bond 4,450 % fällig am 07.07.2031	12.200	10.885
Israel Government International Bond 0,150 % fällig am 31.07.2023	ILS 79.600	21.935	Indonesia Government International Bond 5,250 % fällig am 17.01.2042	10.300	10.467
Hazine Mustesarligi Varlik Kiralama A/S 7,250 % fällig am 24.02.2027	\$ 20.300	20.300	Dominican Republic Government International Bond 5,950 % fällig am 25.01.2027	10.000	9.532
Ecuador Government International Bond 2,500 % fällig am 31.07.2035	32.700	18.538	Kenya Government International Bond 8,000 % fällig am 22.05.2032	11.400	9.262
Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia 4,700 % fällig am 06.06.2032	16.900	16.900	Ukraine Government International Bond 7,750 % fällig am 01.09.2024	9.100	8.703
South Africa Government International Bond 10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR 241.200	14.793	Kookmin Bank 1,375 % fällig am 06.05.2026	9.400	8.510
Kazakhstan Government International Bond 6,500 % fällig am 21.07.2045	\$ 13.700	14.456	Shinhan Bank Co. Ltd. 1,375 % fällig am 21.10.2026	9.000	8.069
Panama Government International Bond 4,500 % fällig am 19.01.2063	14.500	14.409	Hungary Government International Bond 7,625 % fällig am 29.03.2041	7.200	7.984
South Africa Government International Bond 5,875 % fällig am 20.04.2032	13.500	13.500	Absa Group Ltd. 6,375 % fällig am 27.05.2026	8.100	7.571
Chile Government International Bond 2,750 % fällig am 31.01.2027	13.100	13.009	Senegal Government International Bond 6,250 % fällig am 23.05.2033	9.000	7.492
Fondo MIVIVIENDA S.A. 4,625 % fällig am 12.04.2027	13.000	12.955	UltraTech Cement Ltd. 2,800 % fällig am 16.02.2031	8.000	7.491
Dominican Republic Government International Bond 5,500 % fällig am 22.02.2029	12.400	12.064	Jordan Government International Bond 7,375 % fällig am 10.10.2047	10.000	7.323
Indonesia Government International Bond 5,250 % fällig am 17.01.2042	11.400	12.027	Uruguay Government International Bond 4,375 % fällig am 23.01.2031	6.604	7.116
Santander Holdings USA, Inc. 5,807 % fällig am 09.09.2026	12.000	12.000	Ivory Coast Government International Bond 5,250 % fällig am 22.03.2030	€ 7.300	6.728
Indian Railway Finance Corp. Ltd. 3,570 % fällig am 21.01.2032	11.700	11.701	Kazakhstan Government International Bond 1,550 % fällig am 09.11.2023	6.740	6.459
1MDB Global Investments Ltd. 4,400 % fällig am 09.03.2023	12.200	11.699	MercadoLibre, Inc. 2,375 % fällig am 14.01.2026	\$ 7.300	6.244
Hungary Government International Bond 5,250 % fällig am 16.06.2029	11.600	11.460	Klabn Austria GmbH 3,200 % fällig am 12.01.2031	7.200	6.200
Kenya Government International Bond 6,875 % fällig am 24.06.2024	12.900	11.146	Azure Power Energy Ltd. 3,575 % fällig am 19.08.2026	9.119	6.158
Poland Government International Bond 5,500 % fällig am 16.11.2027	11.100	11.043	Akbank T.A.S. 6,800 % fällig am 22.06.2031	6.500	6.135
South Africa Government International Bond 7,300 % fällig am 20.04.2052	11.000	11.000	Chile Government International Bond 3,500 % fällig am 31.01.2034	6.900	6.112
Hungary Government International Bond 5,000 % fällig am 22.02.2027	€ 10.600	10.817	Dominican Republic Government International Bond 4,875 % fällig am 23.09.2032	7.500	6.088
Chile Government International Bond 4,340 % fällig am 07.03.2042	\$ 10.700	10.691	Turkiye Vakiflar Bankasi TAO 5,500 % fällig am 01.10.2026	6.800	6.061
			Israel Government International Bond 3,800 % fällig am 13.05.2060	5.500	5.725
			Argentina Government International Bond 1,500 % fällig am 09.07.2035	28.100	5.500

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Emerging Markets Corporate Bond Fund

31. Dezember 2022 (ungeprüft)

BESCHREIBUNG			KOSTEN (000S)			ERLÖSE (000S)
KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2022						
PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)						
		9.334.287	\$	92.889		
					PARI (000S)	
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV 3,750 % fällig am 09.05.2027	€	2.100		2.159		
Samba Funding Ltd. 2,900 % fällig am 29.01.2027	\$	1.700		1.717		
Israel Government International Bond 1,500 % fällig am 30.11.2023	ILS	6.000		1.647		
LG Chem Ltd. 3,625 % fällig am 15.04.2029	\$	1.600		1.532		
Fab Sukuk Co. Ltd. 3,875 % fällig am 22.01.2024		1.500		1.513		
Saudi Arabian Oil Co. 4,250 % fällig am 16.04.2039		1.500		1.439		
Indian Railway Finance Corp. Ltd. 3,570 % fällig am 21.01.2032		1.400		1.303		
Israel Electric Corp. Ltd. 3,750 % fällig am 22.02.2032		1.200		1.175		
NBK SPC Ltd. 1,625 % fällig am 15.09.2027		1.200		1.075		
Banco de Chile 2,990 % fällig am 09.12.2031		1.200		1.037		
CT Trust 5,125 % fällig am 03.02.2032		1.000		960		
Bangkok Bank PCL 3,733 % fällig am 25.09.2034		1.200		955		
Kookmin Bank 2,500 % fällig am 04.11.2030		1.100		937		
Freeport Indonesia PT 4,763 % fällig am 14.04.2027		900		900		
First Abu Dhabi Bank PJSC 5,125 % fällig am 13.10.2027		900		894		
Reliance Industries Ltd. 2,875 % fällig am 12.01.2032		900		848		
Israel Government International Bond 0,150 % fällig am 31.07.2023	ILS	2.700		754		
Chile Government International Bond 4,340 % fällig am 07.03.2042	\$	900		739		
Energean Israel Finance Ltd. 5,375 % fällig am 30.03.2028		800		728		

BESCHREIBUNG						ERLÖSE (000S)
VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2022						
PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)						
		8.742.329	\$			87.000
					PARI (000S)	
South Africa Government International Bond 10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR	35.500				2.341
Gazprom Neft OAO Via GPN Capital S.A. 6,000 % fällig am 27.11.2023	\$	2.200				2.295
Lukoil Securities BV 3,875 % fällig am 06.05.2030		2.000				1.418
Saudi Arabian Oil Co. 2,875 % fällig am 16.04.2024		1.400				1.385
Lenovo Group Ltd. 5,875 % fällig am 24.04.2025		1.300				1.346
Gazprom PJSC Via Gaz Capital S.A. 4,950 % fällig am 23.03.2027		1.800				1.328
BBVA Bancomer S.A. 5,125 % fällig am 18.01.2033		1.450				1.293
Banco BTG Pactual S.A. 4,500 % fällig am 10.01.2025		1.300				1.261
BRF S.A. 4,875 % fällig am 24.01.2030		1.300				1.118
Zoomlion HK SPV Co. Ltd. 6,125 % fällig am 20.12.2022		1.100				1.105
Türkiye Sise ve Cam Fabrikalari A/S 6,950 % fällig am 14.03.2026		1.100				1.075
Sunny Optical Technology Group Co. Ltd. 3,750 % fällig am 23.01.2023		1.000				998
CSN Inova Ventures 6,750 % fällig am 28.01.2028		1.000				992
Altice Financing S.A. 2,250 % fällig am 15.01.2025	€	900				952
Tullow Oil PLC 10,250 % fällig am 15.05.2026	\$	900				920
Sands China Ltd. 4,875 % fällig am 18.06.2030		1.100				901
Akbank T.A.S. 6,800 % fällig am 06.02.2026		1.000				888
Kuwait Projects Co. SPC Ltd. 4,500 % fällig am 23.02.2027		900				822
First Quantum Minerals Ltd. 6,875 % fällig am 15.10.2027		900				819

(a) Der Emerging Markets Corporate Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund

31. Dezember 2022 (ungeprüft)

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2022			VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2022		
PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	12.029.117	\$ 119.731	PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	12.066.556	\$ 120.100
	PARI (000S)			PARI (000S)	
U.S. Treasury Bonds 2,375 % fällig am 15.02.2042	\$ 24.500	23.653	Singapore Government International Bond 2,875 % fällig am 01.07.2029	SGD 16.052	11.846
Colombian TES 6,250 % fällig am 26.11.2025	COP 66.459.700	12.444	Colombian TES 6,250 % fällig am 26.11.2025	COP 67.871.500	11.118
Singapore Government International Bond 2,875 % fällig am 01.07.2029	SGD 16.052	12.395	South Africa Government International Bond 10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR 171.200	10.513
U.S. Treasury Bonds 1,750 % fällig am 15.08.2041	\$ 11.000	7.523	Singapore Government International Bond 3,375 % fällig am 01.09.2033	SGD 10.200	8.362
South Africa Government International Bond 10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR 102.900	6.292	Bonos de la Tesorería de la República en Pesos 5,000 % fällig am 01.10.2026	CLP 6.670.000	7.289
Mexico Government International Bond 5,500 % fällig am 04.03.2027	MXN 133.000	5.872	Mexico Government International Bond 5,500 % fällig am 04.03.2027	MXN 133.000	5.603
Israel Government International Bond 0,150 % fällig am 31.07.2023	ILS 20.800	5.718	Emirate of Dubai Government International Bond 3,900 % fällig am 09.09.2050	\$ 4.700	3.956
U.S. Treasury Notes 2,500 % fällig am 30.04.2024	\$ 5.600	5.586	Ecuador Government International Bond 5,500 % fällig am 31.07.2030	4.000	3.493
Israel Treasury Bills 0,000 % fällig am 07.10.2022	ILS 19.000	5.530	Dominican Republic Government International Bond 5,300 % fällig am 21.01.2041	4.500	3.434
U.S. Treasury Bonds 3,375 % fällig am 15.08.2042	\$ 4.000	4.023	Empresa de los Ferrocarriles del Estado 3,068 % fällig am 18.08.2050	5.100	2.983
South Africa Government International Bond 8,000 % fällig am 31.01.2030	ZAR 75.100	3.878	Israel Government International Bond 1,250 % fällig am 30.11.2022	ILS 9.300	2.814
Empresa de los Ferrocarriles del Estado 3,068 % fällig am 18.08.2050	\$ 5.100	3.689	Peru Government International Bond 6,900 % fällig am 12.08.2037	PEN 11.800	2.757
Israel Treasury Bills 0,000 % fällig am 08.02.2023	ILS 11.000	3.187	LLPL Capital Pte. Ltd. 6,875 % fällig am 04.02.2039	\$ 2.528	2.414
Dominican Republic Government International Bond 5,300 % fällig am 21.01.2041	\$ 3.700	3.105	Romania Government International Bond 2,500 % fällig am 08.02.2030	€ 2.500	2.400
Israel Government International Bond 1,250 % fällig am 30.11.2022	ILS 9.300	2.952	Guara Norte SARL 5,198 % fällig am 15.06.2034	\$ 2.528	2.123
Vale S.A. 0,000 % fällig am 29.12.2049	BRL 29.580	2.941	Midwest Connector Capital Co. LLC 3,900 % fällig am 01.04.2024	2.000	2.070
Mong Duong Finance Holdings BV 5,125 % fällig am 07.05.2029	\$ 2.800	2.548	T-Mobile USA, Inc. 3,600 % fällig am 15.11.2060	2.600	1.998
Trust Fibra Uno 6,390 % fällig am 15.01.2050	2.500	2.535	Ghana Government International Bond 8,875 % fällig am 07.05.2042	3.600	1.998
LLPL Capital Pte. Ltd. 6,875 % fällig am 04.02.2039	2.528	2.534	Bonos de la Tesorería de la República en Pesos 4,700 % fällig am 01.09.2030	CLP 1.900.000	1.968

(a) Der PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund

31. Dezember 2022 (ungeprüft)

BESCHREIBUNG		PARI (000S)	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG		PARI (000S)	ERLÖSE (000S)
KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2022				VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2022			
Colombian TES 6,250 % fällig am 26.11.2025	COP	5.775.400	\$ 1.080	Colombian TES 6,250 % fällig am 26.11.2025	COP	6.927.400	\$ 1.271
Israel Treasury Bills 0,000 % fällig am 07.10.2022	ILS	3.600	1.048	Colombian TES 5,750 % fällig am 03.11.2027		5.681.700	1.007
		AKTIEN				AKTIEN	
PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		70.373	700	PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		80.385	800
		PARI (000S)				PARI (000S)	
Israel Treasury Bills 0,000 % fällig am 08.02.2023	ILS	2.100	608	South Africa Government International Bond 10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR	8.800	525
Israel Treasury Bills 0,000 % fällig am 03.05.2023		1.600	460	Bonos de la Tesoreria de la Republica en Pesos 2,500 % fällig am 01.03.2025	CLP	430.000	464
South Africa Government International Bond 10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR	5.100	321			AKTIEN	
Colombian TES 5,750 % fällig am 03.11.2027	COP	1.439.700	253	PIMCO ETFs plc – PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (a)		3.900	386
Lloyds Banking Group PLC 4,716 % fällig am 11.08.2026	\$	200	200			PARI (000S)	
Development Bank of Kazakhstan JSC 4,125 % fällig am 10.12.2022		200	200	Bonos de la Tesoreria de la Republica en Pesos 5,000 % fällig am 01.10.2028	CLP	255.000	291
Steas Funding DAC 7,230 % fällig am 17.03.2026		200	199			AKTIEN	
Flourish Century 6,600 % fällig am 04.02.2049		200	194	PIMCO Specialty Funds Ireland p.l.c. – PIMCO China Bond Fund (a)		16.369	220
Czech Republic Government International Bond 2,500 % fällig am 25.08.2028	CZK	4.600	167			PARI (000S)	
Bonos de la Tesoreria de la Republica en Pesos 5,800 % fällig am 01.06.2024	CLP	130.000	161	Banco Santander S.A. 6,750 % fällig am 25.04.2022	€	200	219
Colombian TES 7,500 % fällig am 26.08.2026	COP	691.000	154	South Africa Government International Bond 10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR	3.600	209
South Africa Government International Bond 2,000 % fällig am 31.01.2025	ZAR	2.466	151	MAF Global Securities Ltd. 4,750 % fällig am 07.05.2024	\$	200	206
Israel Government International Bond 1,500 % fällig am 30.11.2023	ILS	500	145	Growthpoint Properties International Pty. Ltd. 5,872 % fällig am 02.05.2023		200	201
Harbour Energy PLC 3,944 % fällig am 28.01.2054	£	100	129	BOC Aviation Ltd. 2,750 % fällig am 18.09.2022		200	200
Colombian TES 9,250 % fällig am 28.05.2042	COP	754.600	115	Banco BTG Pactual S.A. 4,500 % fällig am 10.01.2025		200	197
Corsair International Ltd. 5,473 % fällig am 28.01.2027	€	100	112	Egypt Government International Bond 14,605 % fällig am 08.09.2025	EGP	3.100	196
Israel Government International Bond 0,150 % fällig am 31.07.2023	ILS	400	109	Sands China Ltd. 5,625 % fällig am 08.08.2025	\$	200	195
Bonos de la Tesoreria de la Republica en Pesos 4,500 % fällig am 01.03.2026	CLP	90.000	107	DAE Funding LLC 1,550 % fällig am 01.08.2024		200	187
Republic of Colombia 1,000 % fällig am 26.11.2025	COP	536.100	107	Zambia Government International Bond 13,000 % fällig am 25.01.2031	ZMW	5.400	180
Hungary Government International Bond 5,000 % fällig am 22.02.2027	€	100	102	Health & Happiness H&H International Holdings Ltd. 5,625 % fällig am 24.10.2024	\$	200	174
Rio Oil Finance Trust 9,250 % fällig am 06.07.2024	\$	89	96	Bonos de la Tesoreria de la Republica en Pesos 4,500 % fällig am 01.03.2026	CLP	150.000	173
Israel Government International Bond 4,250 % fällig am 31.03.2023	ILS	300	88	Option One Mortgage Loan Trust 4,529 % fällig am 25.03.2037	\$	256	164
				Bonos de la Tesoreria de la Republica en Pesos 5,800 % fällig am 01.06.2024	CLP	130.000	152
				Bonos de la Tesoreria de la Republica en Pesos 4,700 % fällig am 01.09.2030		135.000	150
				Colombian TES 7,500 % fällig am 26.08.2026	COP	691.000	126
				Ukraine Government International Bond 7,750 % fällig am 01.09.2024	\$	200	118
				Republic of Colombia 1,000 % fällig am 26.11.2025	COP	536.100	104

(a) Der Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des PIMCO ESG Income Fund

31. Dezember 2022 (ungeprüft)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	ERLÖSE (000S)
KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2022			VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2022		
Internationale Bank für Wiederaufbau und Entwicklung 3,000 % fällig am 27.09.2023	\$ 10.950	\$ 11.353	Philippines Government International Bond 4,200 % fällig am 29.03.2047	\$ 650	\$ 680
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.01.2032 (a)	6.630	5.852	Sunnova Energy Corp. 5,875 % fällig am 01.09.2026	550	518
EMF-UK PLC 4,491 % fällig am 13.03.2046	£ 3.566	4.219	UBS AG 5,125 % fällig am 15.05.2024	500	506
Towd Point Mortgage Funding PLC 3,596 % fällig am 20.10.2051	3.000	3.556	VICI Properties LP 3,500 % fällig am 15.02.2025	500	472
Asian Development Bank 6,550 % fällig am 26.01.2025	ZAR 42.000	2.746	Berkeley Group PLC 2,500 % fällig am 11.08.2031	£ 650	444
U.S. Treasury Notes 3,875 % fällig am 30.09.2029	\$ 2.400	2.397	Cyrusone Europe Finance DAC 1,125 % fällig am 26.05.2028	€ 400	435
U.S. Treasury Notes 2,375 % fällig am 31.03.2029	2.100	2.083	Azure Power Solar Energy Pvt Ltd. 5,650 % fällig am 24.12.2024	\$ 400	402
280 Park Avenue Mortgage Trust 5,317 % fällig am 15.09.2034	2.000	1.941	Sunny Optical Technology Group Co. Ltd. 3,750 % fällig am 23.01.2023	400	401
Commercial Mortgage Trust 3,832 % fällig am 10.02.2036	2.000	1.828	NextEra Energy Operating Partners LP 4,250 % fällig am 15.07.2024	400	400
Madison Avenue Mortgage Trust 3,976 % fällig am 15.08.2034	1.770	1.705	Valeo 1,000 % fällig am 03.08.2028	€ 400	347
Long Beach Mortgage Loan Trust 4,699 % fällig am 25.08.2036	2.727	1.618	Northern States Power Co. 4,500 % fällig am 01.06.2052	\$ 300	309
Barclays Commercial Mortgage Securities Trust 4,498 % fällig am 10.08.2035	1.600	1.562	Lloyds Banking Group PLC 7,625 % fällig am 27.06.2023	£ 200	274
GSAMP Trust 4,869 % fällig am 25.06.2036	2.105	1.500	Duke Energy Carolinas LLC 3,550 % fällig am 15.03.2052	\$ 330	272
1211 Avenue of the Americas Trust 4,142 % fällig am 10.08.2035	1.595	1.491	Ford Motor Credit Co. LLC 3,096 % fällig am 04.05.2023	200	199
InTown Hotel Portfolio Trust 2,775 % fällig am 15.01.2033	1.325	1.316	MAF Sukuk Ltd. 3,933 % fällig am 28.02.2030	200	194
Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust 4,679 % fällig am 25.07.2036	1.306	1.311	Boral Finance Pty. Ltd. 3,750 % fällig am 01.05.2028	200	191
Structured Asset Investment Loan Trust 5,364 % fällig am 25.05.2035	1.405	1.311	Public Service Co. of Oklahoma 2,200 % fällig am 15.08.2031	200	171
First Franklin Mortgage Loan Trust 4,129 % fällig am 25.03.2036	1.446	1.311	Broadstone Net Lease LLC 2,600 % fällig am 15.09.2031	200	143
Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust 4,479 % fällig am 19.03.2037	1.475	1.291	Marks & Spencer PLC 4,500 % fällig am 10.07.2027	£ 100	140
Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust 4,889 % fällig am 25.08.2036	1.287	1.219	Azure Power Energy Ltd. 3,575 % fällig am 19.08.2026	\$ 186	136
Natixis Commercial Mortgage Securities Trust 3,917 % fällig am 15.11.2032	1.200	1.204			
Liberty Street Trust 4,501 % fällig am 10.02.2036	1.100	1.072	(a) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.		
Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust 5,389 % fällig am 25.10.2034	1.051	1.012	Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.		
NXP BV 5,000 % fällig am 15.01.2033	1.000	997	Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.		
Indian Railway Finance Corp. Ltd. 3,570 % fällig am 21.01.2032	950	950			

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)
KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2022		
PIMCO ETFs plc – PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)	2.289.800	€ 220.293
	PARI (000S)	
Spain Government International Bond 0,000 % fällig am 31.01.2026	€ 78.400	75.783
Japan Government International Bond 0,100 % fällig am 01.03.2023	¥ 9.056.000	62.795
France Government International Bond 0,100 % fällig am 25.07.2031	€ 43.464	50.840
United Kingdom Gilt 1,250 % fällig am 22.11.2027	£ 35.301	49.818
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 14.11.2022	¥ 5.830.000	42.575
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 24.10.2022	5.880.000	42.264
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,625 % fällig am 15.10.2027 (b)	\$ 29.980	28.907
Belgium Government International Bond 1,400 % fällig am 22.06.2053	€ 21.500	21.598
Spain Government International Bond 3,450 % fällig am 30.07.2066	15.200	20.989
France Treasury Bills 0,000 % fällig am 04.01.2023	20.130	20.096
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3,850 % fällig am 01.09.2049	16.300	18.883
Spain Government International Bond 2,550 % fällig am 31.10.2032	18.400	18.608
Spain Government International Bond 1,900 % fällig am 31.10.2052	19.200	18.482
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 2,000 % fällig am 15.11.2029	17.100	16.959
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,150 % fällig am 01.09.2052	19.000	15.523
Spain Government International Bond 0,100 % fällig am 30.04.2031	18.000	15.465
Electricite de France S.A. 2,875 % fällig am 15.12.2026	12.800	12.358
Ripon Mortgages PLC 4,011 % fällig am 28.08.2056	£ 8.600	10.237
France Government International Bond 0,100 % fällig am 25.07.2038	€ 9.287	10.088

BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2022		
PIMCO ETFs plc – PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)	2.109.500	€ 203.097
	PARI (000S)	
Spain Government International Bond 2,150 % fällig am 31.10.2025	€ 80.100	83.604
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,250 % fällig am 15.03.2028	79.900	67.436
Nykredit Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK 458.100	47.808
France Government International Bond 0,100 % fällig am 25.07.2031	€ 41.716	45.767
United Kingdom Gilt 1,250 % fällig am 22.11.2027	£ 35.795	41.687
Spain Government International Bond 1,400 % fällig am 30.07.2028	€ 39.700	40.495
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2030 (b)	\$ 31.915	30.374
Spain Government International Bond 1,450 % fällig am 31.10.2027	€ 29.500	28.120
Japan Government International Bond 0,100 % fällig am 10.03.2029	¥ 3.469.624	27.423
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2031 (b)	\$ 28.558	27.361
Spain Government International Bond 1,950 % fällig am 30.04.2026	€ 23.700	23.988
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab 1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK 208.458	23.650
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,400 % fällig am 15.05.2030	€ 22.750	23.481
Spain Government International Bond 0,800 % fällig am 30.07.2027	23.500	22.386
CVC Cordatus Loan Fund DAC 2,112 % fällig am 21.07.2030	23.013	22.346
France Government International Bond 0,750 % fällig am 25.05.2052	23.000	20.229
France Treasury Bills 0,000 % fällig am 04.01.2023	20.130	20.117
Spain Government International Bond 1,000 % fällig am 31.10.2050	22.000	17.486
Jyske Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK 150.450	17.289
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0,000 % fällig am 15.09.2028	€ 18.500	16.406
Ares European CLO DAC 2,158 % fällig am 15.10.2031	15.300	14.726
Dexia Credit Local S.A. 0,000 % fällig am 29.05.2024	14.600	14.673
Spain Government International Bond 1,450 % fällig am 31.10.2071	17.771	13.648

- (a) Der Euro Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.
- (b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2022			VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2022		
PIMCO ETFs plc – PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)	664.000	€ 64.198	PIMCO ETFs plc – PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)	785.000	€ 75.940
	PARI (000S)			PARI (000S)	
Goldman Sachs Group, Inc. 0,875 % fällig am 09.05.2029	€ 19.900	19.024	Goldman Sachs Group, Inc. 1,375 % fällig am 15.05.2024	€ 18.700	18.962
Banque Federative du Credit Mutuel S.A. 0,625 % fällig am 19.11.2027	15.400	15.300	ABN AMRO Bank NV 2,470 % fällig am 13.12.2029	\$ 17.200	14.207
Wells Fargo & Co. 1,000 % fällig am 02.02.2027	14.900	15.101	HSBC Holdings PLC 3,973 % fällig am 22.05.2030	17.000	14.205
Santander UK Group Holdings PLC 0,603 % fällig am 13.09.2029	10.100	9.851	Wells Fargo & Co. 1,625 % fällig am 02.06.2025	€ 12.400	12.933
BNP Paribas S.A. 1,904 % fällig am 30.09.2028	\$ 10.400	8.809	Santander UK Group Holdings PLC 3,625 % fällig am 14.01.2026	£ 10.000	12.763
Barclays PLC 0,577 % fällig am 09.08.2029	€ 9.000	8.750	Goldman Sachs Group, Inc. 0,875 % fällig am 09.05.2029	€ 11.800	10.311
Fresenius Medical Care AG & Co. KGaA 3,875 % fällig am 20.09.2027	8.400	8.369	BNP Paribas S.A. 4,705 % fällig am 10.01.2025	\$ 9.700	9.843
Mizuho Financial Group, Inc. 3,490 % fällig am 05.09.2027	6.500	6.500	Societe Generale S.A. 0,875 % fällig am 22.09.2028	€ 11.600	9.739
ABN AMRO Bank NV 2,375 % fällig am 01.06.2027	6.200	6.178	Credit Agricole S.A. 0,500 % fällig am 21.09.2029	10.400	9.060
ABN AMRO Bank NV 2,470 % fällig am 13.12.2029	\$ 7.100	6.141	BPCE S.A. 1,000 % fällig am 01.04.2025	8.900	8.465
easyJet FinCo BV 1,875 % fällig am 03.03.2028	€ 6.000	6.059	BNP Paribas S.A. 0,250 % fällig am 13.04.2027	9.000	8.294
SBB Treasury Oyj 2,284 % fällig am 08.02.2024	6.000	6.007	Fresenius Medical Care AG & Co. KGaA 3,875 % fällig am 20.09.2027	8.400	8.204
JAB Holdings BV 4,750 % fällig am 29.06.2032	5.600	5.600	Barclays PLC 3,125 % fällig am 17.01.2024	£ 6.000	7.397
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. 6,138 % fällig am 14.09.2028	\$ 5.400	5.452	Lloyds Banking Group PLC 1,875 % fällig am 15.01.2026	5.400	6.492
Atlantia SpA 1,875 % fällig am 12.02.2028	€ 5.200	5.213	Ares European CLO DAC 2,582 % fällig am 21.10.2033	€ 6.600	6.458
Balder Finland Oyj 1,375 % fällig am 24.05.2030	5.300	5.128	UniCredit SpA 2,200 % fällig am 22.07.2027	6.700	6.376
Global Switch Holdings Ltd. 1,500 % fällig am 31.01.2024	4.800	4.832	Morgan Stanley 1,342 % fällig am 23.10.2026	6.300	6.275
CPI Property Group S.A. 1,500 % fällig am 27.01.2031	5.000	4.810	Morgan Stanley 1,000 % fällig am 02.12.2022	6.000	6.053
Societe Generale S.A. 1,792 % fällig am 09.06.2027	\$ 5.600	4.768	Conti-Gummi Finance BV 1,125 % fällig am 25.09.2024	6.000	6.006
CaixaBank S.A. 3,750 % fällig am 07.09.2029	€ 4.500	4.470	(a) Der Euro Credit Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.		
Vilmorin & Cie S.A. 1,375 % fällig am 26.03.2028	4.400	4.400	Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.		
Chanel Ceres PLC 0,500 % fällig am 31.07.2026	4.300	4.288	Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.		
Lloyds Banking Group PLC 3,750 % fällig am 18.03.2028	\$ 4.600	4.216			
GN Store Nord A/S 0,875 % fällig am 25.11.2024	€ 4.000	4.024			
P3 Group SARL 1,625 % fällig am 26.01.2029	4.000	3.968			
JDE Peet's NV 0,500 % fällig am 16.01.2029	4.750	3.896			
Dutch Property Finance BV 2,328 % fällig am 28.10.2059	3.700	3.689			

Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Euro Income Bond Fund

31. Dezember 2022 (ungeprüft)

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2022			VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2022		
PIMCO ETFs plc – PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)	2.346.000	€ 225.890	PIMCO ETFs plc – PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)	1.915.900	€ 184.960
	PARI (000S)		PIMCO Funds: Global Investors Series plc – US Short-Term Fund (a)	8.755.553	81.965
Barclays PLC 7,437 % fällig am 02.11.2033	\$ 11.850	12.102		PARI (000S)	
Goldman Sachs Group, Inc. 1,250 % fällig am 07.02.2029	€ 9.762	9.731	Nykredit Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK 334.982	34.792
P3 Group SARL 1,625 % fällig am 26.01.2029	9.800	9.721	BNP Paribas S.A. 4,705 % fällig am 10.01.2025	\$ 30.500	30.429
Societe Generale S.A. 2,226 % fällig am 21.01.2026	\$ 11.000	9.700	Jyske Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK 233.848	27.345
Societe Generale S.A. 2,797 % fällig am 19.01.2028	10.800	9.523	Nordea Kredit Realkreditaktieselskab 1,000 % fällig am 01.10.2050	224.800	26.089
Bank of America Corp. 1,000 % fällig am 24.07.2026	9.400	9.173	Aeroporti di Roma SpA 5,441 % fällig am 20.02.2023	£ 15.000	18.581
Intesa Sanpaolo SpA 8,248 % fällig am 21.11.2033	9.025	8.939	INEOS Finance PLC 1,000 % fällig am 08.11.2027	€ 18.984	18.511
United Kingdom Gilt 0,500 % fällig am 22.07.2022	£ 7.200	8.606	INEOS Finance PLC 3,898 % fällig am 01.04.2024	18.984	18.414
Toro European CLO DAC 2,239 % fällig am 12.01.2032	€ 8.700	8.548	Goldman Sachs Group, Inc. 0,875 % fällig am 09.05.2029	19.400	17.942
Ford Motor Credit Co. LLC 4,125 % fällig am 17.08.2027	\$ 9.200	8.494	Oman Government International Bond 4,875 % fällig am 01.02.2025	\$ 18.900	17.292
Mizuho Financial Group, Inc. 3,490 % fällig am 05.09.2027	€ 8.300	8.300	Stratton Mortgage Funding PLC 3,826 % fällig am 20.07.2060	£ 12.926	15.425
Dutch Property Finance BV 2,328 % fällig am 28.10.2059	7.400	7.379	InterContinental Hotels Group PLC 1,625 % fällig am 08.10.2024	€ 14.900	15.125
Westpac Banking Corp. 3,106 % fällig am 23.11.2027	7.300	7.300	Casino Guichard Perrachon S.A. 5,340 % fällig am 31.08.2025	16.500	14.460
Digital Intrepid Holding BV 1,375 % fällig am 18.07.2032	7.500	7.273	Jaguar Land Rover Automotive PLC 3,875 % fällig am 01.03.2023	£ 12.600	14.445
France Government International Bond 0,000 % fällig am 25.03.2023	7.150	7.115	Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 3,625 % fällig am 24.09.2024	€ 14.800	14.267
TDC Net A/S 5,056 % fällig am 31.05.2028	7.000	7.041	Nordea Kredit Realkreditaktieselskab 1,000 % fällig am 01.10.2053	DKK 113.874	14.074
easyJet FinCo BV 1,875 % fällig am 03.03.2028	6.500	6.566	Ivory Coast Government International Bond 5,250 % fällig am 22.03.2030	€ 14.400	14.000
Balder Finland Oyj 2,000 % fällig am 18.01.2031	6.500	6.478	ABN AMRO Bank NV 2,470 % fällig am 13.12.2029	\$ 16.500	13.878
DVI Deutsche Vermoögens- & Immobilienverwaltungs GmbH 2,500 % fällig am 25.01.2027	6.400	6.366	Jyske Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.10.2053	DKK 128.289	13.850
Jubilee Place BV 2,226 % fällig am 17.01.2059	6.300	6.329			
Wells Fargo & Co. 4,540 % fällig am 15.08.2026	\$ 6.450	6.313			
Carlyle Euro CLO DAC 2,428 % fällig am 15.08.2030	€ 6.384	6.297			

(a) Der Euro Income Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Euro Long Average Duration Fund

31. Dezember 2022 (ungeprüft)

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2022			VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2022		
PIMCO ETFs plc – PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)	194.000	€ 18.570	PIMCO ETFs plc – PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)	142.100	€ 13.506
	PARI (000S)			PARI (000S)	
France Government International Bond 0,750 % fällig am 25.05.2052	€ 15.000	12.131	Bundesrepublik Deutschland 0,000 % fällig am 15.08.2052	€ 7.700	5.814
Bundesrepublik Deutschland 0,000 % fällig am 15.08.2052	7.700	6.588	United Kingdom Gilt 1,000 % fällig am 22.04.2024	£ 4.200	4.627
United Kingdom Gilt 1,000 % fällig am 22.04.2024	£ 4.200	4.608	France Government International Bond 1,500 % fällig am 25.05.2050	€ 4.150	4.191
France Government International Bond 4,000 % fällig am 25.04.2055	€ 2.200	3.621	Bundesrepublik Deutschland 0,000 % fällig am 15.08.2050	4.300	4.000
France Government International Bond 0,100 % fällig am 25.07.2031	2.509	2.995	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0,875 % fällig am 04.07.2039	3.000	3.169
Slovenia Government International Bond 1,500 % fällig am 25.03.2035	2.400	2.377	France Government International Bond 0,750 % fällig am 25.05.2052	4.200	3.142
Netherlands Government International Bond 4,000 % fällig am 15.01.2037	1.900	2.324	France Government International Bond 0,100 % fällig am 25.07.2031	2.523	2.982
Netherlands Government International Bond 0,000 % fällig am 15.01.2052	3.900	2.170	France Government International Bond 1,250 % fällig am 25.05.2036	2.600	2.839
United Kingdom Gilt 0,125 % fällig am 30.01.2026	£ 1.900	1.956	Japan Government International Bond 0,100 % fällig am 10.03.2029	¥ 332.845	2.629
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,625 % fällig am 15.10.2027 (b)	\$ 2.005	1.935	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2030 (b)	\$ 2.273	2.162
Netherlands Government International Bond 0,000 % fällig am 15.01.2038	€ 2.500	1.799	Nykredit Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK 18.000	1.929
France Government International Bond 0,500 % fällig am 25.06.2044	2.200	1.780	Nykredit Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.10.2050	14.370	1.625
Belgium Government International Bond 1,400 % fällig am 22.06.2053	1.500	1.482	France Government International Bond 1,750 % fällig am 25.06.2039	€ 1.500	1.458
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.01.2032 (b)	\$ 1.517	1.478	CVC Cordatus Loan Fund DAC 2,112 % fällig am 21.07.2030	1.338	1.306
Ministeries van de Vlaamse Gemeenschap 3,250 % fällig am 12.01.2043	€ 1.200	1.180	Jyske Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.10.2053	DKK 12.898	1.276
France Government International Bond 4,000 % fällig am 25.04.2060	750	1.179	Atlantia SpA 1,875 % fällig am 12.02.2028	€ 1.200	1.196
Spain Government International Bond 1,900 % fällig am 31.10.2052	900	869	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,400 % fällig am 15.05.2030	972	999
United Kingdom Gilt 1,250 % fällig am 22.11.2032	£ 439	829	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,000 % fällig am 15.02.2048 (b)	\$ 944	945
Nykredit Realkredit A/S 3,500 % fällig am 01.10.2053	DKK 6.100	805	France Government International Bond 0,500 % fällig am 25.06.2044	€ 1.500	934

(a) Der Euro Long Average Duration Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des PIMCO European High Yield Bond Fund

31. Dezember 2022 (ungeprüft)

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2022			VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2022		
PIMCO ETFs plc – PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)	48.000	€ 4.593	PIMCO ETFs plc – PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)	54.900	€ 5.274
	PARI (000S)			PARI (000S)	
iliad S.A. 5,375 % fällig am 14.06.2027	€ 2.700	2.706	Lorca Telecom Bondco S.A. 4,000 % fällig am 18.09.2027	€ 2.300	2.082
Intrum AB 9,250 % fällig am 15.03.2028	2.400	2.328	Deutsche Bank AG 5,625 % fällig am 19.05.2031	2.100	2.073
Lorca Telecom Bondco S.A. 4,000 % fällig am 18.09.2027	2.300	2.268	Matterhorn Telecom S.A. 3,125 % fällig am 15.09.2026	2.050	1.968
Lorca Holdco Ltd. 6,319 % fällig am 17.09.2027	2.300	2.185	Lincoln Financing SARL 3,625 % fällig am 01.04.2024	1.950	1.927
Intesa Sanpaolo SpA 8,248 % fällig am 21.11.2033	\$ 2.100	2.084	Petroleos Mexicanos 3,625 % fällig am 24.11.2025	1.750	1.747
Inter Media and Communication SpA 6,750 % fällig am 09.02.2027	€ 2.000	1.971	Mausier Packaging Solutions Holding Co. 4,750 % fällig am 15.04.2024	1.800	1.723
Cellnex Finance Co. S.A. 1,500 % fällig am 08.06.2028	2.000	1.855	Albion Financing SARL 6,752 % fällig am 17.08.2026	1.700	1.694
Albion Financing SARL 5,250 % fällig am 15.10.2026	1.700	1.678	Casino Guichard Perrachon S.A. 3,580 % fällig am 07.02.2025	1.900	1.625
EP Infrastructure A/S 1,698 % fällig am 30.07.2026	1.900	1.441	Dufry One BV 2,500 % fällig am 15.10.2024	1.600	1.561
Logicor Financing SARL 2,250 % fällig am 13.05.2025	1.500	1.394	Altice Financing S.A. 2,250 % fällig am 15.01.2025	1.500	1.440
Electricite de France S.A. 2,875 % fällig am 15.12.2026	1.800	1.387	Intrum AB 3,500 % fällig am 15.07.2026	1.650	1.374
Market Bidco Finco PLC 4,750 % fällig am 04.11.2027	1.600	1.360	Ford Motor Credit Co. LLC 2,386 % fällig am 17.02.2026	1.500	1.355
Bellis Acquisition Co. PLC 3,250 % fällig am 16.02.2026	£ 1.400	1.340	Q-Park Holding BV 2,000 % fällig am 01.03.2027	1.600	1.314
Commerzbank AG 4,000 % fällig am 05.12.2030	€ 1.300	1.229	La Financiere Atalian SASU 5,125 % fällig am 15.05.2025	1.300	1.254
IHO Verwaltungs GmbH (3,875 % bar oder 4,625 % PIK) 3,875 % fällig am 15.05.2027	1.200	1.222	International Game Technology PLC 2,375 % fällig am 15.04.2028	1.400	1.184
Adevinta ASA 3,000 % fällig am 15.11.2027	1.200	1.195	eG Global Finance PLC 4,375 % fällig am 07.02.2025	1.200	1.170
La Financiere Atalian SASU 5,125 % fällig am 15.05.2025	1.300	1.105	Ortho-Clinical Diagnostics S.A. 1,000 % fällig am 30.06.2025	1.133	1.133
Dufry One BV 2,000 % fällig am 15.02.2027	1.300	1.103	Adevinta ASA 3,000 % fällig am 15.11.2027	1.200	1.038
Gatwick Airport Finance PLC 4,375 % fällig am 07.04.2026	£ 1.100	1.100	Occidental Petroleum Corp. 6,625 % fällig am 01.09.2030	\$ 1.000	1.031
Summer BC Holdco SARL 5,750 % fällig am 31.10.2026	€ 1.200	1.088	Banijay Entertainment SASU 3,500 % fällig am 01.03.2025	€ 1.000	980
Altice Financing S.A. 3,000 % fällig am 15.01.2028	1.200	1.067	CGG S.A. 7,750 % fällig am 01.04.2027	1.000	958
Norican A/S 4,500 % fällig am 15.05.2023	1.100	1.065	Summer (BC) Holdco B SARL 6,611 % fällig am 04.12.2026	\$ 973	940
Clarios Global LP 4,375 % fällig am 15.05.2026	1.000	990	Renault S.A. 2,375 % fällig am 25.05.2026	€ 1.000	911
Zenith Finco PLC 6,500 % fällig am 30.06.2027	£ 800	951	Altice France Holding S.A. 8,000 % fällig am 15.05.2027	1.050	910
Elior Group S.A. 3,750 % fällig am 15.07.2026	€ 1.100	924	Axalta Coating Systems Dutch Holding BV 3,750 % fällig am 15.01.2025	900	909
FIS Fabbrica Italiana Sintetici SpA 5,625 % fällig am 01.08.2027	900	900	IQVIA, Inc. 2,250 % fällig am 15.03.2029	900	892
Cellnex Finance Co. S.A. 2,000 % fällig am 15.09.2032	1.300	896	Sigma Bidco BV 3,738 % fällig am 02.07.2025	1.000	885
Volvo Car AB 4,250 % fällig am 31.05.2028	900	894	Fenix Marine Service Holdings Ltd. 8,000 % fällig am 15.01.2024	\$ 900	868
Nexi SpA 2,125 % fällig am 30.04.2029	900	873	Banijay Entertainment SASU 5,375 % fällig am 01.03.2025	950	855
InPost S.A. 2,250 % fällig am 15.07.2027	900	861	Ithaca Energy North Sea PLC 9,000 % fällig am 15.07.2026	900	847
Loarre Investments SARL 6,500 % fällig am 15.05.2029	900	850	Veritas U.S., Inc. 4,750 % fällig am 01.09.2025	€ 987	844
CTP NV 0,500 % fällig am 21.06.2025	1.000	848	Bausch Health Americas, Inc. 9,250 % fällig am 01.04.2026	\$ 900	840
			Zayo Group Holdings, Inc. 5,148 % fällig am 09.03.2027	€ 980	804
			RCS & RDS S.A. 2,500 % fällig am 05.02.2025	900	794
			Lagardere S.A. 1,750 % fällig am 07.10.2027	800	782

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	ERLÖSE (000S)
VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2022 (Forts.)		
Air France-KLM 1,875 % fällig am 16.01.2025	€ 800	€ 712
Albion Financing SARL 5,250 % fällig am 15.10.2026	800	700
IQVIA, Inc. 2,875 % fällig am 15.09.2025	700	699
ADLER Group S.A. 1,875 % fällig am 14.01.2026	1.100	682

(a) Der PIMCO European High Yield Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Euro Short-Term Fund

31. Dezember 2022 (ungeprüft)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	ERLÖSE (000S)
KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2022			VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2022		
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 27.06.2022	¥	1.830.000	€	13.911	
Lloyds Banking Group PLC 1,000 % fällig am 15.01.2024	€	9.700		9.656	
Sumitomo Mitsui Banking Corp. 0,550 % fällig am 06.11.2023		9.200		9.131	
BNZ International Funding Ltd. 0,625 % fällig am 03.07.2025		8.200		8.000	
Toronto-Dominion Bank 1,707 % fällig am 28.07.2025		6.200		6.217	
Virgin Money UK PLC 0,375 % fällig am 27.05.2024		6.000		5.919	
Wells Fargo & Co. 1,338 % fällig am 04.05.2025		6.000		5.895	
Morgan Stanley 0,637 % fällig am 26.07.2024		5.900		5.828	
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc. 2,264 % fällig am 14.06.2025		5.800		5.791	
Korea Housing Finance Corp. 0,723 % fällig am 22.03.2025		5.700		5.700	
Bank of Ireland Group PLC 1,375 % fällig am 29.08.2023		5.600		5.585	
Israel Treasury Bills 0,000 % fällig am 03.08.2022	ILS	20.000		5.576	
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 14.11.2022	¥	700.000		5.112	
Wells Fargo & Co. 0,500 % fällig am 26.04.2024	€	5.200		5.047	
Credit Suisse AG 3,184 % fällig am 31.05.2024		4.900		4.905	
LT Autorahoitus DAC 1,000 % fällig am 17.12.2032		4.500		4.500	
Banque Federative du Credit Mutuel S.A. 3,508 % fällig am 26.01.2025	£	3.700		4.401	
HSBC Holdings PLC 0,875 % fällig am 06.09.2024	€	4.200		4.284	
HSBC Holdings PLC 1,500 % fällig am 04.12.2024		4.200		4.154	
Goldman Sachs Group, Inc. 2,732 % fällig am 07.02.2025		4.000		4.036	
			€	12.200	€
			DKK	100.300	12.122
			€	10.500	10.568
				9.700	9.649
				8.000	7.742
				7.800	7.555
				7.800	7.492
				7.100	7.101
				6.900	6.784
			\$	7.400	6.585
			£	5.800	6.584
			€	6.500	6.506
				5.800	5.860
			£	4.700	5.780
			€	5.690	5.533
				5.627	5.501
				5.300	5.304
				5.200	4.994
			£	3.800	4.821
			€	4.800	4.806

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des PIMCO European Short-Term Opportunities Fund

31. Dezember 2022 (ungeprüft)

BESCHREIBUNG			KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG			ERLÖSE (000S)
KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2022				VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2022			
	AKTIEN				AKTIEN		
PIMCO ETFs plc – PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)	292.400	€	28.181	PIMCO ETFs plc – PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)	363.400	€	34.904
	PARI (000S)				PARI (000S)		
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 24.10.2022	¥	720.000	5.175	Jyske Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK	123.600	13.998
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 14.11.2022		680.000	4.966	Nordea Kredit Realkreditaktieselskab 1,000 % fällig am 01.10.2050		109.500	11.184
France Government International Bond 0,100 % fällig am 25.07.2031	€	3.339	3.908	Nykredit Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.10.2050		88.976	9.475
Spain Government International Bond 2,550 % fällig am 31.10.2032		3.000	3.000	Nykredit Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.10.2053		68.800	6.900
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,625 % fällig am 15.10.2027 (b)	\$	2.907	2.806	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.01.2030 (b)	\$	6.949	6.579
Nykredit Realkredit A/S 3,500 % fällig am 01.10.2053	DKK	19.700	2.573	Nykredit Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.10.2053	DKK	61.775	6.571
DVI Deutsche Vermögens- & Immobilienverwaltungs GmbH 2,500 % fällig am 25.01.2027	€	1.900	1.890	Spain Government International Bond 1,250 % fällig am 31.10.2030	€	5.800	5.193
Realkredit Danmark A/S 3,000 % fällig am 01.10.2053	DKK	13.900	1.800	France Government International Bond 0,100 % fällig am 25.07.2031		3.259	3.856
Nykredit Realkredit A/S 5,000 % fällig am 01.10.2053		13.900	1.798	Bayer Capital Corp. BV 0,067 % fällig am 27.06.2022		3.800	3.806
Primrose Residential DAC 2,644 % fällig am 24.03.2061	€	1.505	1.462	Coventry Building Society 1,500 % fällig am 23.01.2023	£	3.100	3.648
Ripon Mortgages PLC 4,011 % fällig am 28.08.2056	£	1.200	1.428	Nykredit Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK	30.030	3.396
Palmer Square European Loan Funding DAC 2,428 % fällig am 15.10.2031	€	1.300	1.300	Jyske Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.10.2050		29.288	3.057
Slovenia Government International Bond 1,175 % fällig am 13.02.2062		1.300	1.297	Societe Generale S.A. 0,277 % fällig am 01.04.2022	€	2.900	2.905
Credit Suisse Schweiz AG 3,390 % fällig am 05.12.2025		1.200	1.200	Spain Government International Bond 2,550 % fällig am 31.10.2032		3.000	2.847
Silfin NV 2,875 % fällig am 11.04.2027		1.200	1.189	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2031 (b)	\$	2.835	2.716
Electricite de France S.A. 2,625 % fällig am 01.12.2027		1.200	1.142	Jyske Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.10.2053	DKK	21.073	2.147
Goldman Sachs Group, Inc. 2,732 % fällig am 07.02.2025		1.100	1.110	Spain Government International Bond 0,100 % fällig am 30.04.2031	€	2.600	2.133
Slovenia Government International Bond 1,750 % fällig am 03.11.2040		1.100	1.107	Barclays Bank PLC 7,625 % fällig am 21.11.2022	\$	2.100	2.080
Palmer Square European Loan Funding DAC 2,098 % fällig am 15.10.2031		1.100	1.100	Europäische Union 0,000 % fällig am 04.07.2031	€	2.100	2.015

- (a) Der PIMCO European Short-Term Opportunities Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.
(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Global Advantage Fund

31. Dezember 2022 (ungeprüft)

BESCHREIBUNG			KOSTEN (000S)		BESCHREIBUNG			ERLÖSE (000S)
KÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2022				AKTIEN	VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2022			
PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)			143.647	\$	PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		143.900	\$
		PARI (000S)					PARI (000S)	
Singapore Government International Bond 1,625 % fällig am 01.07.2031	SGD	9.000	6.360		China Government Bond 3,280 % fällig am 03.12.2027	CNY	64.900	10.586
Ripon Mortgages PLC 4,011 % fällig am 28.08.2056	£	3.900	5.324		Japan Government International Bond 0,100 % fällig am 20.09.2031	¥	1.280.000	9.934
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 24.10.2022	¥	710.000	5.221		China Government Bond 3,020 % fällig am 22.10.2025	CNY	55.700	8.930
Japan Government International Bond 0,005 % fällig am 20.03.2027		490.000	3.812		Japan Government International Bond 0,100 % fällig am 20.06.2031	¥	850.000	6.475
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.01.2032 (b)	\$	3.773	3.563		Singapore Government International Bond 1,625 % fällig am 01.07.2031	SGD	9.000	5.841
Israel Treasury Bills 0,000 % fällig am 08.02.2023	ILS	9.900	2.948		New South Wales Treasury Corp. 2,750 % fällig am 20.11.2025	AUD	5.200	5.322
China Government Bond 2,680 % fällig am 21.05.2030	CNY	18.200	2.819		Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 24.10.2022	¥	710.000	4.905
Malaysia Government International Bond 3,480 % fällig am 15.03.2023	MYR	13.000	2.760		Kuwait International Government Bond 3,500 % fällig am 20.03.2027	\$	3.800	4.044
Dominican Republic Government International Bond 5,500 % fällig am 22.02.2029	\$	2.600	2.600		Japan Government International Bond 0,005 % fällig am 20.03.2027	¥	490.000	3.617
Singapore Government International Bond 2,875 % fällig am 01.09.2030	SGD	3.200	2.504		Singapore Government International Bond 2,875 % fällig am 01.09.2030	SGD	5.000	3.611
Thailand Government International Bond 1,585 % fällig am 17.12.2035	THB	94.700	2.076		Nykredit Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK	34.000	3.578
Credit Suisse Group AG 7,750 % fällig am 01.03.2029	€	1.700	1.794		U.S. Treasury Notes 2,875 % fällig am 30.04.2025	\$	3.400	3.413
China Government Bond 3,810 % fällig am 14.09.2050	CNY	10.600	1.790		China Development Bank 3,340 % fällig am 14.07.2025	CNY	19.800	3.168
France Government International Bond 0,100 % fällig am 25.07.2031	€	1.669	1.721		Saudi Arabia Government International Bond 4,375 % fällig am 16.04.2029	\$	2.800	3.050
Israel Government International Bond 1,500 % fällig am 30.11.2023	ILS	6.000	1.718		Malaysia Government International Bond 3,733 % fällig am 15.06.2028	MYR	12.200	2.898
Prosus NV 1,207 % fällig am 19.01.2026	€	1.500	1.713		China Government Bond 2,680 % fällig am 21.05.2030	CNY	18.200	2.819
ING Groep NV 1,750 % fällig am 16.02.2031		1.500	1.705		Dominican Republic Government International Bond 5,500 % fällig am 22.02.2029	\$	2.600	2.438
United Kingdom Gilt 1,250 % fällig am 31.07.2051	£	1.700	1.607		Thailand Government International Bond 1,585 % fällig am 17.12.2035	THB	94.700	2.236
Prosus NV 3,257 % fällig am 19.01.2027	\$	1.600	1.600		China Development Bank 4,040 % fällig am 10.04.2027	CNY	13.200	2.180

(a) Der Global Advantage Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG		AKTIEN	KOSTEN (000S)
KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2022			
PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		99.261.574	\$ 987.929
		PARI (000S)	
Japan Government International Bond 0,005 % fällig am 20.06.2027	¥	48.796.000	354.221
Japan Government International Bond 0,005 % fällig am 20.03.2027		34.700.000	269.917
Singapore Government International Bond 1,625 % fällig am 01.07.2031	SGD	265.448	187.202
Israel Treasury Bills 0,000 % fällig am 08.02.2023	ILS	616.388	181.055
Ripon Mortgages PLC 4,011 % fällig am 28.08.2056	£	105.800	144.417
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 11.01.2023	¥	15.000.000	103.699
Singapore Government International Bond 2,875 % fällig am 01.09.2030	SGD	84.850	66.337
		AKTIEN	
PIMCO Global Investors Series PLC – Emerging Markets Opportunities Fund (a)		6.694.130	65.000
		PARI (000S)	
Thailand Government International Bond 1,585 % fällig am 17.12.2035	THB	2.670.500	59.446
China Government Bond 3,810 % fällig am 14.09.2050	CNY	324.100	54.596
Australia Government International Bond 4,500 % fällig am 21.04.2033	AUD	63.300	47.169
Malaysia Government International Bond 3,480 % fällig am 15.03.2023	MYR	200.400	42.568
U.S. Treasury Bonds 4,000 % fällig am 15.11.2052	\$	38.080	41.317
Freddie Mac 2,500 % fällig am 01.01.2052		44.681	40.689
Malaysia Government International Bond 3,900 % fällig am 30.11.2026	MYR	155.600	37.955
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 24.10.2022	¥	4.950.000	36.399
Malaysia Government International Bond 4,065 % fällig am 15.06.2050	MYR	156.400	34.270
U.S. Treasury Bonds 3,250 % fällig am 15.05.2042	\$	35.500	34.178
JPMorgan Chase & Co. 4,080 % fällig am 26.04.2026		33.800	33.800

BESCHREIBUNG		AKTIEN	ERLÖSE (000S)
VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2022			
PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		92.939.176	\$ 925.000
		PARI (000S)	
Japan Government International Bond 0,100 % fällig am 20.06.2031	¥	54.860.000	412.252
Japan Government International Bond 0,005 % fällig am 20.06.2027		48.796.000	355.245
Japan Government International Bond 0,005 % fällig am 20.03.2027		34.700.000	257.441
China Development Bank 3,680 % fällig am 26.02.2026	CNY	1.542.800	252.670
China Development Bank 4,040 % fällig am 10.04.2027		1.133.400	187.159
Singapore Government International Bond 1,625 % fällig am 01.07.2031	SGD	265.448	172.099
Japan Government International Bond 1,400 % fällig am 20.09.2034	¥	14.880.000	125.153
Japan Government International Bond 0,100 % fällig am 20.09.2031		15.395.550	118.591
Spain Government International Bond 1,400 % fällig am 30.07.2028	€	98.150	111.732
China Development Bank 4,240 % fällig am 24.08.2027	CNY	663.600	110.814
Nykredit Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK	1.025.310	105.041
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,850 % fällig am 01.07.2025	€	100.000	100.779
China Development Bank 3,050 % fällig am 25.08.2026	CNY	635.000	100.417
Australia Government International Bond 0,500 % fällig am 21.09.2026	AUD	143.300	99.909
China Development Bank 4,880 % fällig am 09.02.2028	CNY	573.400	91.035
Singapore Government International Bond 2,875 % fällig am 01.09.2030	SGD	119.970	86.747
		AKTIEN	
PIMCO ETFs plc – PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (a)		826.600	81.542
		PARI (000S)	
Malaysia Government Investment Issue 4,369 % fällig am 31.10.2028	MYR	330.020	74.129
Spain Government International Bond 0,850 % fällig am 30.07.2037	€	67.450	66.141

(a) Der Global Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Global Bond ESG Fund

31. Dezember 2022 (ungeprüft)

BESCHREIBUNG		PARI (000S)		KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG		PARI (000S)		ERLÖSE (000S)
KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2022					VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2022				
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 31.10.2022	¥	13.700.000	\$	102.543	Japan Government International Bond 0,005 % fällig am 20.06.2027	¥	11.281.000	\$	82.691
Japan Government International Bond 0,005 % fällig am 20.06.2027		11.281.000		81.886	Japan Government International Bond 0,100 % fällig am 20.06.2031		10.180.000		75.197
Bundesrepublik Deutschland 0,000 % fällig am 15.08.2031	€	53.800		61.360	Japan Government International Bond 0,005 % fällig am 20.03.2027		7.460.000		55.316
Japan Government International Bond 0,000 % fällig am 20.03.2027	¥	7.460.000		58.028	China Government Bond 3,020 % fällig am 22.10.2025	CNY	187.300		30.011
Uniform Mortgage-Backed Security 2,500 % fällig am 01.12.2051	\$	45.582		45.511	Singapore Government International Bond 1,625 % fällig am 01.07.2031	SGD	45.700		29.625
Israel Treasury Bills 0,000 % fällig am 08.02.2023	ILS	138.614		39.936	China Development Bank 4,240 % fällig am 24.08.2027	CNY	159.800		26.796
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 14.11.2022	¥	4.890.000		36.583	Japan Government International Bond 0,100 % fällig am 20.09.2031	¥	3.350.000		25.891
Singapore Government International Bond 1,625 % fällig am 01.07.2031	SGD	45.700		32.228	China Government Bond 2,680 % fällig am 21.05.2030	CNY	151.100		22.449
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 05.09.2022	¥	3.390.000		25.938	Singapore Government International Bond 2,875 % fällig am 01.09.2030	SGD	25.500		18.424
Deutsche Bank AG 3,961 % fällig am 26.11.2025	\$	27.600		25.511	China Government Bond 3,280 % fällig am 03.12.2027	CNY	93.900		15.356
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.01.2032 (a)		26.742		24.830	Japan Government International Bond 0,700 % fällig am 20.06.2051	¥	1.830.000		13.283
Ripon Mortgages PLC 4,011 % fällig am 28.08.2056	£	18.100		24.707	Thailand Government International Bond 1,585 % fällig am 17.12.2035	THB	528.100		12.474
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 27.06.2022	¥	2.850.000		24.068	Nykredit Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK	119.900		12.471
China Government Bond 2,680 % fällig am 21.05.2030	CNY	151.100		23.403	Malaysia Government Investment Issue 4,369 % fällig am 31.10.2028	MYR	49.500		11.306
Federal Home Loan Bank 4,320 % fällig am 06.01.2023	\$	22.700		22.700	China Development Bank 3,680 % fällig am 26.02.2026	CNY	67.600		11.070
Morgan Stanley 3,622 % fällig am 01.04.2031		23.800		20.344	China Government Bond 3,720 % fällig am 12.04.2051		66.700		10.124
Deutsche Bank AG 1,875 % fällig am 23.02.2028	€	16.400		18.570	China Government Bond 3,010 % fällig am 13.05.2028		62.300		9.927
Israel Government International Bond 1,500 % fällig am 30.11.2023	ILS	64.100		18.350	U.S. Treasury Bonds 3,250 % fällig am 15.05.2042	\$	9.000		8.623
Singapore Government International Bond 2,875 % fällig am 01.09.2030	SGD	19.600		15.323	BPCE S.A. 2,045 % fällig am 19.10.2027		9.600		8.610
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2031 (a)	\$	16.281		14.605	United Kingdom Gilt 0,875 % fällig am 31.07.2033	£	9.000		8.310

(a) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Global Bond Ex-US Fund

31. Dezember 2022 (ungeprüft)

BESCHREIBUNG			KOSTEN (000S)		BESCHREIBUNG			ERLÖSE (000S)
KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2022				AKTIEN	VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2022			
PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)					PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)			
			PARI (000S)				PARI (000S)	
Japan Government International Bond 0,005 % fällig am 20.06.2027	¥	4.698.000	33.930		Japan Government International Bond 0,100 % fällig am 20.06.2031	¥	6.180.000	45.765
Japan Government International Bond 0,005 % fällig am 20.03.2027		2.690.000	20.923		Japan Government International Bond 0,005 % fällig am 20.06.2027		4.698.000	34.377
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 24.10.2022		1.620.000	11.913		Japan Government International Bond 1,400 % fällig am 20.09.2034		3.220.000	25.342
Singapore Government International Bond 1,625 % fällig am 01.07.2031	SGD	16.400	11.566		China Development Bank 4,040 % fällig am 10.04.2027	CNY	152.020	24.931
China Development Bank 4,040 % fällig am 10.04.2027	CNY	60.800	10.159		China Development Bank 4,240 % fällig am 24.08.2027		152.200	22.501
Ripon Mortgages PLC 4,011 % fällig am 28.08.2056	£	7.300	9.965		Japan Government International Bond 0,005 % fällig am 20.03.2027	¥	2.690.000	19.958
Japan Government International Bond 0,100 % fällig am 20.09.2031	¥	680.000	5.860		China Development Bank 3,680 % fällig am 26.02.2026	CNY	113.900	18.604
Japan Government International Bond 0,700 % fällig am 20.09.2051		720.000	5.783		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,450 % fällig am 15.11.2024	€	13.100	13.226
China Government Bond 3,010 % fällig am 13.05.2028	CNY	35.900	5.760		Japan Government International Bond 0,100 % fällig am 20.09.2031	¥	1.650.000	12.799
France Government International Bond 2,250 % fällig am 25.10.2022	€	5.300	5.617		China Government Bond 3,030 % fällig am 11.03.2026	CNY	74.700	11.993
China Government Bond 3,810 % fällig am 14.09.2050	CNY	32.800	5.527		Singapore Government International Bond 1,625 % fällig am 01.07.2031	SGD	16.400	10.633
Singapore Government International Bond 2,875 % fällig am 01.09.2030	SGD	6.500	5.058		Spain Government International Bond 1,400 % fällig am 30.07.2028	€	9.200	10.473
Malaysia Government International Bond 3,480 % fällig am 15.03.2023	MYR	22.800	4.841		China Government Bond 3,280 % fällig am 03.12.2027	CNY	59.100	9.657
China Government Bond 3,530 % fällig am 18.10.2051	CNY	29.100	4.754		Australia Government International Bond 0,500 % fällig am 21.09.2026	AUD	10.400	7.249
Thailand Government International Bond 1,585 % fällig am 17.12.2035	THB	199.700	4.510		Singapore Government International Bond 2,875 % fällig am 01.09.2030	SGD	9.300	6.712
Thailand Government International Bond 2,000 % fällig am 17.12.2031		142.600	4.256		China Development Bank 4,880 % fällig am 09.02.2028	CNY	40.800	6.226
China Government Bond 2,680 % fällig am 21.05.2030	CNY	26.100	4.042		China Development Bank 3,500 % fällig am 13.08.2026		38.000	6.118
Genesis Mortgage Funding PLC 4,603 % fällig am 15.09.2059	£	3.100	3.876		Malaysia Government Investment Issue 4,369 % fällig am 31.10.2028	MYR	27.000	6.001
China Government Bond 2,370 % fällig am 20.01.2027	CNY	25.000	3.653		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,850 % fällig am 01.07.2025	€	5.600	5.637

(a) Der Global Bond Ex-US Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des PIMCO Global Core Asset Allocation Fund

31. Dezember 2022 (ungeprüft)

BESCHREIBUNG		AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG		AKTIEN	ERLÖSE (000S)
KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2022				VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2022			
PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		68.430.245	\$ 680.984	PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		67.799.972	\$ 674.753
		PARI (000S)		PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Mortgage Opportunities Fund (a)		12.863.704	131.853
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 11.01.2023	¥	8.378.000	57.920			PARI (000S)	
Colombian TES 6,250 % fällig am 26.11.2025	COP	85.411.000	18.552	Colombian TES 6,250 % fällig am 26.11.2025	COP	156.861.000	32.417
South Africa Government International Bond 10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR	239.700	15.413	Japan Government International Bond 0,100 % fällig am 20.09.2031	¥	4.000.000	29.942
South Africa Government International Bond 10,500 % fällig am 21.12.2026		220.300	14.522	South Africa Government International Bond 10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR	312.400	20.186
Bonos de la Tesorería de la República en Pesos 4,700 % fällig am 01.09.2030	CLP	10.780.000	12.037	China Government Bond 3,280 % fällig am 03.12.2027	CNY	121.340	19.113
Colombian TES 7,750 % fällig am 18.09.2030	COP	39.400.000	9.540	South Africa Government International Bond 10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR	180.550	13.289
Japan Government International Bond 1,700 % fällig am 20.09.2044	¥	600.000	5.185			AKTIEN	
		AKTIEN		Apple, Inc.		66.100	10.735
Activision Blizzard, Inc.		63.273	5.135			PARI (000S)	
		PARI (000S)		Nykredit Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK	42.959	5.777
Spain Government International Bond 0,700 % fällig am 30.04.2032	€	5.000	4.241	Bonos de la Tesorería de la República en Pesos 4,700 % fällig am 01.09.2030	CLP	5.580.000	5.311
South Africa Government International Bond 8,000 % fällig am 31.01.2030	ZAR	66.800	4.131	China Government Bond 2,850 % fällig am 04.06.2027	CNY	31.300	4.677
		AKTIEN				AKTIEN	
Airbus SE		35.755	4.071	Activision Blizzard, Inc.		58.575	4.354
Renewable Energy Group, Inc.		63.204	3.859			PARI (000S)	
First Horizon Corp.		161.653	3.847	Jyske Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK	31.892	4.294
LHC Group, Inc.		22.910	3.837			AKTIEN	
TEGNA, Inc.		168.148	3.831	Airbus SE		35.755	3.759
Alleghany Corp.		4.414	3.698			PARI (000S)	
Twitter, Inc.		70.963	3.561	South Africa Government International Bond 8,000 % fällig am 31.01.2030	ZAR	66.800	3.627
Regeneron Pharmaceuticals, Inc.		5.035	3.464	Peru Government International Bond 5,940 % fällig am 12.02.2029	PEN	13.700	3.602
Vertex Pharmaceuticals, Inc.		12.713	3.316	Nordea Kredit Realkreditaktieselskab 1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK	25.419	3.423
				Globalworth Real Estate Investments Ltd. 3,000 % fällig am 29.03.2025	€	3.200	3.375
				Peru Government International Bond 8,200 % fällig am 12.08.2026	PEN	9.100	2.673
				Peru Government International Bond 5,400 % fällig am 12.08.2034		13.200	2.666

(a) Der PIMCO Global Dividend Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Global High Yield Bond Fund

31. Dezember 2022 (ungeprüft)

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2022			VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2022		
PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	72.395.209	\$ 720.543	PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	93.243.437	\$ 928.065
	PARI (000S)			PARI (000S)	
U.S. Treasury Notes 3,875 % fällig am 30.11.2027	\$ 90.700	90.948	Sotera Health Holdings LLC 7,165 % fällig am 11.12.2026	\$ 25.000	24.725
U.S. Treasury Notes 4,125 % fällig am 31.10.2027	78.000	77.878	Kraft Heinz Foods Co. 5,200 % fällig am 15.07.2045	18.250	19.775
U.S. Treasury Notes 4,250 % fällig am 15.10.2025	58.000	57.480	Bellis Acquisition Co. PLC 3,250 % fällig am 16.02.2026	£ 12.375	12.261
U.S. Treasury Notes 3,500 % fällig am 15.09.2025	40.000	39.259	Sprint Corp. 7,125 % fällig am 15.06.2024	\$ 10.000	10.775
U.S. Treasury Notes 4,125 % fällig am 30.09.2027	20.000	19.798	Telecom Italia SpA 5,303 % fällig am 30.05.2024	10.500	10.471
Ctec GmbH 5,250 % fällig am 15.02.2030	€ 12.000	13.406	Ford Motor Credit Co. LLC 2,684 % fällig am 01.12.2024	€ 9.250	9.620
Royal Caribbean Cruises Ltd. 5,500 % fällig am 31.08.2026	\$ 10.000	8.604	Ardagh Packaging Finance PLC 4,125 % fällig am 15.08.2026	\$ 10.000	8.955
WP/AP Telecom Holdings BV 3,750 % fällig am 15.01.2029	€ 7.300	6.737	Freeport-McMoRan, Inc. 5,400 % fällig am 14.11.2034	7.625	8.741
Inter Media and Communication SpA 6,750 % fällig am 09.02.2027	6.000	6.689	Sigma Holdco BV 5,750 % fällig am 15.05.2026	€ 11.000	8.527
FIS Fabbrica Italiana Sintetici SpA 5,625 % fällig am 01.08.2027	5.800	6.622	WESCO Distribution, Inc. 7,125 % fällig am 15.06.2025	\$ 8.000	8.304
IMA Industria Macchine Automatiche SpA 3,750 % fällig am 15.01.2028	7.000	6.301		AKTIEN	
Cloud Software Group Holdings, Inc. 6,500 % fällig am 31.03.2029	\$ 7.000	5.935	Noble Corp.	231.945	7.328
ZF Europe Finance BV 3,000 % fällig am 23.10.2029	€ 5.600	5.365		PARI (000S)	
Trivium Packaging Finance BV 3,750 % fällig am 15.08.2026	5.000	5.007	Targa Resources Partners LP 5,500 % fällig am 01.03.2030	\$ 7.000	7.287
Tenet Healthcare Corp. 6,125 % fällig am 15.06.2030	\$ 5.000	5.000	MEG Energy Corp. 7,125 % fällig am 01.02.2027	7.000	7.139
Community Health Systems, Inc. 5,250 % fällig am 15.05.2030	5.000	5.000	Lloyds Banking Group PLC 7,625 % fällig am 27.06.2023	£ 5.000	6.856
Spirit Loyalty Cayman Ltd. 8,000 % fällig am 20.09.2025	5.000	4.984	T-Mobile USA, Inc. 2,875 % fällig am 15.02.2031	\$ 7.750	6.811
International Game Technology PLC 2,375 % fällig am 15.04.2028	€ 5.500	4.954	Targa Resources Partners LP 5,000 % fällig am 15.01.2028	6.500	6.652
ZF Finance GmbH 2,250 % fällig am 03.05.2028	5.000	4.952	Occidental Petroleum Corp. 6,600 % fällig am 15.03.2046	6.000	6.422
			IRB Holding Corp. 7,000 % fällig am 15.06.2025	6.000	6.248
			T-Mobile USA, Inc. 2,625 % fällig am 15.02.2029	7.000	6.230

(a) Der Global High Yield Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Global Investment Grade Credit Fund

31. Dezember 2022 (ungeprüft)

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2022			VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2022		
PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	374.868.009	\$ 3.730.320	PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	377.896.499	\$ 3.760.800
	PARI (000S)			PARI (000S)	
U.S. Treasury Bonds 1,875 % fällig am 15.11.2051	\$ 289.842	267.938	U.S. Treasury Notes 1,875 % fällig am 15.02.2032	\$ 259.218	236.426
U.S. Treasury Notes 1,875 % fällig am 15.02.2032	259.218	248.932	U.S. Treasury Notes 2,875 % fällig am 15.05.2032	236.574	232.005
U.S. Treasury Notes 2,875 % fällig am 15.05.2032	236.574	235.804	U.S. Treasury Bonds 1,875 % fällig am 15.11.2051	125.471	119.434
U.S. Treasury Notes 3,875 % fällig am 30.09.2029	206.000	205.712	Las Vegas Sands Corp. 3,200 % fällig am 08.08.2024	70.200	66.720
U.S. Treasury Bonds 2,000 % fällig am 15.11.2041	191.400	187.451	U.S. Treasury Bonds 2,875 % fällig am 15.05.2049	59.006	64.047
U.S. Treasury Bonds 3,250 % fällig am 15.05.2042	141.316	142.452	Boeing Co. 5,150 % fällig am 01.05.2030	65.394	62.833
U.S. Treasury Bonds 2,875 % fällig am 15.05.2052	137.600	131.597	U.S. Treasury Bonds 1,625 % fällig am 15.11.2050	60.000	47.991
U.S. Treasury Bonds 2,250 % fällig am 15.02.2052	70.400	58.995	U.S. Treasury Notes 3,375 % fällig am 15.11.2048	40.118	47.124
U.S. Treasury Bonds 2,375 % fällig am 15.02.2042	53.700	48.980	Wells Fargo & Co. 1,741 % fällig am 04.05.2030	€ 37.400	40.531
Australia Government International Bond 4,500 % fällig am 21.04.2033	AUD 59.700	44.373	U.S. Treasury Bonds 1,875 % fällig am 15.02.2041	\$ 42.300	36.845
South Africa Government International Bond 10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR 455.600	33.323	Goldman Sachs Group, Inc. 0,000 % fällig am 05.06.2023	34.000	34.084
Bank of America Corp. 2,551 % fällig am 04.02.2028	\$ 26.100	26.100	Amber Circle Funding Ltd. 3,250 % fällig am 04.12.2022	33.625	33.599
U.S. Treasury Bonds 3,125 % fällig am 15.08.2044	25.700	22.010	Foxconn Far East Ltd. 1,625 % fällig am 28.10.2025	34.200	32.602
Societe Generale S.A. 2,889 % fällig am 09.06.2032	25.000	20.396	Vanke Real Estate Hong Kong Co. Ltd. 4,150 % fällig am 18.04.2023	31.600	31.610
Holdering d'Infrastructures de Transport SASU 1,475 % fällig am 18.01.2031	€ 16.200	18.197	U.S. Treasury Bonds 3,000 % fällig am 15.02.2048	28.400	30.678
Goldman Sachs Group, Inc. 4,482 % fällig am 23.08.2028	\$ 17.300	17.300	Wynn Macau Ltd. 5,500 % fällig am 01.10.2027	37.265	30.463
Wells Fargo & Co. 4,897 % fällig am 25.07.2033	15.000	15.198	Cornerstone Building Brands, Inc. 7,568 % fällig am 12.04.2028	33.264	28.301
BNP Paribas S.A. 5,198 % fällig am 10.01.2030	15.000	15.160	CaixaBank S.A. 5,875 % fällig am 09.10.2027	€ 31.000	27.985
Oracle Corp. 6,250 % fällig am 09.11.2032	14.500	14.474	United Airlines Pass-Through Trust 5,875 % fällig am 15.04.2029	\$ 27.226	27.601

(a) Der Global Investment Grade Credit Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Global Investment Grade Credit ESG Fund

31. Dezember 2022 (ungeprüft)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	ERLÖSE (000S)
KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2022			VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2022		
U.S. Treasury Bonds 2,375 % fällig am 15.02.2042	\$ 57.200	\$ 54.814	Amgen, Inc. 3,000 % fällig am 22.02.2029	\$ 6.600	\$ 6.059
U.S. Treasury Bonds 3,250 % fällig am 15.05.2042	45.000	44.484	Illumina, Inc. 2,550 % fällig am 23.03.2031	7.650	5.982
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.07.2032 (a)	30.774	29.191	Baxter International, Inc. 2,272 % fällig am 01.12.2028	7.000	5.777
U.S. Treasury Bonds 4,000 % fällig am 15.11.2042	23.300	23.491	Equinix, Inc. 1,550 % fällig am 15.03.2028	6.700	5.623
U.S. Treasury Notes 4,250 % fällig am 15.10.2025	21.700	21.515	Autonomous Community of Madrid 1,723 % fällig am 30.04.2032	€ 6.000	5.598
U.S. Treasury Bonds 2,000 % fällig am 15.11.2041	19.600	19.127	BNP Paribas S.A. 1,675 % fällig am 30.06.2027	\$ 6.000	5.246
Bundesrepublik Deutschland 0,000 % fällig am 15.08.2031	€ 14.700	15.455	Banco do Brasil S.A. 4,875 % fällig am 11.01.2029	5.000	4.865
Bank of America Corp. 3,384 % fällig am 02.04.2026	\$ 11.900	11.896	Crown Castle International Corp. 4,300 % fällig am 15.02.2029	4.800	4.620
U.S. Treasury Bonds 3,375 % fällig am 15.08.2042	12.300	11.799	Union Electric Co. 3,900 % fällig am 01.04.2052	5.700	4.403
Europäische Union 2,750 % fällig am 04.12.2037	€ 10.000	10.482	Nucor Corp. 3,950 % fällig am 23.05.2025	4.400	4.370
Canada Government International Bond 2,250 % fällig am 01.12.2029	CAD 12.200	9.637	Georgia Power Co. 3,250 % fällig am 15.03.2051	5.730	4.232
GSK Consumer Healthcare Capital U.S. LLC 3,375 % fällig am 24.03.2029	\$ 9.050	8.954	LeasePlan Corp. NV 0,750 % fällig am 03.10.2022	€ 4.100	4.221
Europäische Union 1,250 % fällig am 04.02.2043	€ 8.000	8.556	Equinix, Inc. 3,900 % fällig am 15.04.2032	\$ 4.500	4.163
Corebridge Financial, Inc. 3,900 % fällig am 05.04.2032	\$ 8.200	8.166	Bank of America Corp. 3,384 % fällig am 02.04.2026	4.100	3.920
Wells Fargo & Co. 4,540 % fällig am 15.08.2026	7.800	7.800	Welltower, Inc. 3,850 % fällig am 15.06.2032	4.500	3.902
Zoetis, Inc. 2,000 % fällig am 15.05.2030	8.500	7.648	Morgan Stanley 4,210 % fällig am 20.04.2028	4.000	3.898
Mizuho Financial Group, Inc. 2,839 % fällig am 13.09.2026	8.261	7.558	Vmed O2 UK Financing PLC 4,750 % fällig am 15.07.2031	4.900	3.834
S&P Global, Inc. 2,700 % fällig am 01.03.2029	7.500	7.444	Woolworths Group Ltd. 0,375 % fällig am 15.11.2028	€ 4.800	3.796
Welltower, Inc. 3,850 % fällig am 15.06.2032	7.400	7.396	Ford Motor Co. 6,100 % fällig am 19.08.2032	\$ 4.074	3.764
Autonomous Community of Madrid 1,723 % fällig am 30.04.2032	€ 6.000	6.699	PacifiCorp 2,900 % fällig am 15.06.2052	5.100	3.706

(a) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Global Low Duration Real Return Fund

31. Dezember 2022 (ungeprüft)

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2022			VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2022		
PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	22.764.320	\$ 226.560	PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	22.757.745	\$ 226.500
	PARI (000S)			PARI (000S)	
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2026 (b)	\$ 72.582	71.948	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.01.2023 (b)	\$ 85.413	88.401
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,500 % fällig am 15.01.2028 (b)	71.161	70.182	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.04.2023 (b)	72.960	73.636
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,375 % fällig am 15.01.2027 (b)	60.029	57.494	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2031 (b)	50.303	52.878
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,250 % fällig am 15.01.2025 (b)	50.871	50.019	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.10.2026 (b)	33.151	32.690
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,375 % fällig am 15.07.2025 (b)	47.246	46.626	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2022 (b)	29.519	29.799
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2027 (b)	39.855	40.094	United Kingdom Gilt 2,500 % fällig am 17.07.2024	£ 5.330	26.551
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,375 % fällig am 15.07.2027 (b)	41.216	39.819	United Kingdom Gilt 0,625 % fällig am 07.06.2025	23.000	24.918
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.10.2026 (b)	37.509	39.698	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.01.2030 (b)	\$ 21.410	21.103
United Kingdom Gilt 1,250 % fällig am 22.11.2027	£ 28.850	37.973	Japan Government International Bond 0,100 % fällig am 10.03.2029	¥ 2.410.825	19.848
United Kingdom Gilt 0,125 % fällig am 22.03.2024	27.117	35.658	Nykredit Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK 156.847	18.724
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.10.2025 (b)	\$ 33.585	33.817	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2027 (b)	\$ 18.879	18.339
Bundesrepublik Deutschland 0,500 % fällig am 15.04.2030	€ 24.119	26.174	France Government International Bond 1,100 % fällig am 25.07.2022	€ 15.621	17.937
United Kingdom Gilt 0,625 % fällig am 07.06.2025	£ 23.000	24.814	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,400 % fällig am 15.05.2030	14.860	16.922
Japan Government International Bond 0,100 % fällig am 10.03.2029	¥ 2.633.176	20.010	France Government International Bond 0,250 % fällig am 25.07.2024	11.176	13.595
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,625 % fällig am 15.10.2027 (b)	\$ 19.436	19.618	United Kingdom Gilt 1,875 % fällig am 22.11.2022	£ 8.496	11.905
Bundesrepublik Deutschland 0,100 % fällig am 15.04.2026	€ 17.938	19.042	Nykredit Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK 95.496	11.484
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.01.2024 (b)	\$ 19.077	18.665	France Government International Bond 0,100 % fällig am 01.03.2029	€ 8.887	10.947
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2024 (b)	18.337	18.408	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2022 (b)	\$ 7.947	8.105
Bundesrepublik Deutschland 0,100 % fällig am 15.04.2023	€ 15.366	17.897	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2025 (b)	7.771	8.049
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,500 % fällig am 15.04.2024 (b)	\$ 14.093	13.815			
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.04.2023 (b)	13.516	13.726			
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2026 (b)	12.914	12.253			

(a) Der Global Low Duration Real Return Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Global Real Return Fund

31. Dezember 2022 (ungeprüft)

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2022			VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2022		
PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	82.239.295	\$ 818.334	PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	81.551.060	\$ 811.500
	PARI (000S)	KOSTEN (000S)		PARI (000S)	ERLÖSE (000S)
United Kingdom Gilt 1,250 % fällig am 22.11.2027	£ 62.876	97.572	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,400 % fällig am 15.05.2030	€ 130.161	146.092
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,500 % fällig am 15.01.2028 (b)	\$ 92.730	87.822	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2022 (b)	\$ 143.743	144.466
United Kingdom Gilt 0,125 % fällig am 10.08.2031	£ 46.677	81.837	United Kingdom Gilt 1,250 % fällig am 22.11.2027	£ 72.678	118.474
United Kingdom Gilt 1,000 % fällig am 22.04.2024	71.300	77.919	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2031 (b)	\$ 107.962	112.982
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,625 % fällig am 15.10.2027 (b)	\$ 64.795	65.341	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.01.2023 (b)	83.793	83.931
United Kingdom Gilt 0,750 % fällig am 22.03.2034	£ 36.701	65.288	United Kingdom Gilt 1,000 % fällig am 22.04.2024	£ 71.300	78.111
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,100 % fällig am 15.05.2033	€ 53.703	62.306	United Kingdom Gilt 1,250 % fällig am 22.11.2032	44.759	71.651
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.01.2032 (b)	\$ 52.620	55.455	United Kingdom Gilt 0,125 % fällig am 10.08.2031	50.673	66.942
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,375 % fällig am 15.07.2025 (b)	42.994	42.671	France Government International Bond 0,250 % fällig am 25.07.2024	€ 50.229	59.104
France Government International Bond 0,100 % fällig am 25.07.2031	€ 29.839	37.828	France Government International Bond 0,100 % fällig am 01.03.2029	51.980	57.230
France Government International Bond 0,500 % fällig am 25.05.2029	37.500	36.298	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.01.2031 (b)	\$ 52.729	57.107
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.04.2023 (b)	\$ 32.637	33.892	France Government International Bond 0,700 % fällig am 25.07.2030	€ 43.364	53.525
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.01.2023 (b)	30.621	31.542	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,100 % fällig am 15.05.2033	56.182	50.300
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,350 % fällig am 01.04.2030	€ 33.900	30.488	France Government International Bond 0,100 % fällig am 25.07.2031	42.407	46.184
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2027 (b)	\$ 26.914	27.703	Realkredit Danmark A/S 1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK 303.000	38.198
Japan Government International Bond 0,100 % fällig am 10.03.2029	¥ 3.246.046	24.314	Japan Government International Bond 0,100 % fällig am 10.03.2028	¥ 4.536.453	36.947
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.10.2025 (b)	\$ 23.423	23.877	France Government International Bond 0,500 % fällig am 25.05.2029	€ 37.500	36.502
United Kingdom Gilt 0,125 % fällig am 22.03.2068	£ 12.200	23.273	Nykredit Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK 294.532	35.428
United Kingdom Gilt 0,125 % fällig am 10.08.2041	22.496	20.077	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,350 % fällig am 01.04.2030	€ 33.900	30.409
			Japan Government International Bond 0,100 % fällig am 10.03.2029	¥ 3.338.216	29.264

(a) Der Global Real Return Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
KAUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2022			VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2022		
PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	113.834.811	\$ 1.132.782	PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	186.497.216	\$ 1.856.000
	PARI (000S)	KOSTEN (000S)		PARI (000S)	ERLÖSE (000S)
Ripon Mortgages PLC			U.S. Treasury Notes		
4,011 % fällig am 28.08.2056	£ 610.000	832.651	3,875 % fällig am 30.09.2029	\$ 819.800	811.244
U.S. Treasury Notes			U.S. Treasury Bonds		
3,875 % fällig am 30.09.2029	\$ 819.800	818.655	1,375 % fällig am 15.08.2050	1.080.000	750.416
U.S. Treasury Notes			U.S. Treasury Notes		
2,750 % fällig am 15.08.2032	832.400	752.898	1,125 % fällig am 15.02.2031	439.881	382.940
U.S. Treasury Inflation Protected Securities			U.S. Treasury Notes		
0,625 % fällig am 15.01.2024 (b)	698.578	685.318	2,625 % fällig am 31.01.2026	381.000	378.655
U.S. Treasury Notes			Uniform Mortgage-Backed Security		
4,000 % fällig am 31.10.2029	592.900	591.932	4,000 % fällig am 01.03.2049	321.901	326.629
Fannie Mae			U.S. Treasury Bonds		
3,000 % fällig am 01.06.2052	683.955	587.591	1,250 % fällig am 15.05.2050	500.000	320.000
U.S. Treasury Inflation Protected Securities			Freddie Mac		
0,125 % fällig am 15.07.2024 (b)	560.307	545.565	3,500 % fällig am 01.07.2052	278.339	269.293
U.S. Treasury Bonds			China Development Bank		
1,375 % fällig am 15.08.2050	830.000	539.500	3,740 % fällig am 10.09.2025	CNY 1.530.900	249.049
U.S. Treasury Inflation Protected Securities			U.S. Treasury Bonds		
0,375 % fällig am 15.07.2023 (b)	533.195	528.822	2,250 % fällig am 15.08.2046	\$ 250.000	243.906
U.S. Treasury Inflation Protected Securities			U.S. Treasury Inflation Protected Securities		
0,500 % fällig am 15.04.2024 (b)	512.645	500.687	0,250 % fällig am 15.07.2029 (b)	212.266	221.351
Freddie Mac			Fannie Mae		
3,000 % fällig am 01.07.2052	560.510	498.500	4,000 % fällig am 01.08.2051	213.588	220.212
U.S. Treasury Inflation Protected Securities			U.S. Treasury Bonds		
0,625 % fällig am 15.07.2032 (b)	495.993	467.240	2,250 % fällig am 15.02.2052	260.620	215.500
Fannie Mae			Freddie Mac		
3,500 % fällig am 01.05.2052	510.123	464.969	3,000 % fällig am 01.06.2052	207.754	192.951
U.S. Treasury Inflation Protected Securities			Peru Government International Bond		
0,125 % fällig am 15.10.2024 (b)	376.263	364.402	6,150 % fällig am 12.08.2032	PEN 759.959	178.463
Intelsat Jackson Holdings S.A.			Fannie Mae		
6,500 % fällig am 25.01.2030	337.627	329.186	4,000 % fällig am 01.10.2051	\$ 169.263	174.512
Freddie Mac			China Development Bank		
3,500 % fällig am 01.07.2052	334.012	325.027	2,890 % fällig am 22.06.2025	CNY 1.048.500	166.075
Freddie Mac			Fannie Mae		
3,000 % fällig am 01.06.2052	344.996	319.504	3,500 % fällig am 01.05.2052	\$ 171.559	165.984
U.S. Treasury Bonds			Freddie Mac		
1,250 % fällig am 15.05.2050	500.000	314.063	3,000 % fällig am 01.07.2052	174.833	162.376
U.S. Treasury Notes			China Development Bank		
2,875 % fällig am 15.05.2032	248.790	248.739	4,150 % fällig am 26.10.2025	CNY 933.800	154.016
Fannie Mae					
4,000 % fällig am 01.08.2051	226.482	239.646			
Uniform Mortgage-Backed Security					
3,000 % fällig am 01.08.2052	279.250	237.340			
U.S. Treasury Notes					
2,375 % fällig am 31.03.2029	224.600	222.822			
U.S. Treasury Bonds					
2,250 % fällig am 15.02.2052	260.620	211.794			
Carvana Co.					
10,250 % fällig am 01.05.2030	204.910	203.253			
Japan Government International Bond					
0,100 % fällig am 01.03.2023	¥ 27.972.000	201.670			
Fannie Mae					
4,000 % fällig am 01.10.2051	\$ 177.478	187.794			

(a) Der Income Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
KAUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2022			VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2022		
PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	1.581.831	\$ 15.740	PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	1.678.252	\$ 16.700
	PARI (000S)			PARI (000S)	
U.S. Treasury Notes 3,125 % fällig am 15.08.2025	\$ 7.500	7.448	U.S. Treasury Notes 2,750 % fällig am 15.08.2032	\$ 5.500	5.368
U.S. Treasury Notes 2,750 % fällig am 15.08.2032	5.500	5.378	Fannie Mae 4,000 % fällig am 01.03.2051	688	709
U.S. Treasury Notes 4,125 % fällig am 15.11.2032	3.600	3.692	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.07.2032 (b)	714	662
U.S. Treasury Notes 2,750 % fällig am 15.05.2025	2.500	2.508	U.S. Treasury Notes 4,125 % fällig am 15.11.2032	600	629
Harbour Energy PLC 5,044 % fällig am 28.01.2054	£ 2.000	2.149	U.S. Treasury Bonds 3,250 % fällig am 15.05.2042	600	581
Fannie Mae 3,500 % fällig am 01.05.2052	\$ 1.892	1.815	Morgan Stanley Home Equity Loan Trust 4,899 % fällig am 25.02.2036	427	400
Uniform Mortgage-Backed Security 3,000 % fällig am 01.08.2052	1.894	1.765	Kinbane DAC 2,744 % fällig am 25.09.2062	€ 400	386
U.S. Treasury Notes 4,000 % fällig am 31.10.2029	1.700	1.719	Freddie Mac 4,000 % fällig am 01.05.2049	\$ 268	276
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.07.2032 (b)	1.428	1.316	U.S. Treasury Notes 0,875 % fällig am 15.11.2030	300	254
Jupiter Mortgage PLC 6,676 % fällig am 20.07.2060	£ 900	1.002	Community Health Systems, Inc. 6,125 % fällig am 01.04.2030	400	248
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.01.2024 (b)	\$ 725	712	T-Mobile USA, Inc. 3,500 % fällig am 15.04.2031	250	222
U.S. Treasury Notes 3,875 % fällig am 30.09.2029	700	699	Specialty Underwriting & Residential Finance Trust 2,794 % fällig am 25.12.2035	200	195
Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust 4,679 % fällig am 25.07.2036	661	664	U.S. Renal Care, Inc. 10,625 % fällig am 15.07.2027	390	187
Structured Asset Investment Loan Trust 5,364 % fällig am 25.05.2035	711	663	Boeing Co. 5,705 % fällig am 01.05.2040	190	184
Home Equity Asset Trust 5,049 % fällig am 25.04.2036	737	663	Imperial Brands Finance Netherlands BV 1,750 % fällig am 18.03.2033	€ 210	151
First Franklin Mortgage Loan Trust 4,129 % fällig am 25.03.2036	731	663	Magallanes, Inc. 4,054 % fällig am 15.03.2029	\$ 150	138
Morgan Stanley Capital, Inc. Trust 4,944 % fällig am 25.01.2036	900	659	Deutsche Bank AG 4,625 % fällig am 30.10.2027	€ 200	132
U.S. Treasury Bonds 3,250 % fällig am 15.05.2042	600	610	Peru Government International Bond 6,900 % fällig am 12.08.2037	PEN 200	45
New Century Home Equity Loan Trust 5,124 % fällig am 25.10.2035	700	603	Petroleos Mexicanos 6,950 % fällig am 28.01.2060	\$ 60	38

(a) Der Income Fund II legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Low Average Duration Fund

31. Dezember 2022 (ungeprüft)

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2022			VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2022		
PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	52.138.023	\$ 518.809	PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	54.840.016	\$ 545.700
	PARI (000S)			PARI (000S)	
U.S. Treasury Notes 0,875 % fällig am 31.01.2024	\$ 244.100	240.906	Toronto-Dominion Bank 2,350 % fällig am 08.03.2024	\$ 11.400	11.016
U.S. Treasury Notes 1,500 % fällig am 29.02.2024	190.000	190.109	Morgan Stanley 2,630 % fällig am 18.02.2026	10.700	10.134
U.S. Treasury Notes 4,375 % fällig am 31.10.2024	88.200	88.149	South Africa Government International Bond 10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR 176.300	10.008
South Africa Government International Bond 10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR 176.300	12.622	Citigroup, Inc. 3,290 % fällig am 17.03.2026	\$ 7.700	7.360
Toronto-Dominion Bank 2,350 % fällig am 08.03.2024	\$ 11.400	11.390	Rogers Communications, Inc. 2,950 % fällig am 15.03.2025	7.600	7.278
Morgan Stanley 2,630 % fällig am 18.02.2026	10.700	10.700	Volkswagen Financial Services NV 1,625 % fällig am 30.11.2022	£ 5.800	6.921
Ginnie Mae 4,996 % fällig am 20.11.2072	9.402	9.395	South Africa Government International Bond 10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR 110.000	6.245
Ginnie Mae 4,986 % fällig am 20.11.2072	8.300	8.293	Goldman Sachs Group, Inc. 3,000 % fällig am 15.03.2024	\$ 5.000	4.909
Goldman Sachs Group, Inc. 3,000 % fällig am 15.03.2024	8.300	8.293	Morgan Stanley 3,620 % fällig am 17.04.2025	5.000	4.884
Fannie Mae 3,000 % fällig am 01.04.2052	8.200	8.033	Regatta Funding Ltd. 5,329 % fällig am 17.10.2030	4.600	4.573
Ripon Mortgages PLC 4,011 % fällig am 28.08.2056	£ 5.800	7.917	Peru Government International Bond 8,200 % fällig am 12.08.2026	PEN 17.000	4.405
Uniform Mortgage-Backed Security 3,000 % fällig am 01.02.2052	\$ 7.789	7.914	Citigroup, Inc. 4,140 % fällig am 24.05.2025	\$ 4.000	4.035
Citigroup, Inc. 3,290 % fällig am 17.03.2026	7.700	7.700	Canadian Imperial Bank of Commerce 3,300 % fällig am 07.04.2025	4.100	3.965
South Africa Government International Bond 10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR 110.000	7.681	General Motors Financial Co., Inc. 3,800 % fällig am 07.04.2025	4.000	3.947
Rogers Communications, Inc. 2,950 % fällig am 15.03.2025	\$ 7.600	7.595	International Business Machines Corp. 4,000 % fällig am 27.07.2025	4.000	3.896
Fortress Investment Group LLC 5,761 % fällig am 23.02.2039	7.200	7.155	Capital One Financial Corp. 2,636 % fällig am 03.03.2026	4.100	3.842
Morgan Stanley 3,620 % fällig am 17.04.2025	5.000	5.000	GoldenTree Loan Opportunities Ltd. 2,349 % fällig am 29.10.2029	3.839	3.817
Regatta Funding Ltd. 5,329 % fällig am 17.10.2030	4.600	4.589	Madison Park Funding Ltd. 4,829 % fällig am 15.04.2029	3.850	3.804
Commercial Mortgage Trust 3,147 % fällig am 15.08.2045	4.519	4.523	Bank of America Corp. 3,384 % fällig am 02.04.2026	4.000	3.801

(a) Der Low Average Duration Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Low Duration Global Investment Grade Credit Fund

31. Dezember 2022 (ungeprüft)

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2022			VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2022		
PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	26.190.692	\$ 260.619	PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	34.006.764	\$ 338.400
	PARI (000S)			PARI (000S)	
U.S. Treasury Notes 4,375 % fällig am 31.10.2024	\$ 23.100	23.105	U.S. Treasury Notes 1,500 % fällig am 29.02.2024	\$ 20.500	19.897
U.S. Treasury Notes 4,250 % fällig am 15.10.2025	20.900	20.737	U.S. Treasury Notes 0,125 % fällig am 31.08.2023	15.800	15.266
U.S. Treasury Notes 1,500 % fällig am 29.02.2024	20.500	20.495	U.S. Treasury Notes 0,125 % fällig am 31.07.2023	8.200	7.953
U.S. Treasury Notes 2,250 % fällig am 31.03.2024	12.100	11.999	U.S. Treasury Notes 0,125 % fällig am 30.06.2023	7.900	7.692
South Africa Government International Bond 10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR 139.500	10.408	U.S. Treasury Notes 0,625 % fällig am 31.07.2026	5.200	4.964
U.S. Treasury Notes 3,500 % fällig am 15.09.2025	\$ 6.700	6.579	U.S. Treasury Notes 0,750 % fällig am 30.04.2026	3.800	3.616
U.S. Treasury Notes 4,000 % fällig am 15.12.2025	6.100	6.097	Goldman Sachs Group, Inc. 3,375 % fällig am 27.03.2025	€ 3.100	3.575
GSK Consumer Healthcare Capital NL BV 1,250 % fällig am 29.03.2026	€ 3.700	4.070	U.S. Treasury Notes 0,750 % fällig am 31.08.2026	\$ 3.500	3.358
Energy Transfer LP 5,550 % fällig am 15.02.2028	\$ 4.000	3.997	U.S. Treasury Notes 0,875 % fällig am 30.09.2026	3.500	3.345
eBay, Inc. 5,900 % fällig am 22.11.2025	4.000	3.995	Banco BTG Pactual S.A. 5,500 % fällig am 31.01.2023	3.200	3.233
Duke Energy Corp. 5,000 % fällig am 08.12.2025	3.800	3.799	Goldman Sachs Group, Inc. 3,000 % fällig am 15.03.2024	3.200	3.148
Weir Group PLC 2,200 % fällig am 13.05.2026	3.800	3.626	Morgan Stanley 0,637 % fällig am 26.07.2024	€ 2.800	3.079
Volkswagen Financial Services NV 5,500 % fällig am 07.12.2026	£ 3.000	3.602	Equifax, Inc. 5,100 % fällig am 15.12.2027	\$ 3.100	3.047
Banque Federative du Credit Mutuel S.A. 4,875 % fällig am 25.09.2025	3.000	3.552	U.S. Treasury Notes 0,750 % fällig am 31.05.2026	3.200	3.026
Societe Generale S.A. 4,677 % fällig am 15.06.2027	\$ 3.500	3.500	UBS Group AG 4,125 % fällig am 24.09.2025	3.000	2.967
Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd. 3,800 % fällig am 15.09.2022	3.300	3.339	Contemporary Ruiding Development Ltd. 1,500 % fällig am 09.09.2026	3.300	2.933
American Medical Systems Europe BV 0,750 % fällig am 08.03.2025	€ 3.000	3.318	Dell Bank International DAC 0,500 % fällig am 27.10.2026	€ 3.300	2.763
Nykredit Realkredit A/S 1,375 % fällig am 12.07.2027	3.000	3.304	Sinopec Group Overseas Development Ltd. 2,500 % fällig am 13.09.2022	\$ 2.600	2.598
Protective Life Global Funding 4,714 % fällig am 06.07.2027	\$ 3.300	3.300	Industrial & Commercial Bank of China Ltd. 1,000 % fällig am 20.07.2023	2.500	2.461

(a) Der Low Duration Global Investment Grade Credit Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Low Duration Income Fund

31. Dezember 2022 (ungeprüft)

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2022			VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2022		
PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	11.901.396	\$ 118.420	PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	14.535.746	\$ 144.620
	PARI (000S)			PARI (000S)	
U.S. Treasury Notes 2,375 % fällig am 31.03.2029	\$ 25.000	24.802	U.S. Treasury Notes 3,875 % fällig am 30.09.2029	\$ 15.200	15.042
Temple Quay PLC 0,000 % fällig am 24.07.2085	£ 17.600	20.254	Scientific Games International, Inc. 1,000 % fällig am 14.08.2024	10.696	10.696
Canada Square Funding PLC 3,735 % fällig am 17.01.2059	12.788	15.707	U.S. Treasury Notes 1,125 % fällig am 15.02.2031	11.649	10.142
U.S. Treasury Notes 3,875 % fällig am 30.09.2029	\$ 15.200	15.179	U.S. Treasury Notes 2,375 % fällig am 31.03.2029	9.400	9.091
Credit Suisse Mortgage Capital Trust 6,218 % fällig am 15.07.2032	15.277	15.049	Dufry One BV 2,500 % fällig am 15.10.2024	€ 8.142	8.365
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.01.2024 (b)	12.579	12.340	CTP NV 0,625 % fällig am 27.09.2026	7.400	8.002
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2024 (b)	10.170	9.903	Magallanes, Inc. 3,788 % fällig am 15.03.2025	\$ 7.700	7.588
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,375 % fällig am 15.07.2023 (b)	9.648	9.569	Hilton Domestic Operating Co., Inc. 3,750 % fällig am 01.05.2029	8.800	7.545
Dufry One BV 2,500 % fällig am 15.10.2024	€ 8.142	9.157	Seagate HDD Cayman 3,375 % fällig am 15.07.2031	9.300	7.468
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,500 % fällig am 15.04.2024 (b)	\$ 9.157	8.943	Kraft Heinz Foods Co. 3,875 % fällig am 15.05.2027	7.513	7.375
HSI Asset Securitization Corp. Trust 4,529 % fällig am 25.12.2036	9.763	8.457	Pacific Gas & Electric Co. 3,250 % fällig am 16.02.2024	5.800	5.727
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.07.2032 (b)	8.974	8.454	Nissan Motor Co. Ltd. 2,652 % fällig am 17.03.2026	€ 3.993	4.756
Lehman XS Trust 4,789 % fällig am 25.08.2046	8.453	7.836	VMware, Inc. 4,700 % fällig am 15.05.2030	\$ 4.900	4.686
Magallanes, Inc. 3,788 % fällig am 15.03.2025	7.700	7.700	Barclays PLC 4,375 % fällig am 15.03.2028	5.800	4.676
Kinbane DAC 2,744 % fällig am 25.09.2062	€ 7.300	7.146	CommScope, Inc. 8,250 % fällig am 01.03.2027	4.900	4.330
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.10.2024 (b)	\$ 6.841	6.625	Pacific Gas & Electric Co. 4,250 % fällig am 01.08.2023	3.699	3.718
U.S. Treasury Notes 2,875 % fällig am 15.05.2032	6.600	6.599	Intercontinental Exchange, Inc. 3,650 % fällig am 23.05.2025	3.650	3.619
Harbour Energy PLC 3,844 % fällig am 28.01.2054	£ 5.284	6.506	Wynn Resorts Finance LLC 7,750 % fällig am 15.04.2025	3.493	3.470
Asset-Backed Securities Corp. Home Equity Loan Trust 3,479 % fällig am 25.05.2036	\$ 6.856	6.350	280 Park Avenue Mortgage Trust 5,117 % fällig am 15.09.2034	3.300	3.233
Pacific Gas & Electric Co. 3,250 % fällig am 16.02.2024	5.800	5.798			
Uber Technologies, Inc. 7,500 % fällig am 15.05.2025	5.100	5.334			

(a) Der Low Duration Income Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Low Duration Opportunities Fund

31. Dezember 2022 (ungeprüft)

BESCHREIBUNG		AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG		AKTIEN	ERLÖSE (000S)
KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2022				VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2022			
PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		46.609.421	\$ 463.691	PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		64.292.324	\$ 639.601
		PARI (000S)				PARI (000S)	
Stratton BTL Mortgage Funding 3,656 % fällig am 20.01.2054	£	11.200	15.181	U.S. Treasury Notes 2,375 % fällig am 31.01.2023	\$	65.900	65.604
Palmer Square European Loan Funding DAC 2,098 % fällig am 15.10.2031	€	10.000	11.418	U.S. Treasury Notes 0,750 % fällig am 31.03.2026		50.600	47.973
Boston Scientific Corp. 2,650 % fällig am 01.06.2030	\$	11.600	10.637	U.S. Treasury Notes 2,000 % fällig am 30.11.2022		26.940	26.879
U.S. Treasury Notes 1,375 % fällig am 15.11.2031		10.200	9.813	U.S. Treasury Notes 2,125 % fällig am 31.05.2026		23.200	23.579
Wells Fargo & Co. 3,526 % fällig am 24.03.2028		8.500	8.500	U.S. Treasury Notes 1,375 % fällig am 31.10.2028		21.900	21.128
Sasol Financing USA LLC 5,875 % fällig am 27.03.2024		8.200	8.496	U.S. Treasury Notes 1,875 % fällig am 31.07.2026		17.700	17.777
Harmony French Home Loans 2,558 % fällig am 27.05.2062	€	7.500	8.412	Boston Scientific Corp. 2,650 % fällig am 01.06.2030		18.300	16.292
Madison Park Funding Ltd. 4,829 % fällig am 15.04.2029	\$	8.017	7.956	U.S. Treasury Notes 0,875 % fällig am 30.06.2026		16.400	15.704
Deutsche Bank AG 6,119 % fällig am 14.07.2026		7.700	7.700	Dryden Euro CLO DAC 2,622 % fällig am 15.05.2034	€	11.700	11.015
JPMorgan Chase & Co. 2,947 % fällig am 24.02.2028		7.400	7.400	BNP Paribas S.A. 2,871 % fällig am 19.04.2032	\$	14.400	10.895
Sound Point CLO Ltd. 5,344 % fällig am 18.04.2031		7.400	7.388	Standard Chartered PLC 2,819 % fällig am 30.01.2026		11.100	10.149
Southern California Edison Co. 2,750 % fällig am 01.02.2032		7.900	7.265	U.S. Treasury Notes 1,375 % fällig am 15.11.2031		10.200	9.842
Barley Hill PLC 4,352 % fällig am 27.08.2058	£	5.200	7.082	Palmer Square European Loan Funding DAC 2,098 % fällig am 15.10.2031	€	9.929	9.409
Carbone CLO Ltd. 5,383 % fällig am 20.01.2031	\$	6.931	6.909	Harvest CLO DAC 0,640 % fällig am 15.10.2031		9.600	9.159
Bank of America Corp. 3,384 % fällig am 02.04.2026		6.800	6.800	Aqueduct European CLO DAC 2,096 % fällig am 20.07.2030		8.916	8.608
Citigroup, Inc. 3,785 % fällig am 17.03.2033		6.500	6.500	Ares European CLO DAC 2,582 % fällig am 21.10.2033		8.000	7.699
TIAA CLO Ltd. 5,443 % fällig am 20.07.2031		6.500	6.486	Cairn CLO DAC 2,178 % fällig am 30.04.2031		8.092	7.689
Voya CLO Ltd. 5,289 % fällig am 15.10.2030		6.473	6.453	Madison Park Funding Ltd. 4,829 % fällig am 15.04.2029	\$	7.845	7.678
Goldman Sachs Group, Inc. 3,615 % fällig am 15.03.2028		6.200	6.200	Boeing Co. 2,196 % fällig am 04.02.2026		8.600	7.556

(a) Der Low Duration Opportunities Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Low Duration Opportunities ESG Fund

31. Dezember 2022 (ungeprüft)

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)
KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2022		
PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	10.047	\$ 100
	PARI (000S)	
NatWest Group PLC 4,067 % fällig am 06.09.2028	€ 100	100
Mizuho Financial Group, Inc. 3,490 % fällig am 05.09.2027	100	100
St. Paul's CLO DAC 2,128 % fällig am 15.01.2032	100	98
NTT Finance Corp. 0,082 % fällig am 13.12.2025	100	97
Mizuho Financial Group, Inc. 0,214 % fällig am 07.10.2025	100	97
Europäische Investitionsbank 2,375 % fällig am 24.05.2027	\$ 67	66
S&P Global, Inc. 4,750 % fällig am 01.08.2028	48	50
Wells Fargo & Co. 4,540 % fällig am 15.08.2026	50	50
Bank of America Corp. 2,456 % fällig am 22.10.2025	52	50
Duke Energy Florida LLC 2,500 % fällig am 01.12.2029	54	50
JPMorgan Chase & Co. 2,947 % fällig am 24.02.2028	52	49
Goldman Sachs Group, Inc. 4,387 % fällig am 15.06.2027	49	49
Citigroup, Inc. 4,615 % fällig am 25.01.2026	50	48
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc. 3,741 % fällig am 07.03.2029	50	48
Walt Disney Co. 2,200 % fällig am 13.01.2028	52	48
NextEra Energy Capital Holdings, Inc. 1,900 % fällig am 15.06.2028	54	48
Bank of Nova Scotia 5,245 % fällig am 11.03.2024	48	48
Weyerhaeuser Co. 3,375 % fällig am 09.03.2033	36	33
American Tower Corp. 1,450 % fällig am 15.09.2026	36	32
Santander Holdings USA, Inc. 5,807 % fällig am 09.09.2026	30	30
Xylem, Inc. 1,950 % fällig am 30.01.2028	30	27
Magallanes, Inc. 4,054 % fällig am 15.03.2029	28	26
Equinix, Inc. 1,550 % fällig am 15.03.2028	30	26
HCA, Inc. 3,625 % fällig am 15.03.2032	28	25
Equinix, Inc. 1,000 % fällig am 15.09.2025	28	25
VeriSign, Inc. 2,700 % fällig am 15.06.2031	30	25
Elevance Health, Inc. 2,550 % fällig am 15.03.2031	28	25
Manulife Financial Corp. 3,703 % fällig am 16.03.2032	26	25
Deutsche Bank AG 1,375 % fällig am 10.06.2026	€ 25	25
Equitable Financial Life Global Funding 1,300 % fällig am 12.07.2026	\$ 28	25
Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide 1,875 % fällig am 31.03.2028	€ 27	25

BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2022		
PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	10.047	\$ 100
	PARI (000S)	
Corebridge Financial, Inc. 3,650 % fällig am 05.04.2027	\$ 18	16
Morgan Stanley 2,630 % fällig am 18.02.2026	17	16
Aptiv PLC 3,250 % fällig am 01.03.2032	18	15

(a) Der Low Duration Opportunities ESG Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund

31. Dezember 2022 (ungeprüft)

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2022			VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2022		
PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	2.110.946	\$ 21.008	PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	1.879.296	\$ 18.700
Pioneer Natural Resources Co.	18.400	4.511	Hess Midstream LP	122.486	3.730
Chesapeake Energy Corp.	41.800	3.479	Coterra Energy, Inc.	107.791	3.599
Pembina Pipeline Corp.	81.200	3.131	Ovintiv, Inc.	65.000	3.289
EOG Resources, Inc.	26.800	3.129	Marathon Oil Corp.	111.700	3.193
Southwestern Energy Co.	359.600	2.980	Cheniere Energy, Inc.	19.700	2.917
EQT Corp.	64.900	2.901	Southwestern Energy Co.	359.600	2.736
EnLink Midstream LLC	292.900	2.900	Diamondback Energy, Inc.	16.500	2.578
Marathon Oil Corp.	110.400	2.636	EOG Resources, Inc.	18.100	2.223
Antero Resources Corp.	71.000	2.464	Targa Resources Corp.	29.600	1.969
DTE Midstream LLC	43.500	2.429	Rattler Midstream LP	131.100	1.933
Occidental Petroleum Corp.	37.066	2.301	Pioneer Natural Resources Co.	8.000	1.931
ConocoPhillips	19.000	2.165	ONEOK, Inc.	31.100	1.923
Range Resources Corp.	58.800	2.113	Range Resources Corp.	58.800	1.820
Devon Energy Corp.	30.200	2.074	Antero Resources Corp.	44.600	1.659
Targa Resources Corp.	28.700	2.061	EQT Corp.	32.800	1.420
Equitrans Midstream Corp.	213.500	1.666	Williams Cos., Inc.	39.800	1.296
Diamondback Energy, Inc.	11.500	1.538	Enbridge, Inc.	28.600	1.223
Coterra Energy, Inc.	55.200	1.279	Chesapeake Energy Corp.	10.500	1.031
ONEOK, Inc.	20.100	1.255	Occidental Petroleum Corp.	11.000	710
Ovintiv, Inc.	27.200	1.190			

(a) Der PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Mortgage Opportunities Fund

31. Dezember 2022 (ungeprüft)

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2022			VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2022		
PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	111.032.957	\$ 1.105.032	PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	120.374.756	\$ 1.197.984
	PARI (000S)			PARI (000S)	
Uniform Mortgage-Backed Security 4,500 % fällig am 01.09.2052	\$ 306.151	291.981	Uniform Mortgage-Backed Security 4,500 % fällig am 01.09.2052	\$ 306.151	289.535
Uniform Mortgage-Backed Security 4,500 % fällig am 01.09.2052	281.439	276.674	Uniform Mortgage-Backed Security 4,500 % fällig am 01.09.2052	281.439	270.161
Uniform Mortgage-Backed Security 4,500 % fällig am 01.11.2052	123.747	116.472	Uniform Mortgage-Backed Security 4,500 % fällig am 01.11.2052	123.747	120.271
Uniform Mortgage-Backed Security 4,000 % fällig am 01.10.2052	124.557	113.469	Uniform Mortgage-Backed Security 4,000 % fällig am 01.10.2052	124.557	118.188
Uniform Mortgage-Backed Security 5,000 % fällig am 01.01.2053	100.000	99.316	Uniform Mortgage-Backed Security 4,500 % fällig am 01.10.2052	99.484	94.553
Uniform Mortgage-Backed Security 4,500 % fällig am 01.10.2052	99.484	98.128	Uniform Mortgage-Backed Security 3,000 % fällig am 01.04.2052	79.629	73.956
Uniform Mortgage-Backed Security 4,000 % fällig am 01.12.2052	99.604	94.472	Fannie Mae 3,000 % fällig am 01.06.2051	48.652	50.002
Uniform Mortgage-Backed Security 3,000 % fällig am 01.04.2052	79.885	76.047	Uniform Mortgage-Backed Security 2,500 % fällig am 01.08.2051	54.848	47.577
Uniform Mortgage-Backed Security 2,500 % fällig am 01.02.2051	19.801	17.630	Uniform Mortgage-Backed Security 3,000 % fällig am 01.05.2051	31.750	29.860
Ginnie Mae 1,000 % fällig am 20.03.2071	17.088	17.013	Uniform Mortgage-Backed Security 3,000 % fällig am 01.06.2051	27.297	25.672
Ginnie Mae 1,000 % fällig am 20.12.2070	16.121	16.317	Uniform Mortgage-Backed Security 3,000 % fällig am 01.05.2051	28.138	24.640
Cardiff Auto Receivables Securitisation PLC 5,018 % fällig am 21.10.2028	£ 11.400	15.426	Uniform Mortgage-Backed Security 3,000 % fällig am 01.04.2051	24.249	22.473
Fannie Mae 3,500 % fällig am 01.04.2052	\$ 15.500	15.367	Madison Park Euro Funding DAC 2,128 % fällig am 15.01.2032	€ 19.600	18.907
U.S. Treasury Notes 1,875 % fällig am 15.02.2032	15.400	15.122	Uniform Mortgage-Backed Security 2,000 % fällig am 01.04.2036	\$ 18.874	17.382
Ginnie Mae 1,000 % fällig am 20.04.2071	13.869	14.112	Ginnie Mae 1,000 % fällig am 20.03.2071	17.088	16.981
Ginnie Mae 1,000 % fällig am 20.09.2070	12.170	11.930	Uniform Mortgage-Backed Security 3,000 % fällig am 01.04.2051	18.680	16.358
Cardiff Auto Receivables Securitisation PLC 6,318 % fällig am 21.10.2028	£ 8.775	11.874	Uniform Mortgage-Backed Security 2,500 % fällig am 01.02.2051	19.546	16.194
KKR CLO Ltd. 2,444 % fällig am 15.04.2031	\$ 10.800	10.638	Ginnie Mae 1,000 % fällig am 20.12.2070	16.121	16.171
Uniform Mortgage-Backed Security 4,500 % fällig am 01.08.2052	9.860	9.749	Uniform Mortgage-Backed Security 2,500 % fällig am 01.01.2051	17.572	15.442

(a) Der Mortgage Opportunities Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
KAUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2022			VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2022		
PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	14.635.180	\$ 145.629	PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	39.701.373	\$ 395.100
	PARI (000S)			PARI (000S)	
Shamrock Residential DAC 2,744 % fällig am 24.01.2061	€ 23.700	25.475	U.S. Treasury Notes 2,875 % fällig am 30.09.2023	\$ 75.980	76.511
Ripon Mortgages PLC 4,011 % fällig am 28.08.2056	£ 14.200	19.383	Harvest CLO DAC 2,228 % fällig am 15.01.2032	€ 28.500	27.964
Goldman Sachs Group, Inc. 2,905 % fällig am 24.07.2023	\$ 16.390	16.542	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,500 % fällig am 15.01.2028 (b)	\$ 25.512	26.208
Verus Securitization Trust 1,829 % fällig am 25.10.2066	14.102	13.167	AKTIEN	9.000	25.676
245 Park Avenue Trust 3,508 % fällig am 05.06.2037	12.203	12.721	PARI (000S)		
GS Mortgage Securities Trust 2,773 % fällig am 10.11.2045	12.622	12.645	Bank of America Corp. 3,729 % fällig am 24.08.2025	€ 23.500	24.600
Lehman XS Trust 4,749 % fällig am 25.07.2037	12.122	11.309	Madison Park Euro Funding DAC 2,128 % fällig am 15.01.2032	24.700	23.937
Bavarian Sky S.A. 2,448 % fällig am 20.07.2029	€ 10.528	11.112	Trinity Square PLC 3,729 % fällig am 15.07.2059	£ 19.177	23.897
Dutch Property Finance BV 3,328 % fällig am 28.04.2050	9.579	9.989	Towd Point Mortgage Funding PLC 3,826 % fällig am 20.07.2045	18.354	22.999
Nationstar Home Equity Loan Trust 4,709 % fällig am 25.04.2037	\$ 10.004	9.828	Ares European CLO DAC 2,306 % fällig am 20.04.2032	€ 14.100	14.007
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.02.2052 (b)	10.686	9.464	Twin Bridges PLC 1,412 % fällig am 12.09.2055	£ 11.540	13.348
Dutch Property Finance BV 2,828 % fällig am 28.04.2050	€ 8.000	8.645	U.S. Treasury Bonds 3,000 % fällig am 15.02.2049	\$ 13.000	12.778
Israel Government International Bond 0,750 % fällig am 31.07.2022	ILS 23.800	7.052	Griffith Park CLO DAC 2,522 % fällig am 21.11.2031	€ 11.600	11.329
BX Trust 5,338 % fällig am 15.05.2035	\$ 7.010	6.975	Marvell Technology, Inc. 4,200 % fällig am 22.06.2023	\$ 11.025	11.138
GA Global Funding Trust 5,085 % fällig am 11.04.2025	6.800	6.800	GS Mortgage Securities Trust 2,773 % fällig am 10.11.2045	10.854	10.853
Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust 1,884 % fällig am 25.08.2036	6.935	6.781	Israel Government International Bond 0,750 % fällig am 31.07.2022	ILS 35.700	10.579
Polaris PLC 4,232 % fällig am 23.10.2059	£ 5.000	6.696	GS Mortgage Securities Trust 4,074 % fällig am 10.01.2047	\$ 9.886	9.880
Bumper NL BV 3,110 % fällig am 24.06.2031	€ 5.676	6.006	BX Trust 2,124 % fällig am 15.05.2030	10.000	9.720
Navient Private Education Loan Trust 5,768 % fällig am 16.07.2040	\$ 5.868	5.926	U.S. Treasury Notes 3,000 % fällig am 31.10.2025	9.600	9.658
Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates 5,304 % fällig am 25.09.2035	6.000	5.895	U.S. Treasury Notes 3,000 % fällig am 30.09.2025	9.600	9.658
Countrywide Asset-Backed Certificates 4,889 % fällig am 25.01.2046	5.985	5.882	(a) Der StocksPLUS™ Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.		
Structured Asset Investment Loan Trust 4,569 % fällig am 25.09.2036	7.692	5.585	(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.		

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des PIMCO StocksPLUS™ AR Fund

31. Dezember 2022 (ungeprüft)

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2022			VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2022		
PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	41.168	\$ 410	PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	60.287	\$ 600
	PARI (000S)			PARI (000S)	
U.S. Treasury Notes 3,000 % fällig am 15.07.2025	\$ 300	300	U.S. Treasury Notes 3,000 % fällig am 15.07.2025	\$ 300	292
Mountain View CLO Ltd. 5,291 % fällig am 13.10.2027	250	247	U.S. Treasury Notes 1,125 % fällig am 15.02.2031	300	279
Nykredit Realkredit A/S 1,500 % fällig am 01.10.2053	DKK 800	111	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,000 % fällig am 15.02.2046 (b)	125	111
Dutch Property Finance BV 2,828 % fällig am 28.04.2050	€ 100	108	LoanCore Issuer Ltd. 2,624 % fällig am 15.07.2036	100	97
Shamrock Residential DAC 2,744 % fällig am 24.01.2061	100	107	Boeing Co. 2,750 % fällig am 01.02.2026	104	95
245 Park Avenue Trust 3,508 % fällig am 05.06.2037	\$ 100	105	T-Mobile USA, Inc. 2,250 % fällig am 15.02.2026	100	90
Palmer Square European Loan Funding DAC 3,993 % fällig am 12.04.2032	€ 100	100	Peru Government International Bond 5,400 % fällig am 12.08.2034	PEN 100	20
Goldman Sachs Group, Inc. 6,162 % fällig am 15.03.2028	\$ 100	100			
Magallanes, Inc. 4,279 % fällig am 15.03.2032	100	100			
LoanCore Issuer Ltd. 2,624 % fällig am 15.07.2036	100	98			

(a) Der PIMCO StocksPLUS™ AR Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
KAUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2022			VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2022		
PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	34.135.038	\$ 339.685	PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	32.678.695	\$ 325.180
	PARI (000S)		Exxon Mobil Corp.	127.205	11.298
U.S. Treasury Notes 2,875 % fällig am 30.04.2029	\$ 8.700	8.587	Chevron Corp.	68.359	10.382
ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust 4,869 % fällig am 25.04.2036	8.149	7.266	TotalEnergies SE	140.034	7.085
U.S. Treasury Notes 3,875 % fällig am 30.09.2029	5.200	5.193	AT&T, Inc.	342.312	6.605
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.01.2024 (b)	4.375	4.292	Valero Energy Corp.	53.697	5.758
	AKTIEN			PARI (000S)	
Johnson & Johnson	24.555	4.269	U.S. Treasury Notes 2,625 % fällig am 31.01.2026	\$ 5.700	5.665
	PARI (000S)		U.S. Treasury Notes 3,875 % fällig am 30.09.2029	5.200	5.148
U.S. Treasury Notes 2,375 % fällig am 31.03.2029	\$ 4.200	4.167		AKTIEN	
	AKTIEN		Altria Group, Inc.	98.317	4.698
Roche Holding AG	11.604	3.935		PARI (000S)	
	PARI (000S)		INEOS Finance PLC 3,898 % fällig am 01.04.2024	€ 4.325	4.553
Intelsat Jackson Holdings S.A. 6,500 % fällig am 25.01.2030	\$ 3.988	3.888		AKTIEN	
	AKTIEN		Telefonica S.A.	857.149	3.895
Exxon Mobil Corp.	39.552	3.686	International Business Machines Corp.	28.054	3.645
	PARI (000S)		Verizon Communications, Inc.	78.193	3.635
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,375 % fällig am 15.07.2023 (b)	\$ 3.704	3.673	AbbVie, Inc.	23.359	3.526
	AKTIEN			PARI (000S)	
Novartis AG	42.236	3.671	American Airlines, Inc. 5,500 % fällig am 20.04.2026	\$ 3.457	3.318
	PARI (000S)			AKTIEN	
U.S. Treasury Notes 4,000 % fällig am 31.10.2029	\$ 3.600	3.594	AXA S.A.	135.100	3.137
	AKTIEN			PARI (000S)	
VICI Properties, Inc.	105.328	3.554	iHeartCommunications, Inc. 7,384 % fällig am 01.05.2026	\$ 3.320	3.121
Gaming and Leisure Properties, Inc.	66.928	3.505	Ford Motor Credit Co. LLC 3,250 % fällig am 15.09.2025	€ 3.244	3.032
Merck & Co., Inc.	38.920	3.441		AKTIEN	
Cisco Systems, Inc.	74.369	3.396	BHP Group Ltd.	111.015	3.019
	PARI (000S)		SoftBank Corp.	253.000	2.942
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2024 (b)	\$ 3.444	3.354	(a) Der Strategic Income Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.		
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,500 % fällig am 15.04.2024 (b)	3.280	3.203	(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.		
	AKTIEN		Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.		
AT&T, Inc.	150.226	3.110	Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.		

Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Total Return Bond Fund

31. Dezember 2022 (ungeprüft)

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2022			VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2022		
PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	42.778.551	\$ 425.671	PIMCO ETFs plc – PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (a)	3.260.360	\$ 322.876
	PARI (000S)		PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	22.846.750	227.400
Uniform Mortgage-Backed Security 3,000 % fällig am 01.05.2052	\$ 93.015	86.601		PARI (000S)	
Uniform Mortgage-Backed Security 3,000 % fällig am 01.09.2052	56.808	52.918	Lloyds Banking Group PLC 7,625 % fällig am 27.06.2023	£ 57.070	78.251
U.S. Treasury Bonds 3,250 % fällig am 15.05.2042	34.100	33.977	Uniform Mortgage-Backed Security 3,000 % fällig am 01.05.2052	\$ 55.000	52.310
Canada Government International Bond 2,250 % fällig am 01.12.2029	CAD 38.600	30.491	Uniform Mortgage-Backed Security 3,000 % fällig am 01.09.2052	56.388	47.804
U.S. Treasury Bonds 3,375 % fällig am 15.08.2042	\$ 30.400	30.458	U.S. Treasury Bonds 1,375 % fällig am 15.08.2050	62.700	46.586
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.01.2024 (b)	30.572	29.963	U.S. Treasury Bonds 3,000 % fällig am 15.11.2044	33.200	38.005
U.S. Treasury Bonds 4,000 % fällig am 15.11.2042	26.600	26.798	Peru Government International Bond 6,150 % fällig am 12.08.2032	PEN 77.900	18.248
Ripon Mortgages PLC 4,011 % fällig am 28.08.2056	£ 17.600	24.024	RCI Banque S.A. 2,000 % fällig am 11.07.2024	€ 18.600	17.911
U.S. Treasury Notes 2,875 % fällig am 15.05.2032	\$ 25.000	23.973	Unipol Gruppo SpA 3,250 % fällig am 23.09.2030	20.900	17.563
Freddie Mac 3,000 % fällig am 01.07.2052	18.998	17.998	Grupo Aval Ltd. 4,750 % fällig am 26.09.2022	\$ 17.000	17.107
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.10.2024 (b)	17.883	17.246	Qatar Government International Bond 3,875 % fällig am 23.04.2023	16.400	16.622
U.S. Treasury Notes 1,875 % fällig am 28.02.2027	16.700	16.755	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV 6,000 % fällig am 15.04.2024	15.700	15.694
Israel Treasury Bills 0,000 % fällig am 03.08.2022	ILS 54.380	16.526	AT&T, Inc. 1,650 % fällig am 01.02.2028	18.100	15.325
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2031 (b)	\$ 17.592	15.578	Los Angeles Community College District, California General Obligation Notes, Series 2020 1,606 % fällig am 01.08.2028	15.800	15.315
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.07.2032 (b)	15.917	14.712	Israel Government International Bond 3,800 % fällig am 13.05.2060	18.400	14.766
U.S. Treasury Bonds 4,000 % fällig am 15.11.2052	13.100	14.214	Shinhan Bank Co. Ltd. 0,250 % fällig am 16.10.2024	€ 14.000	14.167
Palmer Square European Loan Funding DAC 2,098 % fällig am 15.10.2031	€ 11.700	13.358	Evergy, Inc. 2,450 % fällig am 15.09.2024	\$ 12.600	11.970
Enel Finance International NV 2,875 % fällig am 11.04.2029	£ 10.000	13.109	Boeing Co. 2,750 % fällig am 01.02.2026	12.600	11.739
Credit Suisse Group AG 6,537 % fällig am 12.08.2033	\$ 13.000	13.000	U.S. Treasury Bonds 1,625 % fällig am 15.11.2050	18.100	11.714

(a) Der Total Return Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund

31. Dezember 2022 (ungeprüft)

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2022			VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2022		
PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	8.846.240	\$ 88.028	PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	8.005.161	\$ 79.650
PIMCO ETFs plc – PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (a)	290.650	28.629		PARI (000S)	
			Jackson National Life Global Funding 4,278 % fällig am 06.01.2023	\$ 1.605	1.605
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 24.10.2022	¥ 1.670.600	12.285	Ginnie Mae 4,642 % fällig am 20.05.2066	1.213	1.226
Israel Treasury Bills 0,000 % fällig am 08.02.2023	ILS 26.700	7.652	Goldman Sachs Group, Inc. 2,009 % fällig am 06.12.2023	1.000	992
Heineken NV 2,750 % fällig am 01.04.2023	\$ 4.000	3.973	Amazon.com, Inc. 2,730 % fällig am 13.04.2024	1.000	977
Leidos, Inc. 2,950 % fällig am 15.05.2023	3.685	3.646	Korea Expressway Corp. 1,956 % fällig am 02.09.2023	AUD 1.000	674
Baxter International, Inc. 4,495 % fällig am 01.12.2023	3.500	3.470	Mountain View CLO LLC 5,169 % fällig am 16.10.2029	\$ 563	558
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. 0,875 % fällig am 18.09.2023	3.600	3.467	Venture CLO Ltd. 5,293 % fällig am 20.07.2030	400	395
Goldman Sachs Group, Inc. 2,009 % fällig am 06.12.2023	3.440	3.411	(a) Der PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.		
Nationwide Building Society 3,766 % fällig am 08.03.2024	3.400	3.380	Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.		
Bank of America Corp. 3,004 % fällig am 20.12.2023	3.240	3.229	Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.		
Nomura Holdings, Inc. 2,648 % fällig am 16.01.2025	3.300	3.090			
Niagara Mohawk Power Corp. 2,721 % fällig am 28.11.2022	3.000	2.996			
ORIX Corp. 4,050 % fällig am 16.01.2024	3.000	2.963			
Time Warner Entertainment Co. LP 8,375 % fällig am 15.03.2023	2.793	2.843			
Bayer U.S. Finance LLC 5,779 % fällig am 15.12.2023	2.800	2.796			
Sydney Airport Finance Co. Pty. Ltd. 3,900 % fällig am 22.03.2023	2.762	2.749			
Goldman Sachs Group, Inc. 6,334 % fällig am 29.11.2023	2.700	2.713			
British Telecommunications PLC 4,500 % fällig am 04.12.2023	2.700	2.665			
Canadian Imperial Bank of Commerce 5,122 % fällig am 17.03.2023	2.500	2.500			

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	ERLÖSE (000S)
KAUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2022			VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2022		
United Kingdom Gilt 0,125 % fällig am 31.01.2023	£ 107.900	£ 107.027	United Kingdom Gilt 0,500 % fällig am 22.07.2022	£ 66.380	£ 66.362
United Kingdom Gilt 1,750 % fällig am 07.09.2022	69.450	69.502	United Kingdom Gilt 0,125 % fällig am 31.01.2023	40.300	40.105
United Kingdom Gilt 0,500 % fällig am 22.07.2022	66.380	66.362	United Kingdom Gilt 1,250 % fällig am 22.07.2027	23.000	20.737
United Kingdom Gilt 1,250 % fällig am 22.07.2027	23.000	19.990	United Kingdom Gilt 0,875 % fällig am 31.07.2033	16.700	13.280
United Kingdom Gilt 4,250 % fällig am 07.03.2036	6.800	6.685	United Kingdom Gilt 1,750 % fällig am 07.09.2022	10.200	10.202
United Kingdom Gilt 4,000 % fällig am 07.03.2022	5.750	5.774	United Kingdom Gilt 4,000 % fällig am 07.03.2022	9.200	9.231
			Credit Suisse Group AG 2,125 % fällig am 15.11.2029	4.300	3.430
			Italy Government International Bond 6,000 % fällig am 04.08.2028	2.500	3.032
PIMCO ETFs plc – PIMCO Sterling Short Maturity UCITS ETF (a)	51.000	5.173	TP ICAP Finance PLC 2,625 % fällig am 18.11.2028	3.250	2.664
			MPT Operating Partnership LP 2,500 % fällig am 24.03.2026	2.900	2.561
			Aroundtown S.A. 3,000 % fällig am 16.10.2029	3.000	2.512
Volkswagen Financial Services NV 2,125 % fällig am 18.01.2028	£ 3.700	3.547	London & Quadrant Housing Trust 2,000 % fällig am 31.03.2032	3.200	2.419
Goldman Sachs Group, Inc. 3,625 % fällig am 29.10.2029	3.500	3.489	BNP Paribas S.A. 0,875 % fällig am 11.07.2030	€ 2.700	2.145
South Eastern Power Networks PLC 1,750 % fällig am 30.09.2034	4.200	3.450	Enel Finance International NV 2,650 % fällig am 10.09.2024	\$ 2.800	2.118
U.K. Treasury Bills 0,000 % fällig am 04.04.2022	3.300	3.300	Bank of America Corp. 1,667 % fällig am 02.06.2029	£ 2.183	1.977
Motability Operations Group PLC 2,125 % fällig am 18.01.2042	3.300	3.244	Derwent London PLC 1,875 % fällig am 17.11.2031	2.300	1.915
London & Quadrant Housing Trust 2,000 % fällig am 31.03.2032	3.200	3.173	BNP Paribas S.A. 2,000 % fällig am 24.05.2031	2.000	1.886
Credit Suisse Group AG 7,375 % fällig am 07.09.2033	3.000	2.982	AT&T, Inc. 4,250 % fällig am 01.06.2043	2.000	1.870
Bank of America Corp. 3,584 % fällig am 27.04.2031	2.800	2.799	United Kingdom Gilt 1,500 % fällig am 31.07.2053	1.800	1.846
Santander UK Group Holdings PLC 2,421 % fällig am 17.01.2029	2.600	2.600	Eastern Power Networks PLC 1,875 % fällig am 01.06.2035	2.100	1.830
Sage Group PLC 2,875 % fällig am 08.02.2034	2.500	2.486			
Barclays PLC 3,250 % fällig am 17.01.2033	2.500	2.235			
BNP Paribas S.A. 0,875 % fällig am 11.07.2030	€ 2.700	2.233			
Nestle Holdings, Inc. 2,500 % fällig am 04.04.2032	£ 2.000	2.000			

(a) Der UK Corporate Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des UK Long Term Corporate Bond Fund

31. Dezember 2022 (ungeprüft)

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	ERLÖSE (000S)
KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2022			VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2022		
United Kingdom Gilt 0,500 % fällig am 22.07.2022	£ 17.900	£ 17.887	United Kingdom Gilt 0,500 % fällig am 22.07.2022	£ 17.900	£ 17.888
United Kingdom Gilt 0,125 % fällig am 31.01.2023	16.000	15.899	United Kingdom Gilt 3,750 % fällig am 22.07.2052	16.400	16.118
United Kingdom Gilt 3,750 % fällig am 22.07.2052	16.400	14.744	United Kingdom Gilt 4,000 % fällig am 07.03.2022	15.500	15.550
U.K. Treasury Bills 0,000 % fällig am 08.05.2023	11.900	11.695	United Kingdom Gilt 0,125 % fällig am 31.01.2023	8.500	8.461
United Kingdom Gilt 1,500 % fällig am 31.07.2053	9.800	10.015	United Kingdom Gilt 1,750 % fällig am 07.09.2022	6.400	6.402
United Kingdom Gilt 4,000 % fällig am 07.03.2022	9.900	9.937	United Kingdom Gilt 1,500 % fällig am 31.07.2053	9.800	6.018
United Kingdom Gilt 1,750 % fällig am 07.09.2022	6.400	6.402	United Kingdom Gilt 3,500 % fällig am 22.01.2045	5.100	4.944
Electricite de France S.A. 5,500 % fällig am 17.10.2041	3.300	3.140	United Kingdom Gilt 0,875 % fällig am 31.07.2033	3.200	2.326
South Eastern Power Networks PLC 1,750 % fällig am 30.09.2034	4.400	3.133	United Kingdom Gilt 4,000 % fällig am 22.01.2060	2.300	2.158
London & Quadrant Housing Trust 2,000 % fällig am 31.03.2032	3.000	2.928	E.ON International Finance BV 4,750 % fällig am 31.01.2034	2.000	2.045
GlaxoSmithKline Capital PLC 1,625 % fällig am 12.05.2035	3.300	2.709	United Kingdom Gilt 0,500 % fällig am 22.10.2061	5.900	1.997
Motability Operations Group PLC 2,125 % fällig am 18.01.2042	2.600	2.343	Electricite de France S.A. 2,625 % fällig am 01.12.2027	€ 3.000	1.951
Goldman Sachs Group, Inc. 3,625 % fällig am 29.10.2029	2.300	2.293	HomeBanc Mortgage Trust 2,629 % fällig am 25.07.2035	\$ 2.557	1.877
Citigroup, Inc. 6,800 % fällig am 25.06.2038	2.000	2.205	GlaxoSmithKline Capital, Inc. 4,200 % fällig am 18.03.2043	2.000	1.668
E.ON International Finance BV 5,875 % fällig am 30.10.2037	2.000	2.201	Operating Partnership LP 3,375 % fällig am 24.04.2030	£ 1.800	1.408
Orsted A/S 5,375 % fällig am 13.09.2042	2.100	2.094	Deutsche Bank AG 3,547 % fällig am 18.09.2031	\$ 2.000	1.364
Deutsche Bank AG 1,875 % fällig am 22.12.2028	2.700	2.081	TP ICAP Finance PLC 2,625 % fällig am 18.11.2028	£ 1.800	1.352
United Kingdom Gilt 1,500 % fällig am 22.07.2047	3.800	2.075	Aroundtown S.A. 3,625 % fällig am 10.04.2031	1.550	1.352
United Kingdom Gilt 1,750 % fällig am 22.07.2057	3.800	2.045	Mondelez International Holdings Netherlands BV 1,250 % fällig am 09.09.2041	€ 1.700	1.291
Verizon Communications, Inc. 3,375 % fällig am 27.10.2036	2.000	1.981	M&G PLC 6,340 % fällig am 19.12.2063	£ 1.100	1.274

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des US High Yield Bond Fund

31. Dezember 2022 (ungeprüft)

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2022			VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2022		
PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	89.637.626	\$ 892.265	PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	111.298.968	\$ 1.107.831
	PARI (000S)			PARI (000S)	
U.S. Treasury Notes 4,250 % fällig am 15.10.2025	\$ 73.000	72.304	Kraft Heinz Foods Co. 5,200 % fällig am 15.07.2045	\$ 15.000	16.247
U.S. Treasury Notes 3,875 % fällig am 30.11.2027	50.700	50.741	Sprint Corp. 7,875 % fällig am 15.09.2023	10.000	10.849
U.S. Treasury Notes 3,500 % fällig am 15.09.2025	50.000	49.307	USI, Inc. 6,875 % fällig am 01.05.2025	10.000	9.745
U.S. Treasury Notes 4,125 % fällig am 30.09.2027	25.000	24.916	Chobani LLC 7,500 % fällig am 15.04.2025	10.000	9.375
U.S. Treasury Notes 3,125 % fällig am 31.08.2027	25.000	24.434	CNX Resources Corp. 6,000 % fällig am 15.01.2029	8.500	8.827
Condor Merger Sub, Inc. 7,375 % fällig am 15.02.2030	15.000	14.970	Freeport-McMoRan, Inc. 5,400 % fällig am 14.11.2034	7.400	8.456
Intelsat Jackson Holdings S.A. 6,500 % fällig am 25.01.2030	11.249	10.968	Surgery Center Holdings, Inc. 8,050 % fällig am 31.08.2026	8.393	8.424
Minerva Merger Sub, Inc. 6,500 % fällig am 15.02.2030	10.000	9.844		AKTIEN	
Clydesdale Acquisition Holdings, Inc. 8,750 % fällig am 15.04.2030	10.000	9.398	Noble Corp.	233.685	8.261
U.S. Treasury Notes 4,125 % fällig am 31.10.2027	9.000	8.896		PARI (000S)	
Scientific Games Holdings LP 6,625 % fällig am 01.03.2030	8.750	8.750	Caesars Entertainment, Inc. 8,125 % fällig am 01.07.2027	\$ 8.000	8.256
Fertitta Entertainment LLC 6,750 % fällig am 15.01.2030	7.750	7.750	BroadStreet Partners, Inc. 5,875 % fällig am 15.04.2029	10.000	8.046
Ford Motor Credit Co. LLC 2,900 % fällig am 10.02.2029	8.000	7.740	Kronos Acquisition Holdings, Inc. 7,000 % fällig am 31.12.2027	9.750	7.685
Royal Caribbean Cruises Ltd. 5,500 % fällig am 31.08.2026	7.000	5.992	H-Food Holdings LLC 8,500 % fällig am 01.06.2026	11.000	7.393
Cloud Software Group Holdings, Inc. 6,500 % fällig am 31.03.2029	7.000	5.847	Surgery Center Holdings, Inc. 10,000 % fällig am 15.04.2027	7.000	7.315
Ctec GmbH 5,250 % fällig am 15.02.2030	€ 5.000	5.510		AKTIEN	
Diamond Sports Group LLC 12,317 % fällig am 25.05.2026	\$ 5.474	5.278	Noble Corp. PLC	205.228	7.287
Tenet Healthcare Corp. 6,125 % fällig am 15.06.2030	5.000	5.000		PARI (000S)	
Royal Caribbean Cruises Ltd. 4,250 % fällig am 01.07.2026	5.000	4.170	HCA, Inc. 3,500 % fällig am 01.09.2030	\$ 8.000	7.087
			Endurance International Group Holdings, Inc. 6,000 % fällig am 15.02.2029	9.500	7.065
			RegionalCare Hospital Partners Holdings, Inc. 9,750 % fällig am 01.12.2026	7.000	6.813
			T-Mobile USA, Inc. 3,500 % fällig am 15.04.2031	7.000	6.437
			Full House Resorts, Inc. 8,250 % fällig am 15.02.2028	7.250	6.434

(a) Der US High Yield Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des US Investment Grade Corporate Bond Fund

31. Dezember 2022 (ungeprüft)

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2022			VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2022		
PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	33.429.538	\$ 332.638	PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	29.556.280	\$ 294.100
	PARI (000S)			PARI (000S)	
U.S. Treasury Notes 1,875 % fällig am 15.02.2032	\$ 25.301	24.864	U.S. Treasury Notes 2,375 % fällig am 15.05.2051	\$ 29.949	27.085
U.S. Treasury Notes 2,875 % fällig am 15.05.2032	17.234	17.296	U.S. Treasury Bonds 1,875 % fällig am 15.02.2041	30.700	25.230
U.S. Treasury Bonds 1,875 % fällig am 15.11.2051	16.494	15.274	U.S. Treasury Notes 1,875 % fällig am 15.02.2032	25.301	23.062
U.S. Treasury Bonds 4,000 % fällig am 15.11.2042	13.700	13.911	U.S. Treasury Bonds 1,875 % fällig am 15.11.2051	16.494	13.667
U.S. Treasury Bonds 2,000 % fällig am 15.11.2041	8.100	7.961	U.S. Treasury Notes 2,875 % fällig am 15.05.2032	10.933	10.787
U.S. Treasury Bonds 2,875 % fällig am 15.05.2052	8.200	7.825	Atlantia SpA 1,875 % fällig am 12.02.2028	€ 9.000	8.404
U.S. Treasury Notes 3,875 % fällig am 30.09.2029	7.300	7.290	Dell International LLC 6,020 % fällig am 15.06.2026	\$ 7.000	7.357
U.S. Treasury Bonds 2,500 % fällig am 15.02.2045	7.300	5.661	U.S. Treasury Notes 3,875 % fällig am 30.09.2029	7.300	7.356
South Africa Government International Bond 10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR 65.000	4.840	U.S. Treasury Bonds 2,000 % fällig am 15.11.2041	8.100	6.728
Meta Platforms, Inc. 3,850 % fällig am 15.08.2032	\$ 3.000	2.985	U.S. Treasury Bonds 1,750 % fällig am 15.08.2041	8.100	6.446
Credit Suisse Group AG 6,537 % fällig am 12.08.2033	2.750	2.750	JPMorgan Chase & Co. 3,960 % fällig am 29.01.2027	6.100	6.112
U.S. Treasury Bonds 3,250 % fällig am 15.05.2042	2.764	2.719	U.S. Treasury Bonds 2,250 % fällig am 15.05.2041	6.000	5.224
U.S. Treasury Bonds 2,250 % fällig am 15.02.2052	3.200	2.682	Boeing Co. 5,150 % fällig am 01.05.2030	4.300	4.574
GSK Consumer Healthcare Capital U.S. LLC 3,375 % fällig am 24.03.2029	2.650	2.623	U.S. Treasury Bonds 2,875 % fällig am 15.05.2052	5.600	4.332
U.S. Treasury Bonds 3,375 % fällig am 15.08.2042	2.800	2.386	HSBC Holdings PLC 3,973 % fällig am 22.05.2030	4.600	4.329
American Tower Corp. 3,650 % fällig am 15.03.2027	2.300	2.289	U.S. Treasury Bonds 1,375 % fällig am 15.08.2050	5.700	4.168
Expedia Group, Inc. 5,000 % fällig am 15.02.2026	2.200	2.214	Sempra Energy 3,250 % fällig am 15.06.2027	3.889	3.994
Wells Fargo & Co. 4,897 % fällig am 25.07.2033	2.100	2.153	VMware, Inc. 3,900 % fällig am 21.08.2027	3.695	3.895
Nomura Holdings, Inc. 5,386 % fällig am 06.07.2027	2.100	2.100	Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc. 1,474 % fällig am 08.07.2025	4.100	3.779

(a) Der US Investment Grade Corporate Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	KOSTEN (000S)	BESCHREIBUNG	PARI (000S)	ERLÖSE (000S)
KAUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2022			VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2022		
U.S. Treasury Notes 1,500 % fällig am 29.02.2024	\$ 243.200	\$ 240.232	U.S. Treasury Notes 2,250 % fällig am 31.03.2024	\$ 223.700	\$ 220.815
	AKTIEN		U.S. Treasury Notes 0,125 % fällig am 31.03.2023	182.300	180.142
PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	14.217.950	141.530	U.S. Treasury Notes 0,750 % fällig am 15.11.2024	172.800	164.548
	PARI (000S)		AKTIEN		
U.S. Treasury Notes 2,500 % fällig am 31.05.2024	\$ 117.700	117.364	PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	14.214.803	141.500
U.S. Treasury Notes 2,750 % fällig am 15.05.2025	72.200	72.034		PARI (000S)	
U.S. Treasury Notes 3,500 % fällig am 15.09.2025	63.700	63.222	U.S. Treasury Notes 2,500 % fällig am 31.05.2024	\$ 117.700	116.443
U.S. Treasury Notes 2,500 % fällig am 30.04.2024	51.000	51.000	U.S. Treasury Notes 2,750 % fällig am 15.05.2025	72.200	70.279
U.S. Treasury Notes 2,250 % fällig am 31.03.2024	40.400	40.310	Freddie Mac 0,650 % fällig am 22.10.2025	57.000	55.310
Federal Home Loan Bank 5,400 % fällig am 21.11.2024	35.000	35.000	Freddie Mac 0,800 % fällig am 28.10.2026	60.000	53.255
Sabine Pass Liquefaction LLC 5,625 % fällig am 15.04.2023	23.945	24.351	U.S. Treasury Notes 2,500 % fällig am 30.04.2024	51.000	50.446
Freddie Mac 5,400 % fällig am 23.12.2024	20.000	20.000	U.S. Treasury Notes 1,500 % fällig am 29.02.2024	50.500	49.726
Stellantis NV 5,250 % fällig am 15.04.2023	18.137	18.457	Freddie Mac 0,800 % fällig am 27.10.2026	50.000	46.089
Wells Fargo & Co. 5,241 % fällig am 25.04.2026	18.400	18.400	U.S. Treasury Notes 1,000 % fällig am 15.12.2024	43.100	42.329
NextEra Energy Capital Holdings, Inc. 5,342 % fällig am 21.03.2024	17.700	17.686	Federal Home Loan Bank 1,020 % fällig am 24.02.2027	45.000	41.738
Volkswagen Group of America Finance LLC 3,950 % fällig am 06.06.2025	15.700	15.693		AKTIEN	
UBS Group AG 5,706 % fällig am 12.05.2026	15.000	15.000	PIMCO ETFs plc – PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (a)	383.025	38.045
U.S. Treasury Notes 0,875 % fällig am 31.01.2024	14.900	14.707		PARI (000S)	
ING Groep NV 5,963 % fällig am 28.03.2026	13.100	13.100	Federal Home Loan Bank 0,830 % fällig am 10.02.2027	\$ 37.000	33.035
General Motors Financial Co., Inc. 3,250 % fällig am 05.01.2023	12.335	12.391	Federal Home Loan Bank 0,850 % fällig am 17.02.2027	33.500	29.952
Standard Chartered PLC 6,063 % fällig am 30.03.2026	12.000	12.000	Federal Home Loan Bank 0,920 % fällig am 26.02.2027	29.100	25.952
Societe Generale S.A. 2,625 % fällig am 22.01.2025	11.600	11.490	Federal Home Loan Bank 0,750 % fällig am 24.02.2026	28.000	25.592
			Federal Home Loan Bank 0,800 % fällig am 27.11.2023	26.000	25.079
			Fannie Mae 0,700 % fällig am 30.07.2025	22.000	20.379
			Fannie Mae 0,875 % fällig am 18.12.2026	21.000	19.524

(a) Der US Short-Term Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

Portfolioumschlagsrate

Dieser Bericht wurde zur Unterstützung der Offenlegungen gemäß der Aktionärsrechterichtlinie II für institutionelle Anleger erstellt.

Die Länge des Zeitraums, über den das Portfolio ein bestimmtes Wertpapier enthielt, beruht nicht unbedingt auf Anlageentscheidungen. Eine Veränderung in den von einem Fonds gehaltenen Wertpapieren bezeichnet man als „Portfolioumschlag“. Jeder Fonds kann sich am häufigen und aktiven Handel der Portfolioumschlag betriebligen, um sein Anlageziel zu erreichen, insbesondere in Zeiträumen volatiler Marktbewegungen. Ein hoher Portfolioumschlag kann mit entsprechend höheren Transaktionskosten verbunden sein, darunter Maklerprovisionen oder Händlerraufschläge sowie sonstige Transaktionskosten für den Verkauf von Wertpapieren und die Wiederanlage in anderen Wertpapieren, die vom Fonds getragen werden. Diese Verkäufe können auch zur Realisierung steuerbarer Kapitalerträge führen, einschließlich kurzfristiger Kapitalerträge (die gewöhnlich bei der Ausschüttung an Anteilhaber mit den allgemeinen Einkommenssteuersätzen besteuert werden). Die mit dem Portfolioumschlag verbundenen Transaktionskosten können die Wertentwicklung eines Fonds beeinträchtigen.

Die folgenden Wertpapierarten sind von der Berechnung der Portfolioumschlagsrate ausgeschlossen: verbundene Investmentfonds, derivative Finanzinstrumente, TBA Mortgage Dollar Rolls, Sale-Buybacks und andere kurzfristige Instrumente mit einer Laufzeit von weniger als 365 Tagen.

Die Portfolioumschlagsrate für die einzelnen Fonds für das am 31. Dezember 2022 abgeschlossene Geschäftsjahr lautet wie folgt:

Fondsbezeichnung	2022 Portfolioumschlagsrate
Low Duration Income Fund	122 %
Low Duration Opportunities Fund	33 %
Low Duration Opportunities ESG Fund	16 %
PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	62 %
Mortgage Opportunities Fund	477 %
StocksPLUS™ Fund	36 %
PIMCO StocksPLUS™ AR Fund	14 %
Strategic Income Fund	119 %
Total Return Bond Fund	164 %
PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	286 %
UK Corporate Bond Fund	41 %
UK Long Term Corporate Bond Fund	39 %
US High Yield Bond Fund	16 %
US Investment Grade Corporate Bond Fund	60 %
US Short-Term Fund	74 %

Fondsbezeichnung	2022 Portfolioumschlagsrate
PIMCO Asia High Yield Bond Fund	51 %
Asia Strategic Interest Bond Fund	62 %
PIMCO Capital Securities Fund	35 %
PIMCO Climate Bond Fund	39 %
Commodity Real Return Fund	51 %
PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	95 %
Diversified Income Fund	18 %
Diversified Income Duration Hedged Fund	25 %
Diversified Income ESG Fund	14 %
Dynamic Bond Fund	56 %
Dynamic Multi-Asset Fund	25 %
Emerging Local Bond Fund	120 %
Emerging Local Bond ESG Fund	37 %
Emerging Markets Bond Fund	50 %
Emerging Markets Bond ESG Fund	26 %
Emerging Markets Corporate Bond Fund	28 %
PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	105 %
Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	55 %
PIMCO ESG Income Fund	86 %
Euro Bond Fund	65 %
Euro Credit Fund	44 %
Euro Income Bond Fund	36 %
Euro Long Average Duration Fund	84 %
Euro Short-Term Fund	97 %
PIMCO European High Yield Bond Fund	47 %
PIMCO European Short-Term Opportunities Fund	59 %
Global Advantage Fund	93 %
Global Bond Fund	118 %
Global Bond ESG Fund	108 %
Global Bond Ex-US Fund	102 %
PIMCO Global Core Asset Allocation Fund	226 %
Global High Yield Bond Fund	14 %
Global Investment Grade Credit Fund	41 %
Global Investment Grade Credit ESG Fund	48 %
Global Low Duration Real Return Fund	49 %
Global Real Return Fund	64 %
Income Fund	143 %
Income Fund II	64 %
Inflation Multi-Asset Fund	196 %
Low Average Duration Fund	68 %
Low Duration Global Investment Grade Credit Fund	21 %

Alle in den folgenden Anhängen aufgeführten Daten wurden auf der Grundlage der Portfoliobestände des betreffenden Fonds zum 31. Dezember 2022 berechnet und stellen ungeprüfte Informationen dar, die weder von den Abschlussprüfern noch von Dritten bestätigt wurden. Alle in den Anhängen enthaltenen Daten und sonstigen Informationen wurden in Übereinstimmung mit dem vom Manager und dem Anlageberater für den jeweiligen Fonds implementierten Rahmen für nachhaltige Finanzen zusammengestellt.

Der Global Bond ESG Fund, der Emerging Markets Bond ESG Fund, der Global Investment Grade Credit ESG Fund und der PIMCO ESG Income Fund sind seit dem 13. Juni 2022 gemäß Artikel 8 der Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor eingestuft.

Der Euro Short Term Fund, der Global Real Return Fund und der Global Low Duration Real Return Fund sind seit dem 22. Juli 2022 gemäß Artikel 8 der Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor eingestuft.

Taxonomie-Verordnung

Für Fonds, die nach der SFDR als Artikel 8 oder Artikel 9 eingestuft sind, finden Sie im Anhang für den jeweiligen Fonds Informationen über die Konformität mit der Verordnung EU/2020/852, die gemeinhin als Taxonomie-Verordnung bezeichnet wird. Bei Fonds, die nicht als Artikel 8 (d. h. sie bewerben keine ökologischen und/oder sozialen Merkmale) oder Artikel 9 (d. h. sie haben kein nachhaltiges Investitionsziel) der SFDR eingestuft sind, berücksichtigen die zugrunde liegenden Investitionen die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten nicht.

ANHANG IV

Vorlage — Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: PIMCO Capital Securities Fund

Unternehmenskennung (LEI-Code): 549300LOUVRKJJGJKO09

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

●● <input type="checkbox"/> Ja	●○ <input checked="" type="checkbox"/> Nein
<input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: ___% <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: ___%	<input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es einen Anteil von ___% an nachhaltigen Investitionen <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel <input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Der Fonds bewarb die ökologischen Merkmale durch die Überprüfung aller Direktinvestitionen im Hinblick auf die Ausschlusspolitik des Fonds. Der Fonds hat ökologische Merkmale auch dadurch beworben, dass er sich aktiv mit Emittenten zu wesentlichen klimabezogenen Themen ausgetauscht hat. Dies beinhaltete die Motivation von Unternehmen, Konformität mit dem Pariser Abkommen anzustreben, sich wissenschaftlich fundierte Ziele für die Reduzierung von Kohlenstoffemissionen zu setzen und/oder ihre Nachhaltigkeitsverpflichtungen auf breiter Basis umzusetzen.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Die nachhaltigkeitsbezogenen Auswirkungen des Fonds wurden anhand der Umsetzung der Engagementpolitik des Anlageberaters in Bezug auf Emittenten und der Ausschlussstrategie gemessen. Die Ausschlussstrategie und das Ausschluss-Screening-Verfahren des Fonds gelten für 100 % seiner Direktanlagen.

Zum Beispiel führt das Screening-Verfahren des Fonds zum Ausschluss bestimmter Sektoren, darunter Emittenten, die in den Bereichen Kohle und nicht-konventionelles Öl (wie arktisches Öl und Ölsande) tätig sind. Darüber hinaus bezog sich der Anlageberater im Rahmen des Screening-Prozesses des Fonds auf weltweit anerkannte Normen wie die Prinzipien des Global Compact der Vereinten Nationen, wo dies angemessen war.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.



Welches sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Größte Investitionen	Sektor	% des Nettovermögens	Land
Stichting AK Rabobank Certificaten	Investment-Grade-Kredite	4,69 %	Niederlande
US-Staatsanleihen 4,255 % fällig 23.02.2023	Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	3,64 %	USA
US-Staatsanleihen 4,279 % fällig 03.09.2023	Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	3,51 %	USA
ING Groep NV 5,750 % fällig 16.11.2026	Investment-Grade-Kredite	2,00 %	Niederlande
Erste Group Bank AG 4,250 % fällig 15.10.2027	Investment-Grade-Kredite	1,66 %	Österreich
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. 6,000 % fällig 29.03.2024	Hochzinskredite	1,66 %	Spanien
Nationwide Building Society	Investment-Grade-Kredite	1,57 %	Vereinigtes Königreich
Intesa Sanpaolo SpA 7,750 % fällig 01.11.2027	Hochzinskredite	1,55 %	Italien
CaixaBank S.A. 6,750 % fällig 13.06.2024	Hochzinskredite	1,45 %	Spanien
HSBC Bank Capital Funding Sterling LP 5,844 % fällig 05.11.2031	Investment-Grade-Kredite	1,43 %	Jersey, Kanalinseln
Bank of Ireland Group PLC 7,500 % fällig 19.05.2025	Hochzinskredite	1,39 %	Irland
HSBC Holdings Plc 4,750 % fällig 07.04.2029	Investment-Grade-Kredite	1,33 %	Vereinigtes Königreich
KBC Group NV 4,250 % fällig 24.10.2025	Investment-Grade-Kredite	1,18 %	Belgien
Credit Suisse Group AG 9,750 % fällig 23.06.2027	Hochzinskredite	1,15 %	Schweiz
Societe Generale S.A. 6,221 % fällig 15.06.2033	Investment-Grade-Kredite	1,15 %	Frankreich

Die Liste umfasst den **größten Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts (Stand: 31. Dezember 2022)

Für die Zusammenstellung der oben genannten Informationen wurden die Investitionen des Fonds zum 31. Dezember 2022 verwendet.

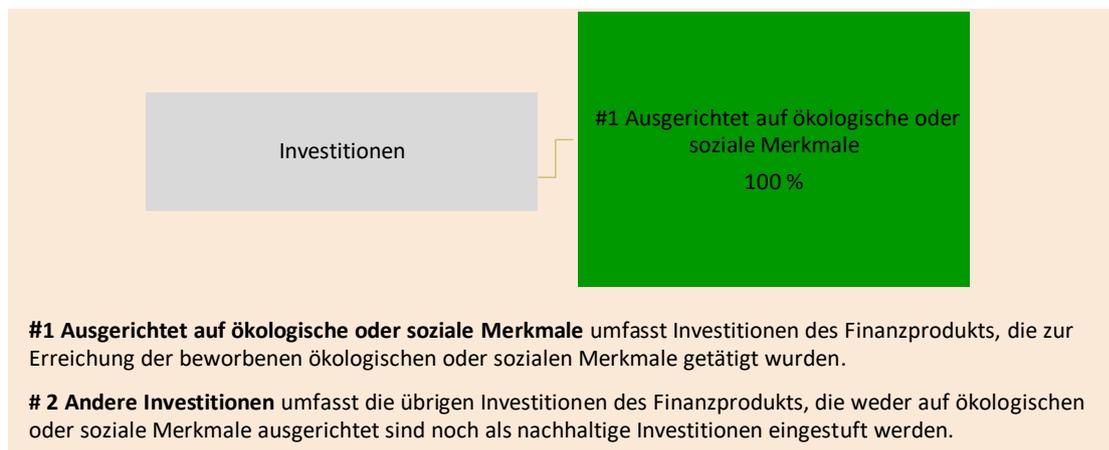


Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Nachfolgend finden Sie Informationen über den Anteil des Fonds, der zum 31. Dezember 2022 ökologische/soziale Merkmale beworben hat.

● **Wie sah die Vermögensallokation aus?**

Zum 31. Dezember 2022 wurde bei 100 % der Direktinvestitionen des Fonds davon ausgegangen, dass sie ökologische Merkmale bewerben, da die Ausschlussstrategie und das Ausschlusscreening des Fonds auf alle seine Direktinvestitionen angewendet wurden. Ein ökologischer und sozialer Mindestschutz war nur für solche Direktinvestitionen vorgesehen und galt nicht für indirekte Investitionen.



● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Sektor	% des Nettovermögens
Investment-Grade-Kredite	59,01 %
Hochzinskredite	32,81 %
Regierungsbezogen	12,66 %
Aufstrebende Märkte	0,90 %
Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	-5,38 %

Für die Zusammenstellung der oben genannten Informationen wurden die Bestände des Fonds zum 31. Dezember 2022 verwendet.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Zum 31. Dezember 2022 beträgt der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform sind, 0 %. Diese Zahl wurde weder von einem Wirtschaftsprüfer bestätigt noch von einer anderen dritten Partei überprüft.

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu einem Umweltzielen leisten.

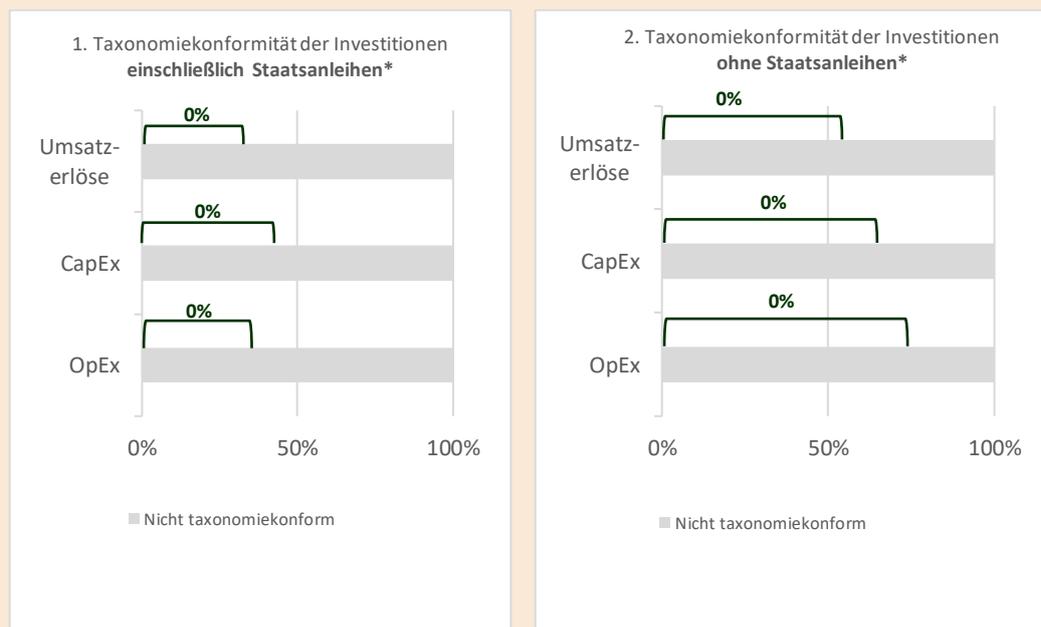
Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

● **Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert¹?**

Ja:
 In fossiles Gas In Kernenergie
 Nein

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Zum 31. Dezember 2022 betrug der Anteil der Investitionen des Fonds in Übergangs- und ermöglichende Tätigkeiten während des Bezugszeitraums 0 %.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil am:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Wie oben erwähnt, wurde zum 31. Dezember 2022 bei 100 % der Direktinvestitionen des Fonds davon ausgegangen, dass sie ökologische Merkmale bewerben, da die Ausschlussstrategie und das Ausschlusscreening des Fonds auf alle seine Direktinvestitionen angewendet wurden.

Ein ökologischer und sozialer Mindestschutz war nur für solche Direktinvestitionen vorgesehen und galt nicht für indirekte Investitionen.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Während des Berichtszeitraums hat sich der Anlageberater mit Unternehmen und Emittenten zu wesentlichen klimabezogenen Themen ausgetauscht. Dies beinhaltete die Motivation von Unternehmen, Konformität mit dem Pariser Abkommen anzustreben, sich wissenschaftlich fundierte Ziele für die Reduzierung von Kohlenstoffemissionen zu setzen und/oder ihre Nachhaltigkeitsverpflichtungen auf breiter Basis umzusetzen.

ANHANG V

Vorlage — Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: PIMCO Climate Bond Fund Unternehmenskennung (LEI-Code): 549300KBV832SKE8DW37

Nachhaltiges Investitionsziel

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

<input checked="" type="radio"/> <input checked="" type="radio"/> <input checked="" type="checkbox"/> Ja	<input type="radio"/> <input type="radio"/> <input type="checkbox"/> Nein
<p><input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: 81 %</p> <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input checked="" type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <p><input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: 1 % **</p> <p><small>** Obwohl der Fonds während des Berichtszeitraums in nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel investiert hat, hat er sich nicht verpflichtet, in diese Anlagekategorie zu investieren, und daher sollten solche vom Fonds erworbenen Investitionen als nebensächliche Investitionen betrachtet werden.</small></p>	<p><input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es einen Anteil von ___% an nachhaltigen Investitionen</p> <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel <p><input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt</p>

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.



Inwieweit wurde das nachhaltige Investitionsziel dieses Finanzprodukts erreicht?

Während des Berichtszeitraums bemühte sich der Fonds um optimale risikobereinigte Renditen, die mit einem umsichtigen Anlagemanagement im Einklang stehen, und berücksichtigte dabei langfristige klimabedingte Risiken und Chancen.

Wie nachstehend im Abschnitt „Vermögensallokation“ näher erläutert, investierte der Fonds in nachhaltige Investitionen, die aus festverzinslichen ESG-Wertpapieren (wie im Abschnitt „Festverzinsliche ESG-Wertpapiere“ des Prospekts näher beschrieben) bestanden, die es Emittenten ermöglichen, Kapital zur Finanzierung von Projekten mit positivem Nutzen für die Umwelt zu beschaffen und die zu den Umweltzielen Klimaschutz und Anpassung an den Klimawandel beitragen.

Nachhaltigkeitsindikatoren

messen, wie die nachhaltigen Ziele dieses Finanzprodukts erreicht werden.

Bei den wichtigsten nachteiligen Auswirkungen

handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Der Einfluss des Fonds auf die Nachhaltigkeit wurde durch die Umsetzung der Emittenten-Engagement-Politik des Anlageberaters, der Ausschlussstrategie und der Anlage in festverzinsliche ESG-Wertpapiere gemessen (wie im Abschnitt „Festverzinsliche ESG-Wertpapiere“ des Prospekts näher beschrieben).

Zum Beispiel führt das Screening-Verfahren des Fonds zum Ausschluss bestimmter Sektoren, darunter Emittenten, die in den mit fossilen Brennstoffen verbundenen Sektoren tätig sind. Darüber hinaus bezog sich der Anlageberater auf weltweit anerkannte Normen wie die Prinzipien des Global Compact der Vereinten Nationen und die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte, wo dies angemessen war.

● **Inwiefern wurden nachhaltige Investitionsziele durch die nachhaltigen Investitionen nicht erheblich geschadet?**

Die nachhaltigen Investitionen des Fonds wurden daraufhin geprüft, ob sie ein Umweltziel oder ein Ziel für sozial nachhaltige Investitionen erheblich beeinträchtigen. Diese Bewertung erfolgte durch die Anwendung verschiedener negativer Nachhaltigkeitsindikatoren durch den Anlageberater, einschließlich, aber nicht beschränkt auf das Engagement in den mit fossilen Brennstoffen verbundenen Sektoren und Treibhausgasemissionen.

— **Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Die Wertpapiere wurden nach dem internen Nachhaltigkeits-Screening-Verfahren des Anlageberaters ausgewählt. Dieser Screening-Prozess beinhaltete die Berücksichtigung nachteiliger Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren, einschließlich des Engagements in den mit fossilen Brennstoffen verbundenen Sektoren. Der Anlageberater versuchte, die wesentlichen negativen Auswirkungen zu mindern, unter anderem durch Emittentenengagement und Ausschlussüberprüfung.

— **Waren die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte konform? Einzelheiten:**

Der Anlageberater hat sich davon überzeugt, dass nachhaltige Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte konform sind, indem er das Kontroversen-Screening des UNGC (UN Global Compact) sowie andere Instrumente wie ESG-Scores und -Research als Teil des Due-Diligence-Prozesses für Investitionen angewandt hat.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die wichtigsten negativen Auswirkungen werden als jene Auswirkungen von Investitionsentscheidungen beschrieben, die „zu negativen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren führen“, während Nachhaltigkeitsfaktoren als „ökologische, soziale und Arbeitnehmerbelange, Achtung der Menschenrechte, Bekämpfung von Korruption und Bestechung“ definiert werden.

Der Fonds berücksichtigte die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (einschließlich, aber nicht beschränkt auf das Engagement in Kohle und Öl sowie Treibhausgasemissionen und das Engagement in kontroversen Waffen) während des Bezugszeitraums.

Der Anlageberater versuchte, die wichtigsten negativen Auswirkungen als Teil des Anlageprozesses zu berücksichtigen, und nutzte eine Kombination von Methoden, um die wichtigsten negativen Auswirkungen zu mindern, einschließlich des Emittentenengagements und der Ausschlüsse.



Welches sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Größte Investitionen	Sektor	% des Nettovermögens	Land
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 1,375 % fällig 06.07.2032	Regierungsbezogen	4,88 %	Deutschland
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 2,000 % fällig 15.11.2029	Regierungsbezogen	3,55 %	Deutschland
European Investment Bank 1,500 % fällig 15.06.2032	Regierungsbezogen	1,78 %	Supranational
Internationale Staatsanleihe Kanada 2,250 % fällig 12.01.2029	Regierungsbezogen	1,51 %	Kanada
United Kingdom Gilt 0,875 % fällig 31.07.2033	Regierungsbezogen	1,14 %	Vereinigtes Königreich
Verizon Communications, Inc. 1,500 % fällig 18.09.2030	Investment-Grade-Kredite	1,10 %	USA
Österreichische Staatsanleihen 1,267 % fällig 23.02.2023	Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	0,98 %	Österreich
NTT Finance Corp. 4,239 % fällig 25.07.2025	Investment-Grade-Kredite	0,97 %	Japan
BNP Paribas S.A. 0,500 % fällig 06.04.2026	Investment-Grade-Kredite	0,97 %	Frankreich
ABN AMRO Bank NV 2,470 % fällig 13.12.2029	Investment-Grade-Kredite	0,94 %	Niederlande
UniCredit SpA 5,850 % fällig 15.11.2027	Investment-Grade-Kredite	0,82 %	Italien
HAT Holdings LLC 3,750 % fällig 15.09.2030	Hochzinskredite	0,81 %	USA
Compass Group PLC 4,375 % fällig 09.08.2032	Investment-Grade-Kredite	0,75 %	Vereinigtes Königreich
India Green Energy Holdings 5,375 % fällig 29.04.2024	Aufstrebender Markt – extern	0,69 %	Mauritius
ING Groep NV 4,875 % fällig 16.05.2029	Hochzinskredite	0,69 %	Niederlande

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten **Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: zum 31. Dezember 2022.

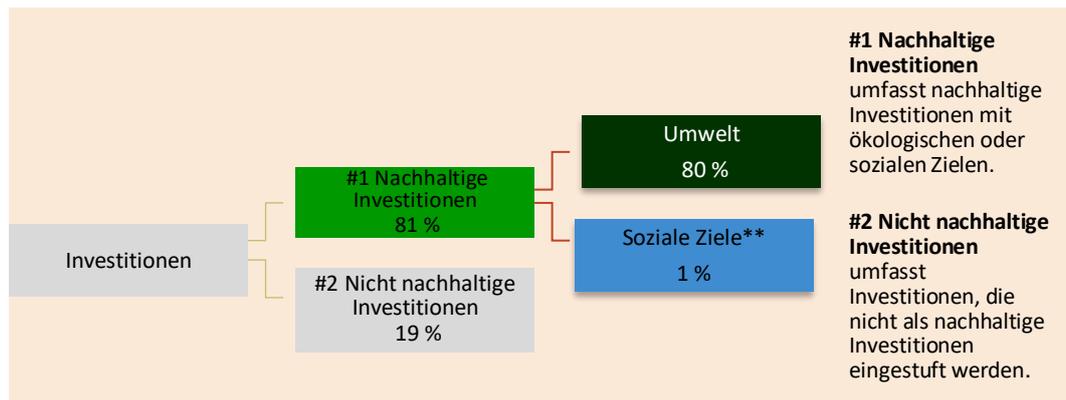
Für die Zusammenstellung der oben genannten Informationen wurden die Investitionen des Fonds zum 31. Dezember 2022 verwendet.



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Der Anteil des Fonds, der per 31. Dezember 2022 in nachhaltige Anlagen investiert war, ist nachfolgend dargestellt.

● Wie sah die Vermögensallokation aus?



Zum 31. Dezember 2022 war der Fonds vollständig in nachhaltige Investitionen investiert, mit Ausnahme der Investitionen, die zu anderen Zwecken wie Liquidität oder Absicherung gehalten wurden.

Zu diesem Zeitpunkt hatte der Fonds 81 % seines Nettovermögens in nachhaltige Investitionen investiert. 80 % des Nettovermögens waren in nachhaltige Investitionen investiert, die zu einem Umweltziel beitrugen.

** Darüber hinaus hielt der Fonds 1 % in nachhaltigen Investitionen, die zu einem sozialen Ziel beitragen. Es ist zu beachten, dass der Fonds keine Verpflichtung eingegangen ist, in nachhaltige Investitionen zu investieren, die zu einem sozialen Ziel beitragen, und dass solche Investitionen als unbeabsichtigt angesehen werden sollten.

Der Fonds hatte 19 % seines Nettovermögens in Investitionen des Fonds investiert, die keine „nachhaltigen Investitionen“ darstellten und für das allgemeine Risikomanagement wie Liquidität oder Absicherung verwendet wurden.

● In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Sektor	% des Nettovermögens
Investment-Grade-Kredite	46,06 %
Regierungsbezogen	34,80 %
Hochzinskredite	8,19 %
Aufstrebender Markt – extern	5,19 %
Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	4,09 %
Verbriefte	1,35 %
Kommunen	0,25 %
Gedekte Schuldverschreibungen (Covered Bonds) und Pfandbriefe	0,07 %

Für die Zusammenstellung der oben genannten Informationen wurden die Investitionen des Fonds zum 31. Dezember 2022 verwendet.

Die Vermögensallokation gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu einem Umweltziel leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

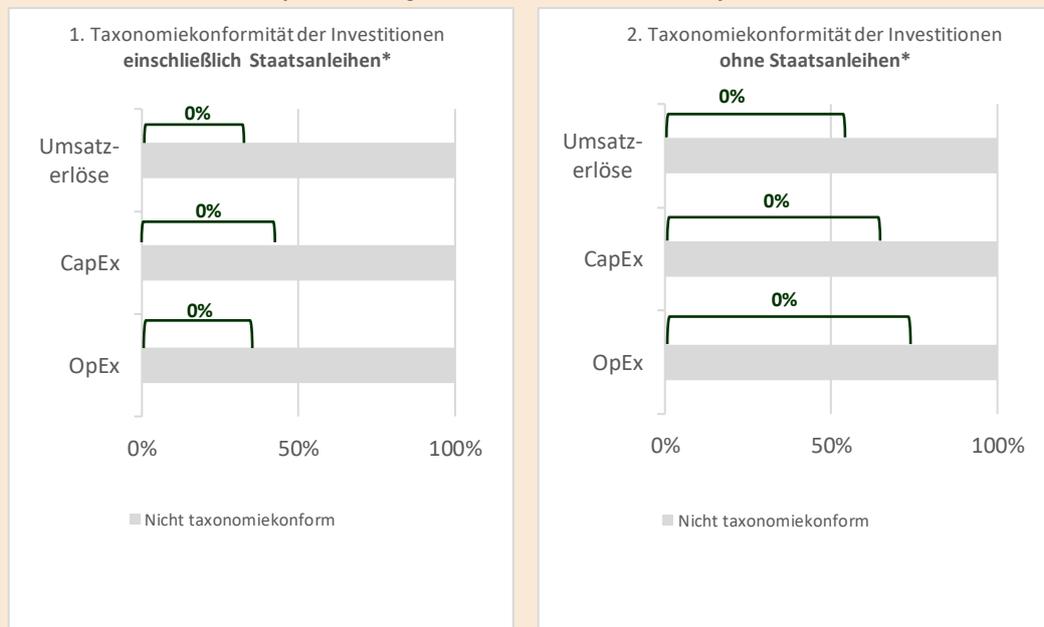
Zum 31. Dezember 2022 beträgt der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform sind, 0 %. Diese Zahl wurde weder von einem Wirtschaftsprüfer bestätigt noch von einer anderen dritten Partei überprüft.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomeikonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert¹?



¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomeikonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomeikonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomeikonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

Taxonomeikonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil am:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Zum 31. Dezember 2022 betrug der Anteil der Investitionen des Fonds in Übergangs- und ermöglichende Tätigkeiten während des Überweisungszeitraums 0 %.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Der Fonds verpflichtet sich nicht, in Investitionen zu investieren, die mit der EU-Taxonomie konform sind, sondern verpflichtet sich, in nachhaltige Investitionen zu investieren, die zu einem Umweltziel beitragen. Zum 31. Dezember 2022 betrug der Anteil der nachhaltigen Investitionen des Fonds, die zu einem Umweltziel beitrugen, die nicht anhand der EU-Taxonomie bewertet wurden und daher oben als Investitionen mit „Sonstigen Umweltzielen“ klassifiziert wurden, 80 %. Weitere Informationen über die Verfügbarkeit von Nachhaltigkeitsdaten und die damit verbundenen Herausforderungen finden Sie unter <https://europe.pimco.com/en-eu/our-firm/global-advisors-ireland>.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Wie oben erwähnt, hielt der Fonds zum 31. Dezember 2022 1 % in nachhaltigen Investitionen, die während des vom Jahresabschluss abgedeckten Zeitraums zu einem sozialen Ziel beitragen. Da der Fonds keine Verpflichtung eingegangen ist, in nachhaltige Investitionen zu investieren, die zu einem sozialen Ziel beitragen, sollten solche Investitionen als unbeabsichtigt angesehen werden.



Welche Investitionen fallen unter „nicht nachhaltige Investitionen“, welcher Anlagezweck wird mit ihnen verfolgt und gibt es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Wie oben erwähnt, war der Fonds zum 31. Dezember 2022 vollständig in nachhaltige Investitionen investiert, mit Ausnahme der Investitionen, die zu anderen Zwecken wie Liquidität oder Absicherung gehalten wurden. Wie oben ausführlicher beschrieben, hatte der Fonds zu diesem Zeitpunkt 81 % seines Nettovermögens in nachhaltige Investitionen investiert.

Der Anteil der Investitionen des Fonds, der keine „nachhaltigen Investitionen“ darstellte, wurde für das allgemeine Risikomanagement wie Liquidität oder Absicherung verwendet. Emittenten und Derivate, die für die Erreichung dieser Zwecke verwendet wurden, unterlagen einem ESG-Screening, das darauf abzielt, die Einhaltung der Mindestanforderungen an die geltenden ökologischen und/oder sozialen Garantien zu gewährleisten.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung des nachhaltigen Investitionsziels ergriffen?

Während des Berichtszeitraums hat sich der Anlageberater mit Unternehmen und Emittenten zu wesentlichen klimabezogenen Themen ausgetauscht. Dies beinhaltete die Motivation von Unternehmen, Konformität mit dem Pariser Abkommen anzustreben, sich wissenschaftlich fundierte Ziele für die Reduzierung von Kohlenstoffemissionen zu setzen und/oder ihre Nachhaltigkeitsverpflichtungen auf breiter Basis umzusetzen.

 sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten nach der EU-Taxonomie nicht berücksichtigen.

ANHANG IV

Vorlage — Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Diversified Income ESG Fund

Unternehmenskennung (LEI-Code):

549300ECS7VMY4LHDC04

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

●● <input type="checkbox"/> Ja	● <input checked="" type="checkbox"/> Nein
<p><input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: ___%</p> <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <p><input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: ___%</p>	<p><input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es einen Anteil von 47 % an nachhaltigen Investitionen</p> <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input checked="" type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel** <p>** Obwohl der Fonds während des Berichtszeitraums in nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel investiert hat, hat er sich nicht verpflichtet, in diese Anlagekategorie zu investieren, und daher sollten solche vom Fonds erworbenen Investitionen als nebensächliche Investitionen betrachtet werden.</p> <p><input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt</p>

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Der Ansatz des Fonds für nachhaltiges Investieren besteht im Bewerben ökologischer und sozialer Merkmale (der Fonds hat nachhaltiges Investieren zwar nicht als Anlageziel, ist aber bestrebt, einen Teil seiner Vermögenswerte in nachhaltige Anlagen zu investieren).

Wie unten beschrieben, trugen die nachhaltigen Investitionen des Fonds während des Bezugszeitraums zu den Umweltzielen der Anpassung an den Klimawandel und der Eindämmung des Klimawandels bei.

Die vom Fonds während des Berichtszeitraums gehaltenen Derivate wurden im Hinblick auf die vom Anlageberater umgesetzte Ausschlusspolitik geprüft und dementsprechend eingesetzt, um die vom Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale zu bewerten.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Der Einfluss des Fonds auf die Nachhaltigkeit wurde durch die Umsetzung der Emittenten-Engagement-Politik des Anlageberaters, die Ausschlussstrategie und die Anlage in bestimmte festverzinsliche ESG-Wertpapiere (wie im Abschnitt „**Festverzinsliche ESG-Wertpapiere**“ des Prospekts näher beschrieben) gemessen, die es Emittenten ermöglichen, Kapital zur Finanzierung von Projekten mit positivem Umweltnutzen zu beschaffen, sowie durch die Verschuldung von Emittenten, die bei der Bewältigung von Risiken und Chancen im Zusammenhang mit dem Klimawandel eine führende Rolle spielen.

Zum Beispiel führt das Screening-Verfahren des Fonds zum Ausschluss bestimmter Sektoren, darunter Emittenten, die in den Bereichen Kohle und Öl tätig sind. Darüber hinaus bezog sich der Anlageberater im Rahmen des Screening-Prozesses des Fonds auf weltweit anerkannte Normen wie die Prinzipien des Global Compact der Vereinten Nationen und die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte, wo dies angemessen war.

● **Welche Ziele wurden mit den nachhaltigen Investitionen, die das Finanzprodukt teilweise getätigt hat, verfolgt und wie haben die nachhaltigen Investitionen zu diesen Zielen beigetragen?**

Die zugrundeliegenden nachhaltigen Investitionen des Fonds trugen während des Berichtszeitraums in erster Linie zu den Umweltzielen Klimaschutz und Anpassung an den Klimawandel bei, was auf verschiedene Weise erreicht wurde, beispielsweise durch die Investition in festverzinsliche ESG-Wertpapiere (wie im Abschnitt „**Festverzinsliche ESG-Wertpapiere**“ des Prospekts näher beschrieben) einschließlich grüner Anleihen.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Die nachhaltigen Investitionen des Fonds wurden daraufhin geprüft, ob sie ein Umweltziel oder ein soziales Ziel erheblich beeinträchtigen. Diese Bewertung erfolgte durch die Anwendung verschiedener negativer Nachhaltigkeitsindikatoren durch den Anlageberater, einschließlich, aber nicht beschränkt auf das Engagement in Kohle und Öl sowie Treibhausgasemissionen.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die Wertpapiere wurden nach dem internen Nachhaltigkeits-Screening-Verfahren des Anlageberaters ausgewählt. Dieser Screening-Prozess beinhaltet die Berücksichtigung negativer Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren, einschließlich des Engagements im Kohle- und Ölsektor und des Engagements in kontroversen Waffen. Der Anlageberater versuchte, die wesentlichen negativen Auswirkungen zu mindern, unter anderem durch Emittentenengagement und Ausschlussüberprüfung.

Waren die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte konform? Einzelheiten:

Der Anlageberater hat sich davon überzeugt, dass nachhaltige Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte konform sind, indem er das Kontroversen-Screening des UNGC (UN Global Compact) sowie andere Instrumente wie ESG-Scores und -Research als Teil des Due-Diligence-Prozesses für Investitionen angewandt hat.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Anlagen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unions-Kriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die Unions-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die Unions-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die wichtigsten negativen Auswirkungen werden als jene Auswirkungen von Investitionsentscheidungen beschrieben, die „zu negativen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren führen“, während Nachhaltigkeitsfaktoren als „ökologische, soziale und Arbeitnehmerbelange, Achtung der Menschenrechte, Bekämpfung von Korruption und Bestechung“ definiert werden.

Der Fonds berücksichtigte die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (einschließlich, aber nicht beschränkt auf das Engagement in Kohle und Öl sowie Treibhausgasemissionen und das Engagement in kontroversen Waffen) während des Bezugszeitraums.

Der Anlageberater war bestrebt, die wichtigsten negativen Auswirkungen als Teil des Investitionsprozesses zu berücksichtigen und nutzte eine Kombination von Methoden, um die wichtigsten negativen Auswirkungen zu mildern, einschließlich des Emittentenengagements und der Ausschlüsse.



Welches sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten **Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: zum 31. Dezember 2022

Größte Investitionen	Sektor	% des Nettovermögens	Land
US-Staatsanleihen 4,290 % fällig 03.09.2023	Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	14,10 %	USA
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig 02.01.2053	Verbrieft	2,04 %	USA
US-Staatsanleihen 4,397 % fällig 23.03.2023	Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	2,01 %	USA
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fällig 02.01.2053	Verbrieft	2,00 %	USA
ReNew Power Pvt Ltd. 5,875 % fällig 03.05.2027	Aufstrebender Markt – extern	1,95 %	Indien
Internationale Staatsanleihe Oman 6,750 % fällig 17.01.2048	Aufstrebender Markt – extern	1,91 %	Oman
Banco BTG Pactual S.A. 2,750 % fällig 01.11.2026	Aufstrebender Markt – extern	1,85 %	Brasilien
HSBC Holdings Plc 3,973 % fällig 22.05.2030	Investment-Grade-Kredite	1,78 %	Vereinigtes Königreich
BNP Paribas S.A. 1,675 % fällig 30.06.2027	Investment-Grade-Kredite	1,77 %	Frankreich
US-Staatsanleihen 4,000 % fällig 15.11.2042	Regierungsbezogen	1,74 %	USA
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc. 2,472 % fällig 14.01.2029	Investment-Grade-Kredite	1,71 %	Japan
Internationale Staatsanleihe Dominikanische Republik 6,500 % fällig 15.02.2048	Aufstrebender Markt – extern	1,68 %	Dominikanische Republik
Natura Cosméticos S.A. 4,125 % fällig 05.03.2028	Aufstrebender Markt – extern	1,65 %	Brasilien
Internationale Staatsanleihe Chile 3,100 % fällig 05.07.2041	Aufstrebender Markt – extern	1,46 %	Chile
Internationale Staatsanleihe Marokko 4,000 % fällig 15.12.2050	Aufstrebender Markt – extern	1,40 %	Marokko

Für die Zusammenstellung der oben genannten Informationen wurden die Investitionen des Fonds zum 31. Dezember 2022 verwendet.



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Nachfolgend finden Sie Informationen über den Anteil des Fonds, der ökologische/soziale Merkmale beworben hat, und den Anteil des Fonds, der zum 31. Dezember 2022 in nachhaltige Investitionen investiert wurde.

● Wie sah die Vermögensallokation aus?



Zum 31. Dezember 2022 wurde bei 100 % der Investitionen des Fonds davon ausgegangen, dass sie ökologische und soziale Merkmale bewerben, da alle Investitionen des Fonds anhand seiner Ausschlussstrategie geprüft wurden.

Zu diesem Zeitpunkt hatte der Fonds 47 % seines Nettovermögens in nachhaltige Investitionen investiert. 45 % des Nettovermögens waren in nachhaltige Investitionen investiert, die zu einem Umweltziel beitragen.

** Darüber hinaus hielt der Fonds 2 % des Nettovermögens in nachhaltigen Investitionen, die zu einem sozialen Ziel beitragen. Es ist zu beachten, dass der Fonds keine Verpflichtung eingegangen ist, in nachhaltige Investitionen zu investieren, die zu einem sozialen Ziel beitragen, und dass solche Investitionen als unbeabsichtigt angesehen werden sollten.

● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Sektor	% des Nettovermögens
Investment-Grade-Kredite	33,21 %
Hochzinskredite	24,73 %
Aufstrebender Markt – extern	21,42 %
Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	8,64 %
Regierungsbezogen	7,96 %
Verbriefte	4,04 %

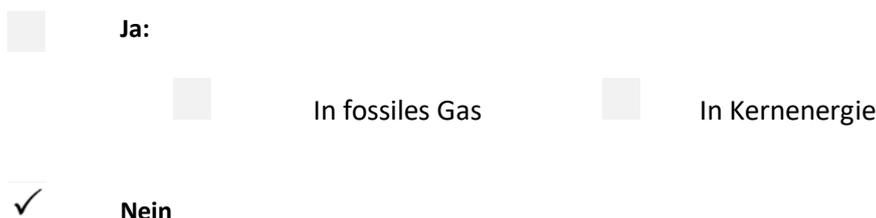
Für die Zusammenstellung der oben genannten Informationen wurden die Investitionen des Fonds zum 31. Dezember 2022 verwendet.



● **Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?**

Zum 31. Dezember 2022 beträgt der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform sind, 0 %. Diese Zahl wurde weder von einem Wirtschaftsprüfer bestätigt noch von einer anderen dritten Partei überprüft.

● **Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert¹?**



¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Mit Blick auf die EU-Taxonomekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

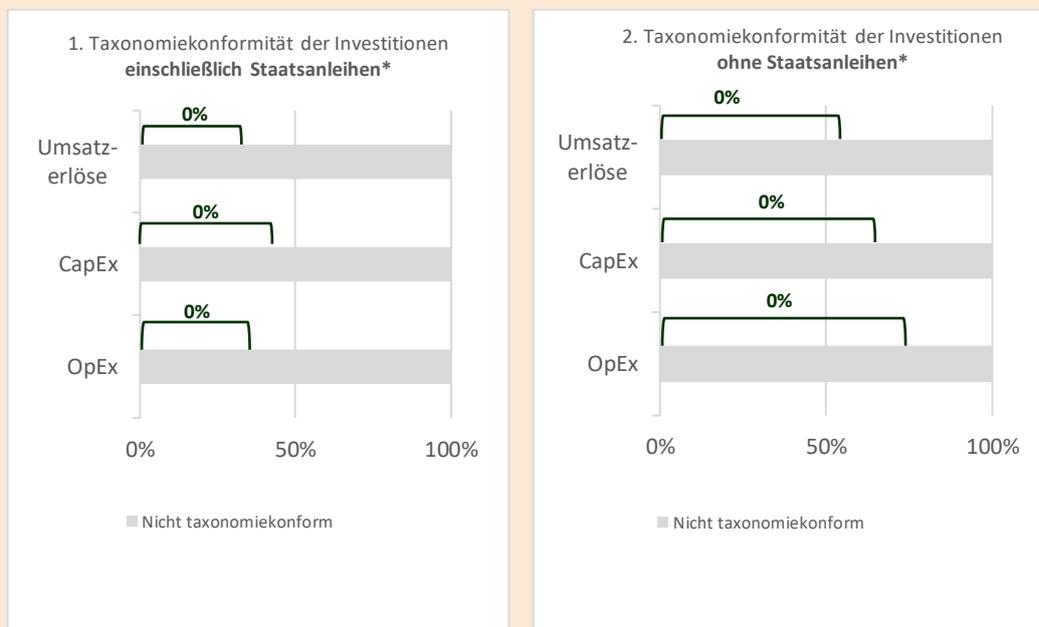
Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu einem Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil am:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Zum 31. Dezember 2022 betrug der Anteil der Investitionen des Fonds in Übergangs- und ermöglichende Tätigkeiten während des Bezugszeitraums 0 %.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Der Fonds verpflichtet sich nicht, in Investitionen zu investieren, die mit der EU-Taxonomie konform sind, sondern verpflichtet sich, in nachhaltige Investitionen zu investieren, die zu einem Umweltziel beitragen. Zum 31. Dezember 2022 betrug der Anteil der nachhaltigen Investitionen des Fonds, die zu einem Umweltziel beitrugen, die nicht anhand der EU-Taxonomie bewertet wurden und daher oben als Investitionen mit „Sonstigen Umweltzielen“ klassifiziert wurden, 45 %. Weitere Informationen über die Verfügbarkeit von Nachhaltigkeitsdaten und die damit verbundenen Herausforderungen finden Sie unter <https://europe.pimco.com/en-eu/our-firm/global-advisors-ireland>.

... sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Wie oben erwähnt, hielt der Fonds 2 % des Nettovermögens in nachhaltigen Investitionen, die während des von diesem Jahresabschluss abgedeckten Zeitraums zu einem sozialen Ziel beitragen. Da der Fonds keine Verpflichtung eingegangen ist, in nachhaltige Investitionen zu investieren, die zu einem sozialen Ziel beitragen, sollten solche Investitionen als unbeabsichtigt angesehen werden.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Wie oben erwähnt wurde zum 31. Dezember 2022 bei 100 % der Investitionen des Fonds davon ausgegangen, dass sie ökologische und soziale Merkmale bewerben, da alle Investitionen des Fonds anhand seiner Ausschlussstrategie geprüft wurden. Wie oben ausführlicher dargelegt, hatte der Fonds zu diesem Zeitpunkt 47 % seines Nettovermögens in nachhaltige Investitionen investiert.

Infolgedessen gab es zum 31. Dezember 2022 keine Investitionen im Portfolio, die nicht mit den vom Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen konform waren.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Während des Berichtszeitraums hat sich der Anlageberater mit Unternehmen und Emittenten zu wesentlichen klimabezogenen Themen ausgetauscht. Dies beinhaltete die Motivation von Unternehmen, Konformität mit dem Pariser Abkommen anzustreben, sich wissenschaftlich fundierte Ziele für die Reduzierung von Kohlenstoffemissionen zu setzen und/oder ihre Nachhaltigkeitsverpflichtungen auf breiter Basis umzusetzen.

ANHANG IV

Vorlage — Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Dynamic Multi-Asset Fund

Unternehmenskennung (LEI-Code):

549300ZZOV14P64W6594

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

●● <input type="checkbox"/> Ja	●○ <input checked="" type="checkbox"/> Nein
<p><input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: ___%</p> <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <p><input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: ___%</p>	<p><input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es einen Anteil von ___% an nachhaltigen Investitionen</p> <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel <p><input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt</p>

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Der Fonds bewarb die ökologischen Merkmale durch die Überprüfung aller Direktinvestitionen im Hinblick auf die Ausschlusspolitik des Fonds. Der Fonds hat ökologische Merkmale auch dadurch beworben, dass er sich aktiv mit Emittenten zu wesentlichen klimabezogenen Themen ausgetauscht hat. Dies beinhaltete die Motivation von Unternehmen, Konformität mit dem Pariser Abkommen anzustreben, sich wissenschaftlich fundierte Ziele für die Reduzierung von Kohlenstoffemissionen zu setzen und/oder ihre Nachhaltigkeitsverpflichtungen auf breiter Basis umzusetzen.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Die nachhaltigkeitsbezogenen Auswirkungen des Fonds wurden anhand der Umsetzung der Engagementpolitik des Anlageberaters in Bezug auf Emittenten und der Ausschlussstrategie gemessen. Die Ausschlussstrategie und das Ausschluss-Screening-Verfahren des Fonds gelten für 100 % seiner Direktanlagen.

Zum Beispiel führt das Screening-Verfahren des Fonds zum Ausschluss bestimmter Sektoren, darunter Emittenten, die in den Bereichen Kohle und nicht-konventionelles Öl (wie arktisches Öl und Ölsande) tätig sind. Darüber hinaus bezog sich der Anlageberater im Rahmen des Screening-Prozesses des Fonds auf weltweit anerkannte Normen wie die Prinzipien des Global Compact der Vereinten Nationen, wo dies angemessen war.



Welches sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Die Liste umfasst den größten Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts (Stand: 31. Dezember 2022).

Größte Investitionen	Sektor	% des Nettovermögens	Land
PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF	Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	6,45 %	Irland
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Income Fund	Kommunen	1,98 %	Irland
Japanische Staatsanleihen (0,142) % fällig 06.03.2023	Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	1,80 %	Japan
Japanische Staatsanleihen (0,182) % fällig 20.03.2023	Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	1,78 %	Japan
Japanische Staatsanleihen (0,131) % fällig 06.03.2023	Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	1,72 %	Japan
Japanische Staatsanleihen (0,181) % fällig 13.03.2023	Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	1,54 %	Japan
Japanische Staatsanleihen (0,209) % fällig 01.06.2023	Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	1,39 %	Japan
Vertex Pharmaceuticals, Inc.	Andere	1,02 %	USA
Italienische Staatsanleihen 2,200 % fällig 28.04.2023	Regierungsbezogen	0,96 %	Italien
First Solar, Inc.	Andere	0,94 %	USA
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd.	Emerging Market Local	0,93 %	Taiwan
SolarEdge Technologies, Inc.	Andere	0,90 %	Israel
Humana, Inc.	Andere	0,87 %	USA
Vestas Wind Systems A/S	Andere	0,84 %	Dänemark
Elevance Health, Inc.	Andere	0,81 %	USA

Für die Zusammenstellung der oben genannten Informationen wurden die Investitionen des Fonds zum 31. Dezember 2022 verwendet.



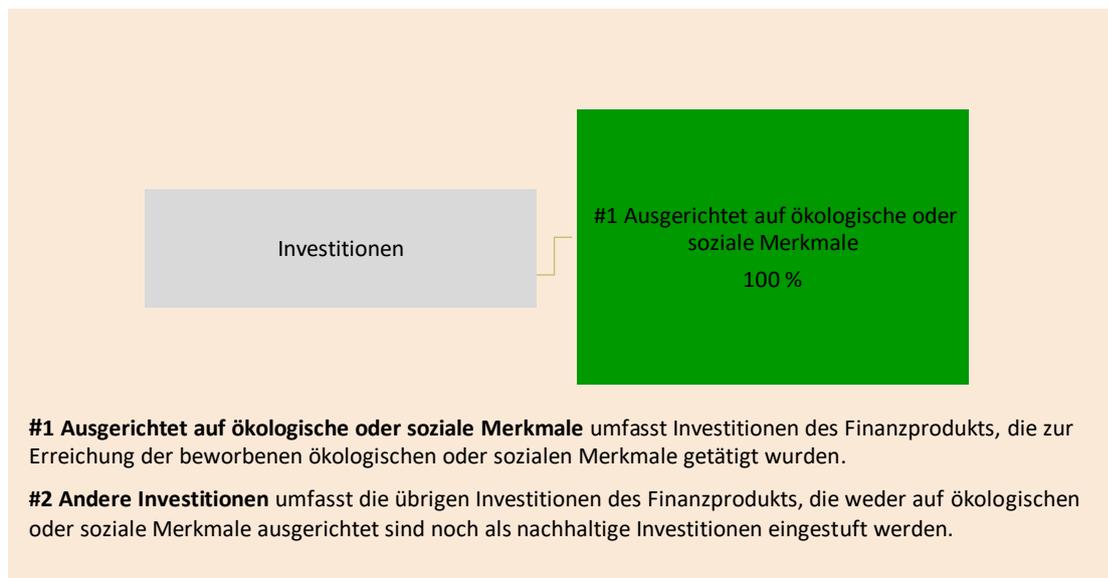
Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Nachfolgend finden Sie Informationen über den Anteil des Fonds, der zum 31. Dezember 2022 ökologische/soziale Merkmale beworben hat.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

● **Wie sah die Vermögensallokation aus?**

Zum 31. Dezember 2022 wurde bei 100 % der Direktinvestitionen des Fonds davon ausgegangen, dass sie ökologische Merkmale bewerben, da die Ausschlussstrategie und das Ausschlusscreening des Fonds auf alle seine Direktinvestitionen angewendet wurden. Ein ökologischer und sozialer Mindestschutz war nur für solche Direktinvestitionen vorgesehen und galt nicht für indirekte Investitionen.



Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO2-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu einem Umweltziel leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO2-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionen aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Sektor	% des Nettovermögens
Regierungsbezogen	83,23 %
Andere	32,28 %
Aufstrebende Märkte – lokal	7,60 %
Hochzinskredite	4,23 %
Kommunal	3,38 %
Investment-Grade-Kredite	1,99 %
Verbriefte	1,44 %
Aufstrebende Märkte – extern	0,43 %
Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	-34,59 %

Für die Zusammenstellung der oben genannten Informationen wurden die Bestände des Fonds zum 31. Dezember 2022 verwendet.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Zum 31. Dezember 2022 beträgt der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform sind, 0 %. Diese Zahl wurde weder von einem Wirtschaftsprüfer bestätigt noch von einer anderen dritten Partei überprüft.

● **Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert¹?**

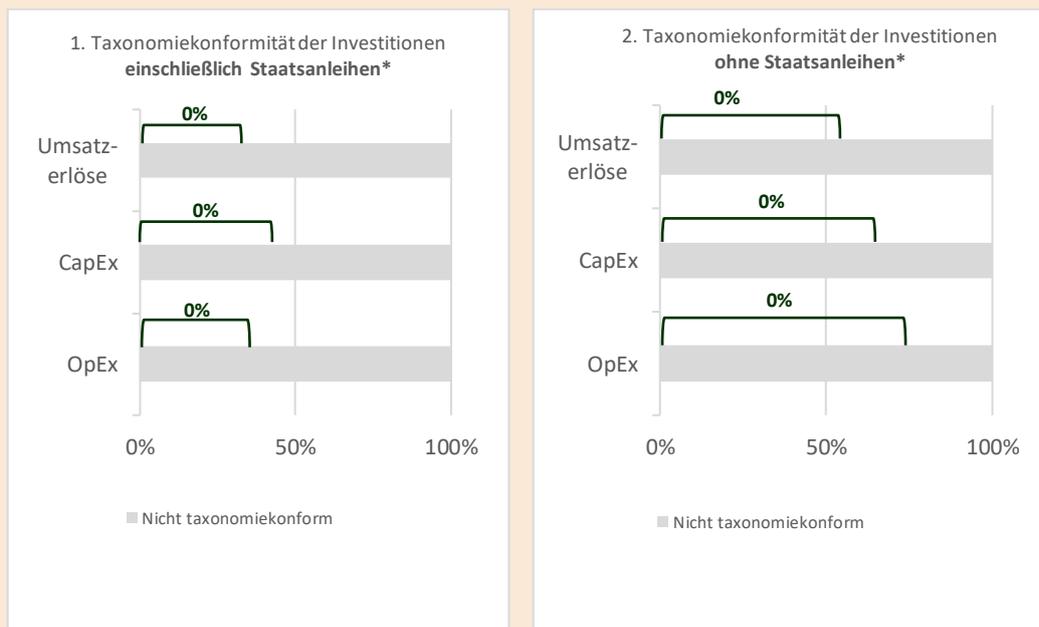
Ja:

In fossiles Gas In Kernenergie

Nein

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.*



* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Zum 31. Dezember 2022 betrug der Anteil der Investitionen des Fonds in Übergangs- und ermöglichende Tätigkeiten während des Bezugszeitraums 0 %.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil am:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Wie oben erwähnt, wurde zum 31. Dezember 2022 bei 100 % der Direktinvestitionen des Fonds davon ausgegangen, dass sie ökologische Merkmale bewerben, da die Ausschlussstrategie und das Ausschlusscreening des Fonds auf alle seine Direktinvestitionen angewendet wurden.

Ein ökologischer und sozialer Mindestschutz war nur für solche Direktinvestitionen vorgesehen und galt nicht für indirekte Investitionen.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Während des Berichtszeitraums hat sich der Anlageberater mit Unternehmen und Emittenten zu wesentlichen klimabezogenen Themen ausgetauscht. Dies beinhaltete die Motivation von Unternehmen, Konformität mit dem Pariser Abkommen anzustreben, sich wissenschaftlich fundierte Ziele für die Reduzierung von Kohlenstoffemissionen zu setzen und/oder ihre Nachhaltigkeitsverpflichtungen auf breiter Basis umzusetzen.

ANHANG IV

Vorlage — Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Emerging Local Bond ESG Fund

Unternehmenskennung (LEI-Code):

549300XJ4S7ZD2HUGI18

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

●● <input type="checkbox"/> Ja	●○ <input checked="" type="checkbox"/> Nein
<p><input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: ___%</p> <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <p><input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: ___%</p>	<p><input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es einen Anteil von 27 % an nachhaltigen Investitionen</p> <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input checked="" type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel** <p>** Obwohl der Fonds während des Berichtszeitraums in nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel investiert hat, hat er sich nicht verpflichtet, in diese Anlagekategorie zu investieren, und daher sollten solche vom Fonds erworbenen Investitionen als nebensächliche Investitionen betrachtet werden.</p> <p><input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt</p>

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Der Ansatz des Fonds für nachhaltiges Investieren besteht im Bewerben ökologischer und sozialer Merkmale (der Fonds hat nachhaltiges Investieren zwar nicht als Anlageziel, ist aber bestrebt, einen Teil seiner Vermögenswerte in nachhaltige Anlagen zu investieren).

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Wie unten beschrieben, trugen die nachhaltigen Investitionen des Fonds während des Bezugszeitraums zu den Umweltzielen der Anpassung an den Klimawandel und der Eindämmung des Klimawandels bei.

Die vom Fonds während des Berichtszeitraums gehaltenen Derivate wurden im Hinblick auf die vom Anlageberater umgesetzte Ausschlusspolitik geprüft und dementsprechend eingesetzt, um die vom Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale zu bewerten.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Der Einfluss des Fonds auf die Nachhaltigkeit wurde durch die Umsetzung der Emittenten-Engagement-Politik des Anlageberaters, die Ausschlussstrategie und die Anlage in bestimmte festverzinsliche ESG-Wertpapiere (wie im Abschnitt „**Festverzinsliche ESG-Wertpapiere**“ des Prospekts näher beschrieben) gemessen, die es Emittenten ermöglichen, Kapital zur Finanzierung von Projekten mit positivem Umweltnutzen zu beschaffen, sowie durch die Verschuldung von Emittenten, die bei der Bewältigung von Risiken und Chancen im Zusammenhang mit dem Klimawandel eine führende Rolle spielen.

Zum Beispiel führt das Screening-Verfahren des Fonds zum Ausschluss bestimmter Sektoren, darunter Emittenten, die in den Bereichen Kohle und Öl tätig sind. Darüber hinaus bezog sich der Anlageberater im Rahmen des Screening-Prozesses des Fonds auf weltweit anerkannte Normen wie die Prinzipien des Global Compact der Vereinten Nationen und die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte, wo dies angemessen war.

● **Welche Ziele wurden mit den nachhaltigen Investitionen, die das Finanzprodukt teilweise getätigt hat, verfolgt und wie haben die nachhaltigen Investitionen zu diesen Zielen beigetragen?**

Die zugrundeliegenden nachhaltigen Investitionen des Fonds trugen während des Berichtszeitraums in erster Linie zu den Umweltzielen Klimaschutz und Anpassung an den Klimawandel bei, was auf verschiedene Weise erreicht wurde, beispielsweise durch die Investition in festverzinsliche ESG-Wertpapiere (wie im Abschnitt „**Festverzinsliche ESG-Wertpapiere**“ des Prospekts näher beschrieben) einschließlich grüner Anleihen.

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Die nachhaltigen Investitionen des Fonds wurden daraufhin geprüft, ob sie ein Umweltziel oder ein soziales Ziel erheblich beeinträchtigen. Diese Bewertung erfolgte durch die Anwendung verschiedener negativer Nachhaltigkeitsindikatoren durch den Anlageberater, einschließlich, aber nicht beschränkt auf das Engagement in Kohle und Öl sowie Treibhausgasemissionen.

— **Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Die Wertpapiere wurden nach dem internen Nachhaltigkeits-Screening-Verfahren des Anlageberaters ausgewählt. Dieser Screening-Prozess beinhaltet die Berücksichtigung negativer Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren, einschließlich des Engagements im Kohle- und Ölsektor und des Engagements in kontroversen Waffen. Der Anlageberater versuchte, die wesentlichen negativen Auswirkungen zu mindern, unter anderem durch Emittentenengagement und Ausschlussüberprüfung.

Waren die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte konform? Einzelheiten:

Der Anlageberater hat sich davon überzeugt, dass nachhaltige Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte konform sind, indem er das Kontroversen-Screening des UNGC (UN Global Compact) sowie andere Instrumente wie ESG-Scores und -Research als Teil des Due-Diligence-Prozesses für Investitionen angewandt hat.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Anlagen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unions-Kriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die Unions-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die Unions-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die wichtigsten negativen Auswirkungen werden als jene Auswirkungen von Investitionsentscheidungen beschrieben, die „zu negativen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren führen“, während Nachhaltigkeitsfaktoren als „ökologische, soziale und Arbeitnehmerbelange, Achtung der Menschenrechte, Bekämpfung von Korruption und Bestechung“ definiert werden.

Der Fonds berücksichtigte die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (einschließlich, aber nicht beschränkt auf das Engagement in Kohle und Öl sowie Treibhausgasemissionen und das Engagement in kontroversen Waffen) während des Bezugszeitraums.

Der Anlageberater war bestrebt, die wichtigsten negativen Auswirkungen als Teil des Investitionsprozesses zu berücksichtigen und nutzte eine Kombination von Methoden, um die wichtigsten negativen Auswirkungen zu mildern, einschließlich des Emittentenengagements und der Ausschlüsse.



Welches sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Größte Investitionen	Sektor	% Vermögenswerte	Land
US-Staatsanleihen 4,397 % fällig 23.03.2023	Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	5,99 %	USA
Kolumbianische TES 7,000 % fällig 26.03.2031	Aufstrebende Märkte	3,54 %	Kolumbien
Internationale Staatsanleihe Tschechische Republik 2,400 % fällig 17.09.2025	Regierungsbezogen	2,98 %	Tschechische Republik
Malaysia Government Investment Issue 4,130 % fällig 07.09.2029	Aufstrebende Märkte	2,94 %	Malaysia
Internationale Staatsanleihe Südafrikanische Republik 10,500 % fällig 21.12.2026	Aufstrebende Märkte	2,73 %	Südafrika
Internationale Staatsanleihe Südafrikanische Republik 8,750 % fällig 28.02.2048	Aufstrebende Märkte	2,71 %	Südafrika
International Bank for Reconstruction & Development 4,750 % fällig 21.01.2027	Regierungsbezogen	2,63 %	Supranational
Internationale Staatsanleihe Rumänien 3,250 % fällig 29.04.2024	Aufstrebende Märkte	2,50 %	Rumänien
Internationale Staatsanleihe Mexiko 7,500 % fällig 06.03.2027	Aufstrebende Märkte	2,48 %	Mexiko
Ungarische Staatsanleihen 18,250 % fällig 01.03.2023	Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	2,26 %	Ungarn
Israelische Staatsanleihen 0,529 % fällig 02.08.2023	Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	2,14 %	Israel
Malaysia Government Investment Issue 4,369 % fällig 31.10.2028	Aufstrebende Märkte	2,14 %	Malaysia
Internationale Staatsanleihe Israel 0,150 % fällig 31.07.2023	Aufstrebende Märkte	2,10 %	Israel
Inter-American Development Bank 5,500 % fällig 02.07.2023	Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	2,06 %	Supranational
International Bank for Reconstruction & Development 9,750 % fällig 21.01.2027	Regierungsbezogen	2,04 %	Supranational

Für die Zusammenstellung der oben genannten Informationen wurden die Investitionen des Fonds zum 31. Dezember 2022 verwendet.



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Nachfolgend finden Sie Informationen über den Anteil des Fonds, der ökologische/soziale Merkmale beworben hat, und den Anteil des Fonds, der zum 31. Dezember 2022 in nachhaltige Investitionen investiert wurde.

● *Wie sah die Vermögensallokation aus?*

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten **Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: zum 31. Dezember 2022

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

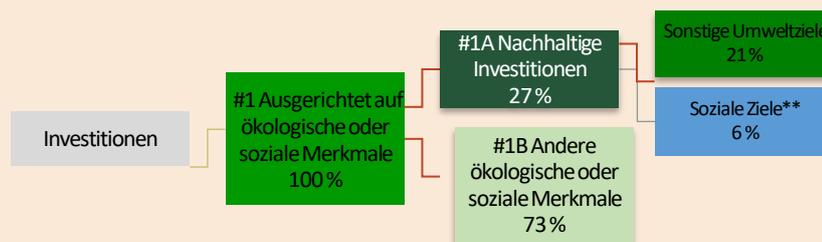
Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten

wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu einem Umweltziel leisten.

Übergangstätigkeiten

sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologischen oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Zum 31. Dezember 2022 wurde bei 100 % der Investitionen des Fonds davon ausgegangen, dass sie ökologische und soziale Merkmale bewerben, da alle Investitionen des Fonds anhand seiner Ausschlussstrategie geprüft wurden.

Zu diesem Zeitpunkt hatte der Fonds 27 % seines Nettovermögens in nachhaltige Investitionen investiert. 21 % des Nettovermögens waren in nachhaltige Investitionen investiert, die zu einem Umweltziel beitragen.

** Darüber hinaus hielt der Fonds 6 % des Nettovermögens in nachhaltigen Investitionen, die zu einem sozialen Ziel beitragen. Es ist zu beachten, dass der Fonds keine Verpflichtung eingegangen ist, in nachhaltige Investitionen zu investieren, die zu einem sozialen Ziel beitragen, und dass solche Investitionen als unbeabsichtigt angesehen werden sollten.

● In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Sektor	% des Nettovermögens
Aufstrebende Märkte	70,50 %
Regierungsbezogen	24,33 %
Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	5,17 %

Für die Zusammenstellung der oben genannten Informationen wurden die Investitionen des Fonds zum 31. Dezember 2022 verwendet.



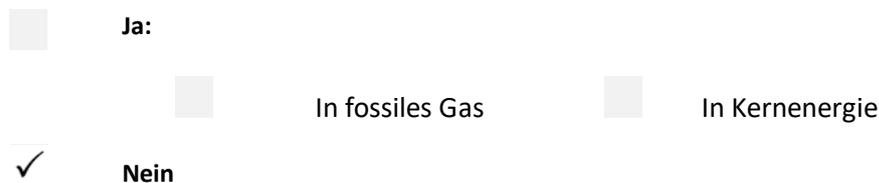
Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Zum 31. Dezember 2022 beträgt der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform sind, 0 %. Diese Zahl wurde weder von einem Wirtschaftsprüfer bestätigt noch von einer anderen dritten Partei überprüft.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil am:

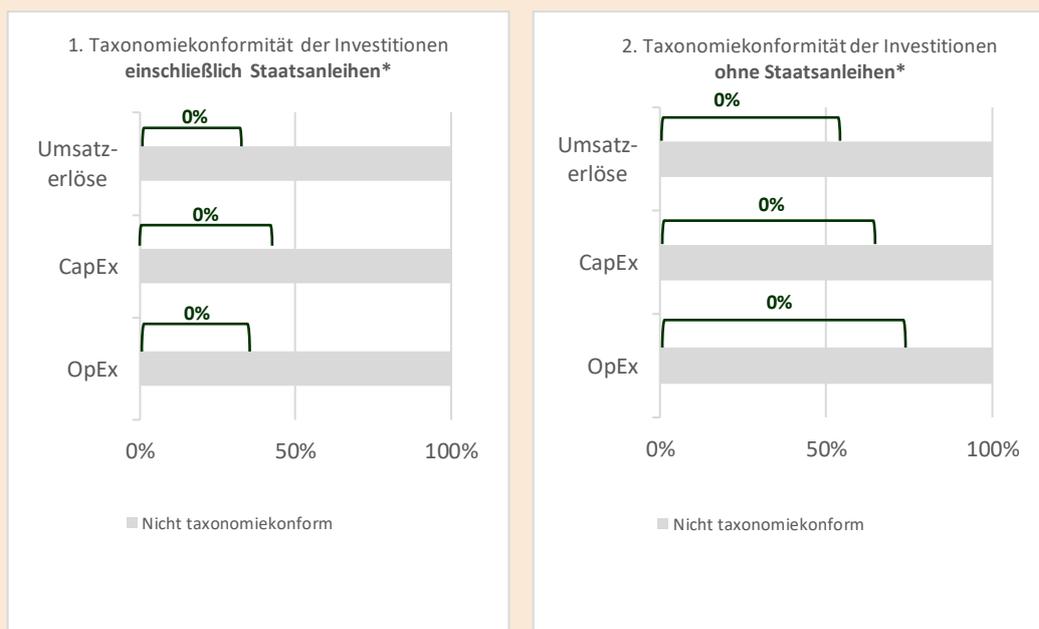
- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft
- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

● **Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert¹?**



¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Zum 31. Dezember 2022 betrug der Anteil der Investitionen des Fonds in Übergangs- und ermöglichende Tätigkeiten während des Bezugszeitraums 0 %.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die **Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Der Fonds verpflichtet sich nicht, in Investitionen zu investieren, die mit der EU-Taxonomie konform sind, sondern verpflichtet sich, in nachhaltige Investitionen zu investieren, die zu einem Umweltziel beitragen. Zum 31. Dezember 2022 betrug der Anteil der nachhaltigen Investitionen des Fonds, die zu einem Umweltziel beitrugen, die nicht anhand der EU-Taxonomie bewertet wurden und daher oben als Investitionen mit „Sonstigen Umweltzielen“ klassifiziert wurden, 21 %. Weitere Informationen über die Verfügbarkeit von Nachhaltigkeitsdaten und die damit verbundenen Herausforderungen finden Sie unter <https://europe.pimco.com/en-eu/our-firm/global-advisors-ireland>.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Wie oben erwähnt, hielt der Fonds 6 % des Nettovermögens in nachhaltigen Investitionen, die während des von diesem Jahresabschluss abgedeckten Zeitraums zu einem sozialen Ziel beitrugen. Da der Fonds keine Verpflichtung eingegangen ist, in nachhaltige Investitionen zu investieren, die zu einem sozialen Ziel beitragen, sollten solche Investitionen als unbeabsichtigt angesehen werden.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Wie oben erwähnt wurde zum 31. Dezember 2022 bei 100 % der Investitionen des Fonds davon ausgegangen, dass sie ökologische und soziale Merkmale bewerben, da alle Investitionen des Fonds anhand seiner Ausschlussstrategie geprüft wurden. Wie oben ausführlicher dargelegt, hatte der Fonds zu diesem Zeitpunkt 27 % seines Nettovermögens in nachhaltige Investitionen investiert.

Infolgedessen gab es zum 31. Dezember 2022 keine Investitionen im Portfolio, die nicht mit den vom Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen konform waren.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Während des Berichtszeitraums hat sich der Anlageberater mit Unternehmen und Emittenten zu wesentlichen klimabezogenen Themen ausgetauscht. Dies beinhaltete die Motivation von Unternehmen, Konformität mit dem Pariser Abkommen anzustreben, sich wissenschaftlich fundierte Ziele für die Reduzierung von Kohlenstoffemissionen zu setzen und/oder ihre Nachhaltigkeitsverpflichtungen auf breiter Basis umzusetzen.

ANHANG IV

Vorlage — Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Emerging Markets Bond ESG Fund

Unternehmenskennung (LEI-Code):
IU161HZ5QHJ5X3UAQ421

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

●● <input type="checkbox"/> Ja	●○ <input checked="" type="checkbox"/> Nein
<p><input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: ___%</p> <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <p><input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: ___%</p>	<p><input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es einen Anteil von 25 % an nachhaltigen Investitionen</p> <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input checked="" type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel** <p><small>** Obwohl der Fonds während des Berichtszeitraums in nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel investiert hat, hat er sich nicht verpflichtet, in diese Anlagekategorie zu investieren, und daher sollten solche vom Fonds erworbenen Investitionen als nebensächliche Investitionen betrachtet werden.</small></p> <p><input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt</p>

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Der Ansatz des Fonds für nachhaltiges Investieren besteht im Bewerben ökologischer und sozialer Merkmale (der Fonds hat nachhaltiges Investieren zwar nicht als Anlageziel, ist aber bestrebt, einen Teil seiner Vermögenswerte in nachhaltige Anlagen zu investieren).

Wie unten beschrieben, trugen die nachhaltigen Investitionen des Fonds während des Bezugszeitraums zu den Umweltzielen der Anpassung an den Klimawandel und der Eindämmung des Klimawandels bei.

Die vom Fonds während des Berichtszeitraums gehaltenen Derivate wurden im Hinblick auf die vom Anlageberater umgesetzte Ausschlusspolitik geprüft und dementsprechend eingesetzt, um die vom Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale zu bewerten.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Der Einfluss des Fonds auf die Nachhaltigkeit wurde durch die Umsetzung der Emittenten-Engagement-Politik des Anlageberaters, die Ausschlussstrategie und die Anlage in bestimmte festverzinsliche ESG-Wertpapiere (wie im Abschnitt „**Festverzinsliche ESG-Wertpapiere**“ des Prospekts näher beschrieben) gemessen, die es Emittenten ermöglichen, Kapital zur Finanzierung von Projekten mit positivem Umweltnutzen zu beschaffen, sowie durch die Verschuldung von Emittenten, die bei der Bewältigung von Risiken und Chancen im Zusammenhang mit dem Klimawandel eine führende Rolle spielen.

Zum Beispiel führt das Screening-Verfahren des Fonds zum Ausschluss bestimmter Sektoren, darunter Emittenten, die in den Bereichen Kohle und Öl tätig sind. Darüber hinaus bezog sich der Anlageberater im Rahmen des Screening-Prozesses des Fonds auf weltweit anerkannte Normen wie die Prinzipien des Global Compact der Vereinten Nationen und die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte, wo dies angemessen war.

● **Welche Ziele wurden mit den nachhaltigen Investitionen, die das Finanzprodukt teilweise getätigt hat, verfolgt und wie haben die nachhaltigen Investitionen zu diesen Zielen beigetragen?**

Die zugrundeliegenden nachhaltigen Investitionen des Fonds trugen während des Berichtszeitraums in erster Linie zu den Umweltzielen Klimaschutz und Anpassung an den Klimawandel bei, was auf verschiedene Weise erreicht wurde, beispielsweise durch die Investition in festverzinsliche ESG-Wertpapiere (wie im Abschnitt „**Festverzinsliche ESG-Wertpapiere**“ des Prospekts näher beschrieben) einschließlich grüner Anleihen.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Die nachhaltigen Investitionen des Fonds wurden daraufhin geprüft, ob sie ein Umweltziel oder ein soziales Ziel erheblich beeinträchtigen. Diese Bewertung erfolgte durch die Anwendung verschiedener negativer Nachhaltigkeitsindikatoren durch den Anlageberater, einschließlich, aber nicht beschränkt auf das Engagement in Kohle und Öl sowie Treibhausgasemissionen.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die Wertpapiere wurden nach dem internen Nachhaltigkeits-Screening-Verfahren des Anlageberaters ausgewählt. Dieser Screening-Prozess beinhaltet die Berücksichtigung negativer Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren, einschließlich des Engagements im Kohle- und Ölsektor und des Engagements in kontroversen Waffen. Der Anlageberater versuchte, die wesentlichen negativen Auswirkungen zu mindern, unter anderem durch Emittentenengagement und Ausschlussüberprüfung.

Waren die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte konform? Einzelheiten:

Der Anlageberater hat sich davon überzeugt, dass nachhaltige Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte konform sind, indem er das Kontroversen-Screening des UNGC (UN Global Compact) sowie andere Instrumente wie ESG-Scores und -Research als Teil des Due-Diligence-Prozesses für Investitionen angewandt hat.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Anlagen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unions-Kriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die Unions-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die Unions-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die wichtigsten negativen Auswirkungen werden als jene Auswirkungen von Investitionsentscheidungen beschrieben, die „zu negativen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren führen“, während Nachhaltigkeitsfaktoren als „ökologische, soziale und Arbeitnehmerbelange, Achtung der Menschenrechte, Bekämpfung von Korruption und Bestechung“ definiert werden.

Der Fonds berücksichtigte die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (einschließlich, aber nicht beschränkt auf das Engagement in Kohle und Öl sowie Treibhausgasemissionen und das Engagement in kontroversen Waffen) während des Bezugszeitraums.

Der Anlageberater war bestrebt, die wichtigsten negativen Auswirkungen als Teil des Investitionsprozesses zu berücksichtigen und nutzte eine Kombination von Methoden, um die wichtigsten negativen Auswirkungen zu mildern, einschließlich des Emittentenengagements und der Ausschlüsse.



Welches sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Größte Investitionen	Sektor	% des Nettovermögens	Land
US-Staatsanleihen 3,250 % fällig 15.05.2042	Regierungsbezogen	2,34 %	USA
US-Staatsanleihen 3,125 % fällig 31.08.2029	Regierungsbezogen	1,44 %	USA
Israelische Staatsanleihen 0,531 % fällig 02.08.2023	Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	1,34 %	Israel
Internationale Staatsanleihe Argentinien 3,500 % fällig 07.09.2041	Aufstrebende Märkte	1,26 %	Argentinien
Internationale Staatsanleihe Ecuador 2,500 % fällig 31.07.2035	Aufstrebende Märkte	1,20 %	Ecuador
Internationale Staatsanleihe Dominikanische Republik 5,875 % fällig am 30.01.2060	Aufstrebende Märkte	1,12 %	Dominikanische Republik
Internationale Staatsanleihe Israel 1,500 % fällig 30.11.2023	Aufstrebende Märkte	1,00 %	Israel
Internationale Staatsanleihe Rumänien 2,124 % fällig 16.07.2031	Aufstrebende Märkte	0,94 %	Rumänien
US-Staatsanleihen 3,375 % fällig 15.08.2042	Regierungsbezogen	0,92 %	USA
Internationale Staatsanleihe Israel 0,150 % fällig 31.07.2023	Aufstrebende Märkte	0,89 %	Israel
Israelische Staatsanleihen 1,837 % fällig 08.02.2023	Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	0,86 %	Israel
Internationale Staatsanleihe Elfenbeinküste 5,250 % fällig 22.03.2030	Aufstrebende Märkte	0,72 %	Elfenbeinküste
Internationale Staatsanleihe Kasachstan 6,500 % fällig 21.07.2045	Aufstrebende Märkte	0,68 %	Kasachstan
Internationale Staatsanleihe Türkei 5,750 % fällig 05.11.2047	Aufstrebende Märkte	0,68 %	Türkei
Israelische Staatsanleihen 1,755 % fällig 07.05.2023	Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	0,67 %	Israel

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: zum 31. Dezember 2022

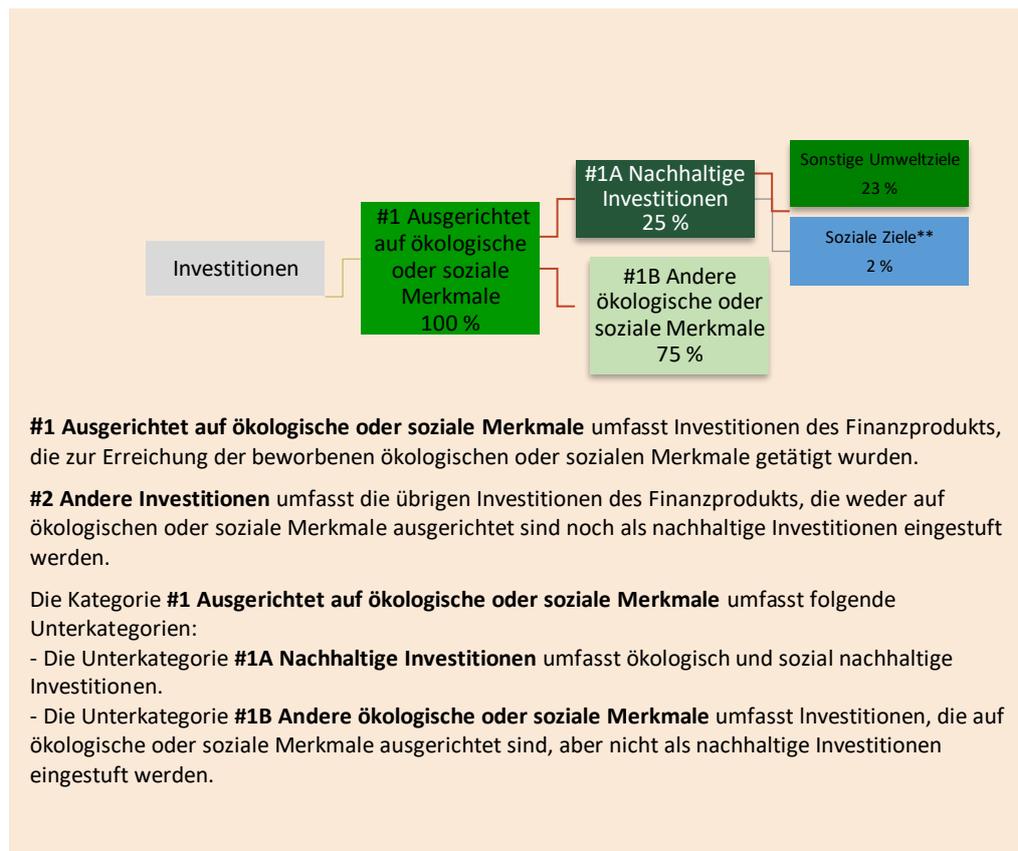
Für die Zusammenstellung der oben genannten Informationen wurden die Investitionen des Fonds zum 31. Dezember 2022 verwendet.



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Nachfolgend finden Sie Informationen über den Anteil des Fonds, der ökologische/soziale Merkmale beworben hat, und den Anteil des Fonds, der zum 31. Dezember 2022 in nachhaltige Investitionen investiert wurde.

● *Wie sah die Vermögensallokation aus?*



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologischen oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Zum 31. Dezember 2022 wurde bei 100 % der Investitionen des Fonds davon ausgegangen, dass sie ökologische und soziale Merkmale bewerben, da alle Investitionen des Fonds anhand seiner Ausschlussstrategie geprüft wurden.

Zu diesem Zeitpunkt hatte der Fonds 25 % seines Nettovermögens in nachhaltige Investitionen investiert. 23 % des Nettovermögens waren in nachhaltige Investitionen investiert, die zu einem Umweltziel beitrugen.

** Darüber hinaus hielt der Fonds 2 % des Nettovermögens in nachhaltigen Investitionen, die zu einem sozialen Ziel beitragen. Es ist zu beachten, dass der Fonds keine Verpflichtung eingegangen ist, in nachhaltige Investitionen zu investieren, die zu einem sozialen Ziel beitragen, und dass solche Investitionen als unbeabsichtigt angesehen werden sollten.

● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Sektor	% des Nettovermögens
Aufstrebende Märkte	65,23 %
USA – Regierungsbezogen	18,38 %
Andere	11,84 %
Investment-Grade-Kredite	9,76 %
Verbriefte	0,44 %
Hochzinskredite	0,44 %
Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	-1,73 %
Nicht-USD Entwickelt	-4,37 %

Für die Zusammenstellung der oben genannten Informationen wurden die Investitionen des Fonds zum 31. Dezember 2022 verwendet.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Zum 31. Dezember 2022 beträgt der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform sind, 0 %. Diese Zahl wurde weder von einem Wirtschaftsprüfer bestätigt noch von einer anderen dritten Partei überprüft.

● **Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomeikonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert¹?**

Ja:

In fossiles Gas In Kernenergie

Nein

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomeikonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomeikonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

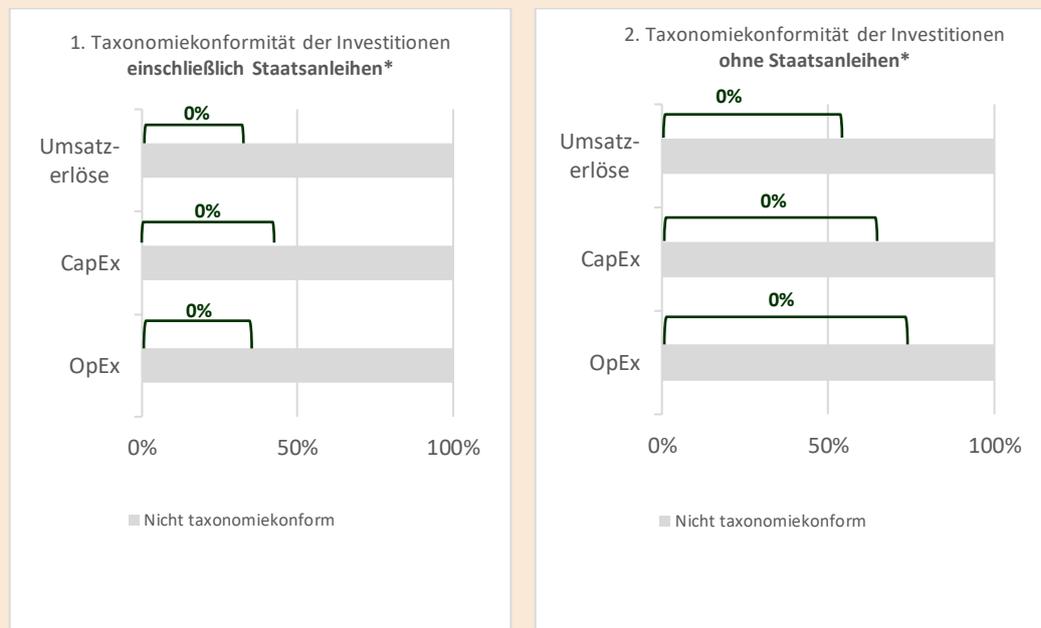
Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu einem Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil am:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Zum 31. Dezember 2022 betrug der Anteil der Investitionen des Fonds in Übergangs- und ermöglichende Tätigkeiten während des Bezugszeitraums 0 %.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Der Fonds verpflichtet sich nicht, in Investitionen zu investieren, die mit der EU-Taxonomie konform sind, sondern verpflichtet sich, in nachhaltige Investitionen zu investieren, die zu einem Umweltziel beitragen. Zum 31. Dezember 2022 betrug der Anteil der nachhaltigen Investitionen des Fonds, die zu einem Umweltziel beitragen, die nicht anhand der EU-Taxonomie bewertet wurden und daher oben als Investitionen mit „Sonstigen Umweltzielen“ klassifiziert wurden, 23 %. Weitere Informationen über die Verfügbarkeit von Nachhaltigkeitsdaten und die damit verbundenen Herausforderungen finden Sie unter <https://europe.pimco.com/en-eu/our-firm/global-advisors-ireland>.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Wie oben erwähnt, hielt der Fonds 2 % des Nettovermögens in nachhaltigen Investitionen, die während des von diesem Jahresabschluss abgedeckten Zeitraums zu einem sozialen Ziel beitragen. Da der Fonds keine Verpflichtung eingegangen ist, in nachhaltige Investitionen zu investieren, die zu einem sozialen Ziel beitragen, sollten solche Investitionen als unbeabsichtigt angesehen werden.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Wie oben erwähnt wurde zum 31. Dezember 2022 bei 100 % der Investitionen des Fonds davon ausgegangen, dass sie ökologische und soziale Merkmale bewerben, da alle Investitionen des Fonds anhand seiner Ausschlussstrategie geprüft wurden. Wie oben ausführlicher dargelegt, hatte der Fonds zu diesem Zeitpunkt 25 % seines Nettovermögens in nachhaltige Investitionen investiert.

Infolgedessen gab es zum 31. Dezember 2022 keine Investitionen im Portfolio, die nicht mit den vom Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen konform waren.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Während des Berichtszeitraums hat sich der Anlageberater mit Unternehmen und Emittenten zu wesentlichen klimabezogenen Themen ausgetauscht. Dies beinhaltete die Motivation von Unternehmen, Konformität mit dem Pariser Abkommen anzustreben, sich wissenschaftlich fundierte Ziele für die Reduzierung von Kohlenstoffemissionen zu setzen und/oder ihre Nachhaltigkeitsverpflichtungen auf breiter Basis umzusetzen.

ANHANG IV

Vorlage — Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: PIMCO ESG Income Fund

Unternehmenskennung (LEI-Code): 549300TKMFF4LMUCRB73

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

●● <input type="checkbox"/> Ja	●○ <input checked="" type="checkbox"/> Nein
<p><input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: ___%</p> <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <p><input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: ___%</p>	<p><input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es einen Anteil von 32 % an nachhaltigen Investitionen</p> <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input checked="" type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel** <p><small>** Obwohl der Fonds während des Berichtszeitraums in nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel investiert hat, hat er sich nicht verpflichtet, in diese Anlagekategorie zu investieren, und daher sollten solche vom Fonds erworbenen Investitionen als nebensächliche Investitionen betrachtet werden.</small></p> <p><input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt</p>

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Der Ansatz des Fonds für nachhaltiges Investieren besteht im Bewerben ökologischer und sozialer Merkmale (der Fonds hat nachhaltiges Investieren zwar nicht als Anlageziel, ist aber bestrebt, einen Teil seiner Vermögenswerte in nachhaltige Anlagen zu investieren).

Wie unten beschrieben, trugen die nachhaltigen Investitionen des Fonds während des Bezugszeitraums zu den Umweltzielen der Anpassung an den Klimawandel und der Eindämmung des Klimawandels bei.

Die vom Fonds während des Berichtszeitraums gehaltenen Derivate wurden im Hinblick auf die vom Anlageberater umgesetzte Ausschlusspolitik geprüft und dementsprechend eingesetzt, um die vom Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale zu bewerten.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Der Einfluss des Fonds auf die Nachhaltigkeit wurde durch die Umsetzung der Emittenten-Engagement-Politik des Anlageberaters, die Ausschlussstrategie und die Anlage in bestimmte festverzinsliche ESG-Wertpapiere (wie im Abschnitt „**Festverzinsliche ESG-Wertpapiere**“ des Prospekts näher beschrieben) gemessen, die es Emittenten ermöglichen, Kapital zur Finanzierung von Projekten mit positivem Umweltnutzen zu beschaffen, sowie durch die Verschuldung von Emittenten, die bei der Bewältigung von Risiken und Chancen im Zusammenhang mit dem Klimawandel eine führende Rolle spielen.

Zum Beispiel führt das Screening-Verfahren des Fonds zum Ausschluss bestimmter Sektoren, darunter Emittenten, die in den Bereichen Kohle und Öl tätig sind. Darüber hinaus bezog sich der Anlageberater im Rahmen des Screening-Prozesses des Fonds auf weltweit anerkannte Normen wie die Prinzipien des Global Compact der Vereinten Nationen und die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte, wo dies angemessen war.

● **Welche Ziele wurden mit den nachhaltigen Investitionen, die das Finanzprodukt teilweise getätigt hat, verfolgt und wie haben die nachhaltigen Investitionen zu diesen Zielen geschadet?**

Die zugrundeliegenden nachhaltigen Investitionen des Fonds trugen während des Berichtszeitraums in erster Linie zu den Umweltzielen Klimaschutz und Anpassung an den Klimawandel bei, was auf verschiedene Weise erreicht wurde, beispielsweise durch die Investition in festverzinsliche ESG-Wertpapiere (wie im Abschnitt „**Festverzinsliche ESG-Wertpapiere**“ des Prospekts näher beschrieben) einschließlich grüner Anleihen.

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltige Anlagezielen nicht erheblich beeinträchtigt?**

Die nachhaltigen Investitionen des Fonds wurden daraufhin geprüft, ob sie ein Umweltziel oder ein soziales Ziel erheblich beeinträchtigen. Diese Bewertung erfolgte durch die Anwendung verschiedener negativer Nachhaltigkeitsindikatoren durch den Anlageberater, einschließlich, aber nicht beschränkt auf das Engagement in Kohle und Öl sowie Treibhausgasemissionen.

— **Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Die Wertpapiere wurden nach dem internen Nachhaltigkeits-Screening-Verfahren des Anlageberaters ausgewählt. Dieser Screening-Prozess beinhaltet die Berücksichtigung negativer Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren, einschließlich des Engagements im Kohle- und Ölsektor und des Engagements in kontroversen Waffen. Der Anlageberater versuchte, die wesentlichen negativen Auswirkungen zu mindern, unter anderem durch Emittentenengagement und Ausschlussüberprüfung.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Waren die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte konform? Einzelheiten:

Der Anlageberater hat sich davon überzeugt, dass nachhaltige Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte konform sind, indem er das Kontroversen-Screening des UNGC (UN Global Compact) sowie andere Instrumente wie ESG-Scores und -Research als Teil des Due-Diligence-Prozesses für Investitionen angewandt hat.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Anlagen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unions-Kriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die Unions-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die Unions-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die wichtigsten negativen Auswirkungen werden als jene Auswirkungen von Investitionsentscheidungen beschrieben, die „zu negativen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren führen“, während Nachhaltigkeitsfaktoren als „ökologische, soziale und Arbeitnehmerbelange, Achtung der Menschenrechte, Bekämpfung von Korruption und Bestechung“ definiert werden.

Der Fonds berücksichtigte die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (einschließlich, aber nicht beschränkt auf das Engagement in Kohle und Öl sowie Treibhausgasemissionen und das Engagement in kontroversen Waffen) während des Bezugszeitraums.

Der Anlageberater war bestrebt, die wichtigsten negativen Auswirkungen als Teil des Investitionsprozesses zu berücksichtigen und nutzte eine Kombination von Methoden, um die wichtigsten negativen Auswirkungen zu mildern, einschließlich des Emittentenengagements und der Ausschlüsse.



Welches sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel zum 31. Dezember 2022:

Größte Investitionen	Sektor	% des Nettovermögens	Land
US-Staatsanleihen 4,386 % fällig 30.03.2023	Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	14,55 %	USA
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fällig 01.02.2053	Verbrieft	6,54 %	USA
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,000 % fällig 01.02.2053	Verbrieft	4,57 %	USA
International Bank for Reconstruction & Development 3,000 % fällig 27.09.2023	Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	4,55 %	Supranational
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig 01.02.2053	Verbrieft	3,83 %	USA
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fällig 01.01.2053	Verbrieft	3,19 %	USA
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,000 % fällig 03.01.2053	Verbrieft	2,92 %	USA
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig 15.01.2032	USA – Regierungsbezogen	2,46 %	USA
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig 02.01.2053	Verbrieft	2,27 %	USA
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 6,000 % fällig 02.01.2053	Verbrieft	1,92 %	USA
EMF-UK PLC 4,491 % fällig 13.03.2046	Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	1,76 %	Vereinigtes Königreich
Towd Point Mortgage Funding PLC 3,596 % fällig 20.10.2051	Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	1,48 %	Vereinigtes Königreich
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 6,000 % fällig 01.01.2053	Verbrieft	1,37 %	USA
Fannie Mae 3,500 % fällig 08.01.2059	Verbrieft	1,30 %	USA
US-Staatsanleihen 4,050 % fällig 26.01.2023	Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	1,26 %	USA

Für die Zusammenstellung der oben genannten Informationen wurden die Investitionen des Fonds zum 31. Dezember 2022 verwendet.



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Nachfolgend finden Sie Informationen über den Anteil des Fonds, der ökologische/soziale Merkmale beworben hat, und den Anteil des Fonds, der zum 31. Dezember 2022 in nachhaltige Investitionen investiert wurde.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

● **Wie sah die Vermögensallokation aus?**



Zum 31. Dezember 2022 wurde bei 100 % der Investitionen des Fonds davon ausgegangen, dass sie ökologische und soziale Merkmale bewerben, da alle Investitionen des Fonds anhand seiner Ausschlussstrategie geprüft wurden.

Zu diesem Zeitpunkt hatte der Fonds 32 % seines Nettovermögens in nachhaltige Investitionen investiert. 30 % des Nettovermögens waren in nachhaltige Investitionen investiert, die zu einem Umweltziel beitragen.

** Darüber hinaus hielt der Fonds 2 % des Nettovermögens in nachhaltigen Investitionen, die zu einem sozialen Ziel beitragen. Es ist zu beachten, dass der Fonds keine Verpflichtung eingegangen ist, in nachhaltige Investitionen zu investieren, die zu einem sozialen Ziel beitragen, und dass solche Investitionen als unbeabsichtigt angesehen werden sollten.

● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Sektor	% des Nettovermögens
Verbrieft	42,87 %
Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	36,04 %
Investment-Grade-Kredite	12,54 %
Hochzinskredite	4,45 %
Aufstrebende Märkte	4,32 %
USA – Regierungsbezogen	3,49 %
Andere	0,23 %
Nicht-USD Entwickelt	-3,94 %

Für die Zusammenstellung der oben genannten Informationen wurden die Investitionen des Fonds zum 31. Dezember 2022 verwendet.

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu einem Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Zum 31. Dezember 2022 beträgt der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform sind, 0 %. Diese Zahl wurde weder von einem Wirtschaftsprüfer bestätigt noch von einer anderen dritten Partei überprüft.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert¹?

Ja:

 In fossiles Gas

 In Kernenergie

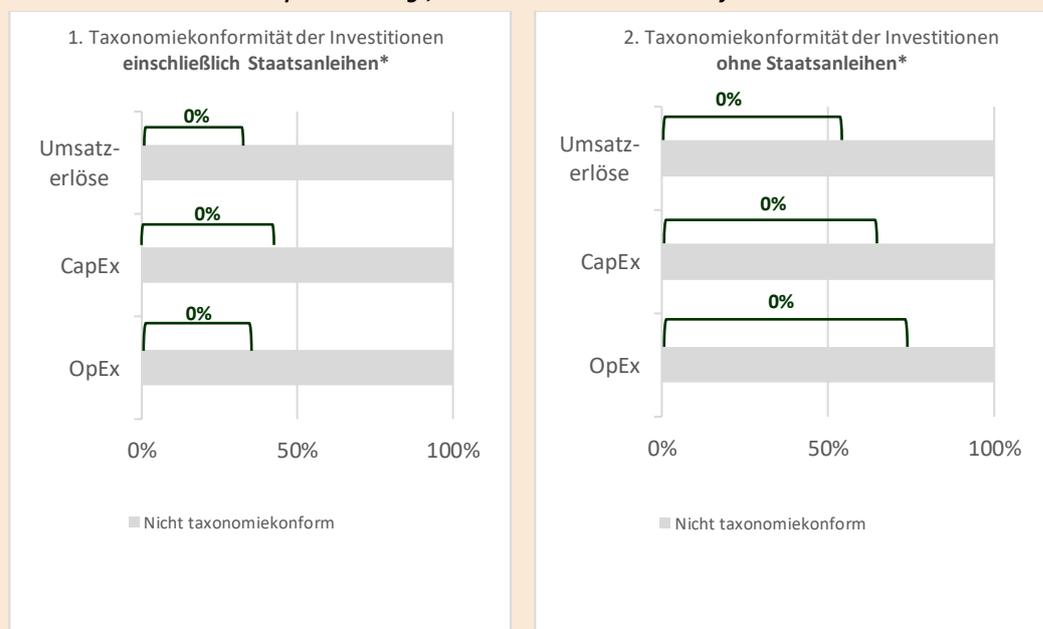
 Nein

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil am:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Zum 31. Dezember 2022 betrug der Anteil der Investitionen des Fonds in Übergangs- und ermöglichende Tätigkeiten während des Bezugszeitraums 0 %.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Der Fonds verpflichtet sich nicht, in Investitionen zu investieren, die mit der EU-Taxonomie konform sind, sondern verpflichtet sich, in nachhaltige Investitionen zu investieren, die zu einem Umweltziel beitragen. Zum 31. Dezember 2022 betrug der Anteil der nachhaltigen Investitionen des Fonds, die zu einem Umweltziel beitrugen, die nicht anhand der EU-Taxonomie bewertet wurden und daher oben als Investitionen mit „Sonstigen Umweltzielen“ klassifiziert wurden, 30 %. Weitere Informationen über die Verfügbarkeit von Nachhaltigkeitsdaten und die damit verbundenen Herausforderungen finden Sie unter <https://europe.pimco.com/en-eu/our-firm/global-advisors-ireland>.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Wie oben erwähnt, hielt der Fonds 2 % des Nettovermögens in nachhaltigen Investitionen, die während des von diesem Jahresabschluss abgedeckten Zeitraums zu einem sozialen Ziel beitrugen. Da der Fonds keine Verpflichtung eingegangen ist, in nachhaltige Investitionen zu investieren, die zu einem sozialen Ziel beitragen, sollten solche Investitionen als unbeabsichtigt angesehen werden.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Wie oben erwähnt wurde zum 31. Dezember 2022 bei 100 % der Investitionen des Fonds davon ausgegangen, dass sie ökologische und soziale Merkmale bewerben, da alle Investitionen des Fonds anhand seiner Ausschlussstrategie geprüft wurden. Wie oben ausführlicher dargelegt, hatte der Fonds zu diesem Zeitpunkt 32 % seines Nettovermögens in nachhaltige Investitionen investiert.

Infolgedessen gab es zum 31. Dezember 2022 keine Investitionen im Portfolio, die nicht mit den vom Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen konform waren.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Während des Berichtszeitraums hat sich der Anlageberater mit Unternehmen und Emittenten zu wesentlichen klimabezogenen Themen ausgetauscht. Dies beinhaltete die Motivation von Unternehmen, Konformität mit dem Pariser Abkommen anzustreben, sich wissenschaftlich fundierte Ziele für die Reduzierung von Kohlenstoffemissionen zu setzen und/oder ihre Nachhaltigkeitsverpflichtungen auf breiter Basis umzusetzen.

 sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.

ANHANG IV

Vorlage — Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Euro Bond Fund

Unternehmenskennung (LEI-Code): U8E5120AOPVSYI2B4U46

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

●● <input type="checkbox"/> Ja	●○ <input checked="" type="checkbox"/> Nein
<input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: ___% <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	<input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es einen Anteil von ___% an nachhaltigen Investitionen <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel
<input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: ___%	<input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Der Fonds bewarb die ökologischen Merkmale durch die Überprüfung aller Direktinvestitionen im Hinblick auf die Ausschlusspolitik des Fonds. Der Fonds hat ökologische Merkmale auch dadurch beworben, dass er sich aktiv mit Emittenten zu wesentlichen klimabezogenen Themen ausgetauscht hat. Dies beinhaltete die Motivation von Unternehmen, Konformität mit dem Pariser Abkommen anzustreben, sich wissenschaftlich fundierte Ziele für die Reduzierung von Kohlenstoffemissionen zu setzen und/oder ihre Nachhaltigkeitsverpflichtungen auf breiter Basis umzusetzen.

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Die nachhaltigkeitsbezogenen Auswirkungen des Fonds wurden anhand der Umsetzung der Engagementpolitik des Anlageberaters in Bezug auf Emittenten und der Ausschlussstrategie gemessen. Die Ausschlussstrategie und das Ausschluss-Screening-Verfahren des Fonds gelten für 100 % seiner Direktanlagen.

Zum Beispiel führt das Screening-Verfahren des Fonds zum Ausschluss bestimmter Sektoren, darunter Emittenten, die in den Bereichen Kohle und nicht-konventionelles Öl (wie arktisches Öl und Ölsande) tätig sind. Darüber hinaus bezog sich der Anlageberater im Rahmen des Screening-Prozesses des Fonds auf weltweit anerkannte Normen wie die Prinzipien des Global Compact der Vereinten Nationen, wo dies angemessen war.



Welches sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Die Liste umfasst den **größten Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten **Investitionen** des Finanzprodukts (Stand: 31. Dezember 2022).

Größte Investitionen	Sektor	% Vermögenswerte	Land
PIMCO ETFs plc – PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF	Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	9,49 %	Irland
Internationale Staatsanleihe Spanien 0,000 % fällig 31.01.2026	Regierungsbezogen	3,73 %	Spanien
Internationale Staatsanleihe Japan 0,100 % fällig 01.03.2023	Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	3,36 %	Japan
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,000% fällig 01.02.2053	Verbrieft	2,96 %	Vereinigte Staaten von Amerika
Japanische Staatsanleihe (0,117) % fällig 20.02.2023	Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	2,69 %	Japan
Nykredit Realkredit A/S 1,000 % fällig 01.10.2050	Investment-Grade-Kredite	1,93 %	Dänemark
Japanische Staatsanleihe (0,160) % fällig am 30.01.2023	Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	1,50 %	Japan
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,625 % due 15.10.2027	Regierungsbezogen	1,47 %	Vereinigte Staaten von Amerika
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,000 % fällig 01.02.2053	Verbrieft	1,40 %	Vereinigte Staaten von Amerika
Japanische Staatsanleihe (0,182) % fällig 20.03.2023	Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	1,27 %	Japan
Internationale Staatsanleihe Spanien 1,450 % fällig 31.10.2027	Regierungsbezogen	1,13 %	Spanien
Stratton Mortgage Funding PLC 3,826 % fällig 20.07.2060	Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	0,91 %	Vereinigtes Königreich
Internationale Staatsanleihe Spanien 1,400 % fällig 30.07.2028	Regierungsbezogen	0,91 %	Spanien
Japanische Staatsanleihe (0,171) % fällig 20.03.2023	Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	0,86 %	Japan
Internationale Staatsanleihe Slowenien 5,250 % fällig 18.02.2024	Regierungsbezogen	0,85 %	Slowenien

Für die Zusammenstellung der oben genannten Informationen wurden die Investitionen des Fonds zum 31. Dezember 2022 verwendet.



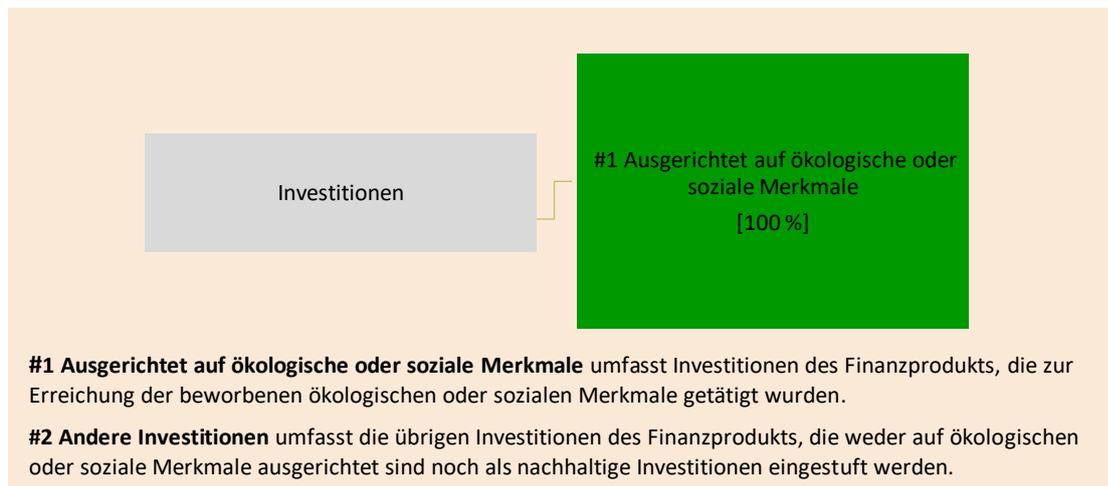
Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Nachfolgend finden Sie Informationen über den Anteil des Fonds, der zum 31. Dezember 2022 ökologische/soziale Merkmale beworben hat.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

● **Wie sah die Vermögensallokation aus?**

Zum 31. Dezember 2022 wurde bei 100 % der Direktinvestitionen des Fonds davon ausgegangen, dass sie ökologische Merkmale bewerben, da die Ausschlussstrategie und das Ausschlusscreening des Fonds auf alle seine Direktinvestitionen angewendet wurden. Ein ökologischer und sozialer Mindestschutz war nur für solche Direktinvestitionen vorgesehen und galt nicht für indirekte Investitionen.



Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu einem Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Sektor	% des Nettovermögens
Regierungsbezogen	63,06 %
Investment-Grade-Kredite	10,63 %
Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	8,05 %
Verbriefte	7,32 %
Gedeckte Schuldverschreibungen (Covered Bonds) und Pfandbriefe	6,02 %
Inflationsgebunden	3,51 %
AM – extern	2,65 %
Hochzinskredite	-1,24 %

Für die Zusammenstellung der oben genannten Informationen wurden die Bestände des Fonds zum 31. Dezember 2022 verwendet.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

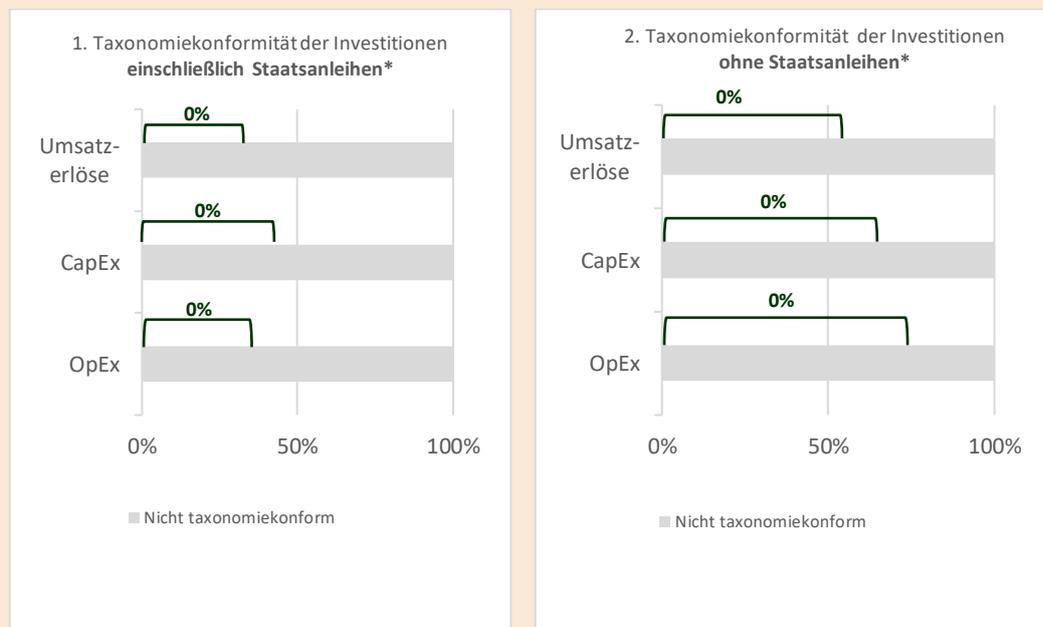
Zum 31. Dezember 2022 beträgt der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform sind, 0 %. Diese Zahl wurde weder von einem Wirtschaftsprüfer bestätigt noch von einer anderen dritten Partei überprüft.

● **Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert¹?**

Ja:
 In fossiles Gas In Kernenergie
 Nein

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.*



* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Zum 31. Dezember 2022 betrug der Anteil der Investitionen des Fonds in Übergangs- und ermöglichende Tätigkeiten während des Bezugszeitraums 0 %.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil am:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Wie oben erwähnt, wurde zum 31. Dezember 2022 bei 100 % der Direktinvestitionen des Fonds davon ausgegangen, dass sie ökologische Merkmale bewerben, da die Ausschlussstrategie und das Ausschlusscreening des Fonds auf alle seine Direktinvestitionen angewendet wurden.

Ein ökologischer und sozialer Mindestschutz war nur für solche Direktinvestitionen vorgesehen und galt nicht für indirekte Investitionen.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Während des Berichtszeitraums hat sich der Anlageberater mit Unternehmen und Emittenten zu wesentlichen klimabezogenen Themen ausgetauscht. Dies beinhaltete die Motivation von Unternehmen, Konformität mit dem Pariser Abkommen anzustreben, sich wissenschaftlich fundierte Ziele für die Reduzierung von Kohlenstoffemissionen zu setzen und/oder ihre Nachhaltigkeitsverpflichtungen auf breiter Basis umzusetzen.

ANHANG IV

Vorlage — Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Euro Credit Fund

Unternehmenskennung (LEI-Code): RJV2Q25HZY9ZSGZSMB60

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

●● <input type="checkbox"/> Ja	●○ <input checked="" type="checkbox"/> Nein
<p><input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: ___%</p> <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <p><input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: ___%</p>	<p><input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es einen Anteil von ___% an nachhaltigen Investitionen</p> <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel <p><input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt</p>

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Der Fonds bewarb die ökologischen Merkmale durch die Überprüfung aller Direktinvestitionen im Hinblick auf die Ausschlusspolitik des Fonds. Der Fonds hat ökologische Merkmale auch dadurch beworben, dass er sich aktiv mit Emittenten zu wesentlichen klimabezogenen Themen ausgetauscht hat. Dies beinhaltete die Motivation von Unternehmen, Konformität mit dem Pariser Abkommen anzustreben, sich wissenschaftlich fundierte Ziele für die Reduzierung von Kohlenstoffemissionen zu setzen und/oder ihre Nachhaltigkeitsverpflichtungen auf breiter Basis umzusetzen.

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Die nachhaltigkeitsbezogenen Auswirkungen des Fonds wurden anhand der Umsetzung der Engagementpolitik des Anlageberaters in Bezug auf Emittenten und der Ausschlussstrategie gemessen. Die Ausschlussstrategie und das Ausschluss-Screening-Verfahren des Fonds gelten für 100 % seiner Direktanlagen.

Zum Beispiel führt das Screening-Verfahren des Fonds zum Ausschluss bestimmter Sektoren, darunter Emittenten, die in den Bereichen Kohle und nicht-konventionelles Öl (wie arktisches Öl und Ölsande) tätig sind. Darüber hinaus bezog sich der Anlageberater im Rahmen des Screening-Prozesses des Fonds auf weltweit anerkannte Normen wie die Prinzipien des Global Compact der Vereinten Nationen, wo dies angemessen war.



Welches sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: zum 31. Dezember 2022

Größte Investitionen	Sektor	% des Nettovermögens	Land
PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF	Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	8,31 %	Irland
UBS Group AG 1,250 % fällig 17.04.2025	Investment-Grade-Kredite	1,97 %	Schweiz
Wells Fargo & Co. 1,000 % fällig 02.02.2027	Investment-Grade-Kredite	1,74 %	USA
Banque Federative du Credit Mutuel S.A. 0,625 % fällig 19.11.2027	Investment-Grade-Kredite	1,71 %	Frankreich
Nationwide Building Society 4,363 % fällig 08.01.2024	Investment-Grade-Kredite	1,55 %	Vereinigtes Königreich
Deutsche Staatsanleihen 0,958 % fällig 18.01.2023	Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	1,51 %	Deutschland
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fällig 01.01.2053	Verbrieft	1,24 %	USA
Nykredit Realkredit A/S 1,000 % fällig 10.01.2050	Investment-Grade-Kredite	1,22 %	Dänemark
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab 1,000 % fällig 10.01.2050	Investment-Grade-Kredite	1,21 %	Dänemark
Santander UK Group Holdings PLC 0,603 % fällig 13.09.2029	Investment-Grade-Kredite	1,20 %	Vereinigtes Königreich
BPCE S.A. 0,500 % fällig 15.09.2027	Investment-Grade-Kredite	1,20 %	Frankreich
BNP Paribas S.A. 1,904 % fällig 30.09.2028	Investment-Grade-Kredite	1,15 %	Frankreich
Barclays PLC 0,577 % fällig 08.09.2029	Investment-Grade-Kredite	1,08 %	Vereinigtes Königreich
Goldman Sachs Group, Inc. 0,875 % fällig 05.09.2029	Investment-Grade-Kredite	1,07 %	USA
Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide 2,125 % fällig 09.07.2027	Investment-Grade-Kredite	1,06 %	Deutschland

Für die Zusammenstellung der oben genannten Informationen wurden die Investitionen des Fonds zum 31. Dezember 2022 verwendet.



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Nachfolgend finden Sie Informationen über den Anteil des Fonds, der zum 31. Dezember 2022 ökologische/soziale Merkmale beworben hat.

● **Wie sah die Vermögensallokation aus?**

Zum 31. Dezember 2022 wurde bei 100 % der Direktinvestitionen des Fonds davon ausgegangen, dass sie ökologische Merkmale beworben, da die Ausschlussstrategie und das Ausschlusscreening des Fonds auf alle seine Direktinvestitionen angewendet wurden. Ein ökologischer und sozialer Mindestschutz war nur für solche Direktinvestitionen vorgesehen und galt nicht für indirekte Investitionen.



● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Sektor	% des Nettovermögens
Investment-Grade-Kredite	60,76 %
Regierungsbezogen	26,71 %
Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	6,14 %
Hochzinskredite	3,34 %
Verbrieft	2,16 %
Aufstrebende Märkte	0,89 %

Für die Zusammenstellung der oben genannten Informationen wurden die Bestände des Fonds zum 31. Dezember 2022 verwendet.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Mit Blick auf die EU-Taxonomie-konformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu einem Umweltzielen leisten.

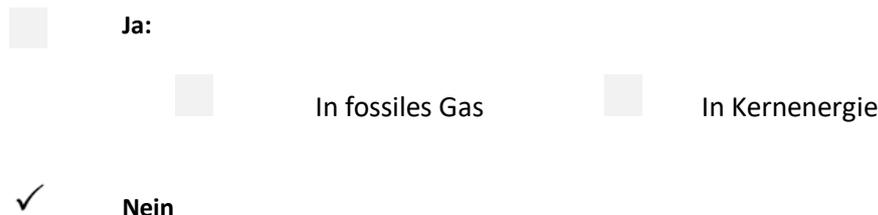
Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgas-emissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

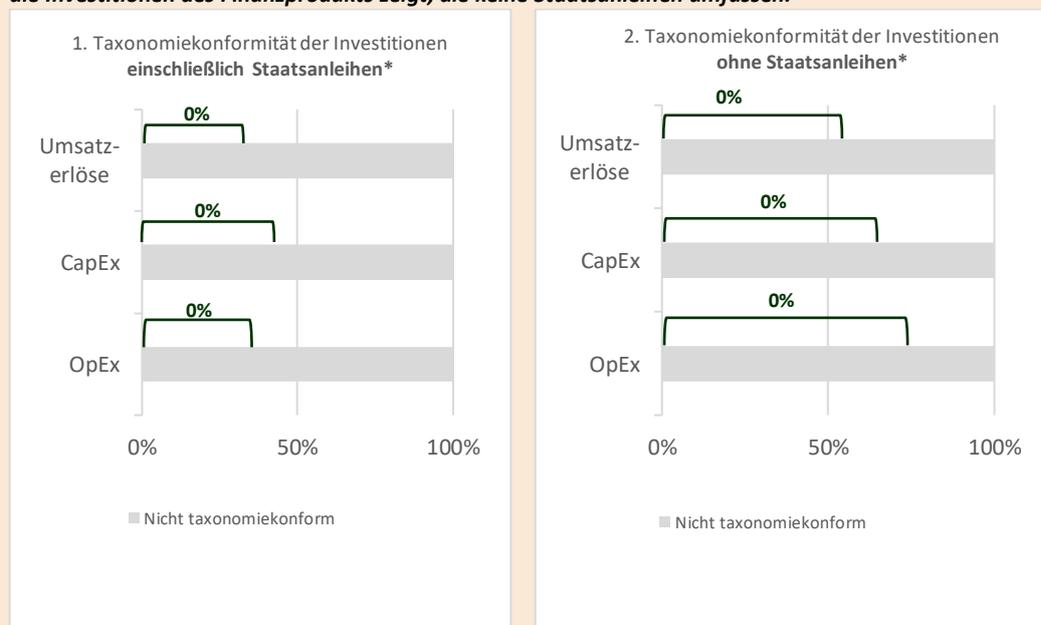
Zum 31. Dezember 2022 beträgt der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform sind, 0 %. Diese Zahl wurde weder von einem Wirtschaftsprüfer bestätigt noch von einer anderen dritten Partei überprüft.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert¹?



¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil am:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Zum 31. Dezember 2022 betrug der Anteil der Investitionen des Fonds in Übergangs- und ermöglichende Tätigkeiten während des Bezugszeitraums 0 %.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Wie oben erwähnt, wurde zum 31. Dezember 2022 bei 100 % der Direktinvestitionen des Fonds davon ausgegangen, dass sie ökologische Merkmale bewerben, da die Ausschlussstrategie und das Ausschlusscreening des Fonds auf alle seine Direktinvestitionen angewendet wurden.

Ein ökologischer und sozialer Mindestschutz war nur für solche Direktinvestitionen vorgesehen und galt nicht für indirekte Investitionen.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Während des Berichtszeitraums hat sich der Anlageberater mit Unternehmen und Emittenten zu wesentlichen klimabezogenen Themen ausgetauscht. Dies beinhaltete die Motivation von Unternehmen, Konformität mit dem Pariser Abkommen anzustreben, sich wissenschaftlich fundierte Ziele für die Reduzierung von Kohlenstoffemissionen zu setzen und/oder ihre Nachhaltigkeitsverpflichtungen auf breiter Basis umzusetzen.

ANHANG IV

Vorlage — Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Euro Income Bond Fund Unternehmenskennung (LEI-Code): SEK18YSZLD2OP25KSR60

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

●● <input type="checkbox"/> Ja	●○ <input checked="" type="checkbox"/> Nein
<input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: ___% <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: ___%	<input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es einen Anteil von ___% an nachhaltigen Investitionen <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel <input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Der Fonds bewarb die ökologischen Merkmale durch die Überprüfung aller Direktinvestitionen im Hinblick auf die Ausschlusspolitik des Fonds. Der Fonds hat ökologische Merkmale auch dadurch beworben, dass er sich aktiv mit Emittenten zu wesentlichen klimabezogenen Themen ausgetauscht hat. Dies beinhaltete die Motivation von Unternehmen, Konformität mit dem Pariser Abkommen anzustreben, sich wissenschaftlich fundierte Ziele für die Reduzierung von Kohlenstoffemissionen zu setzen und/oder ihre Nachhaltigkeitsverpflichtungen auf breiter Basis umzusetzen.

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Die nachhaltigkeitsbezogenen Auswirkungen des Fonds wurden anhand der Umsetzung der Engagementpolitik des Anlageberaters in Bezug auf Emittenten und der Ausschlussstrategie gemessen. Die Ausschlussstrategie und das Ausschluss-Screening-Verfahren des Fonds gelten für 100 % seiner Direktanlagen.

Zum Beispiel führt das Screening-Verfahren des Fonds zum Ausschluss bestimmter Sektoren, darunter Emittenten, die in den Bereichen Kohle und nicht-konventionelles Öl (wie arktisches Öl und Ölsande) tätig sind. Darüber hinaus bezog sich der Anlageberater im Rahmen des Screening-Prozesses des Fonds auf weltweit anerkannte Normen wie die Prinzipien des Global Compact der Vereinten Nationen, wo dies angemessen war.



Welches sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Die Liste umfasst den größten Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts (Stand: 31. Dezember 2022).

Größte Investitionen	Sektor	% des Nettovermögens	Land
PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF	Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	8,87 %	Irland
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fällig 02.01.2053	Verbrieft	3,48 %	USA
Japanische Staatsanleihen (0,179) % fällig 27.03.2023	Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	2,87 %	Japan
Japanische Staatsanleihen (0,198) % fällig 27.03.2023	Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	2,32 %	Japan
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig 02.01.2053	Verbrieft	1,76 %	USA
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,000 % fällig 02.01.2053	Verbrieft	1,53 %	USA
Fairfax Financial Holdings Ltd. 2,750 % fällig 29.03.2028	Investment-Grade-Kredite	1,40 %	Kanada
Nykredit Realkredit A/S 1,000 % fällig 10.01.2053	Investment-Grade-Kredite	1,24 %	Dänemark
PIMCO Funds: Global Investors Series plc – PIMCO European High Yield Bond Fund	Hochzinskredite	1,09 %	Irland
Lincoln Financing SARL 3,625 % fällig 04.01.2024	Hochzinskredite	1,05 %	Luxemburg
HSBC Holdings Plc 1,589 % fällig 24.05.2027	Investment-Grade-Kredite	1,05 %	Vereinigtes Königreich
Loxam S.A.S. 3,250 % fällig 14.01.2025	Hochzinskredite	1,03 %	Frankreich
Französische Staatsanleihen 0,253 % fällig 01.04.2023	Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	1,01 %	Frankreich
Societa per Azioni Esercizi Aeroportuali SEA SpA 3,500 % fällig 09.10.2025	Hochzinskredite	0,96 %	Italien
Syngenta Finance NV 3,375 % fällig 16.04.2026	Investment-Grade-Kredit	0,95 %	Niederlande

Für die Zusammenstellung der oben genannten Informationen wurden die Investitionen des Fonds zum 31. Dezember 2022 verwendet.

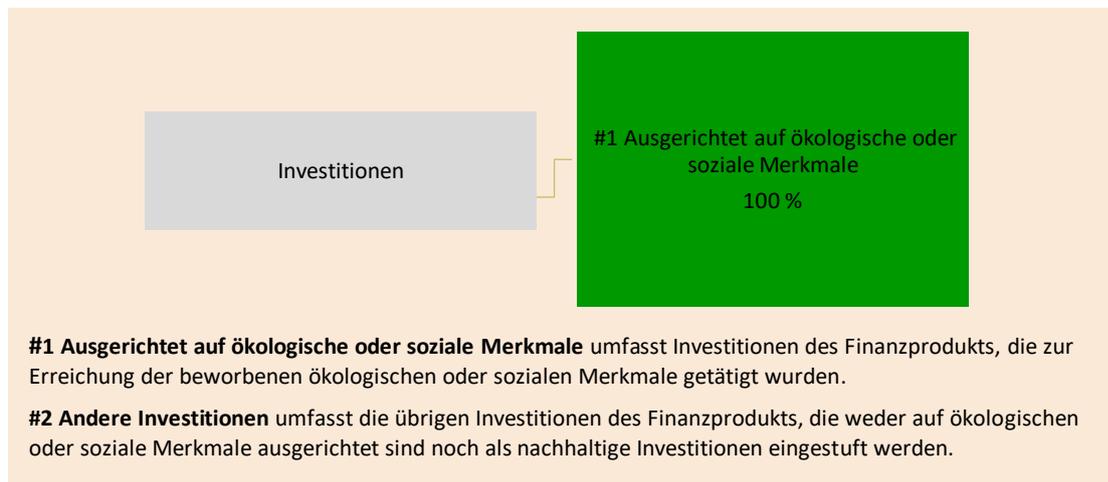


Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Nachfolgend finden Sie Informationen über den Anteil des Fonds, der zum 31. Dezember 2022 ökologische/soziale Merkmale beworben hat.

● **Wie sah die Vermögensallokation aus?**

Zum 31. Dezember 2022 wurde bei 100 % der Direktinvestitionen des Fonds davon ausgegangen, dass sie ökologische Merkmale bewerben, da die Ausschlussstrategie und das Ausschlusscreening des Fonds auf alle seine Direktinvestitionen angewendet wurden. Ein ökologischer und sozialer Mindestschutz war nur für solche Direktinvestitionen vorgesehen und galt nicht für indirekte Investitionen.



● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Sektor	% des Nettovermögens
Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	66,61 %
Investment-Grade-Kredite	32,98 %
Hochzinskredite	20,82 %
Verbrieft	10,00 %
Aufstrebender Markt	2,25 %
Regierungsbezogen	-32,66 %

Für die Zusammenstellung der oben genannten Informationen wurden die Bestände des Fonds zum 31. Dezember 2022 verwendet.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Zum 31. Dezember 2022 beträgt der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform sind, 0 %. Diese Zahl wurde weder von einem Wirtschaftsprüfer bestätigt noch von einer anderen dritten Partei überprüft.

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu einem Umweltzielen leisten.

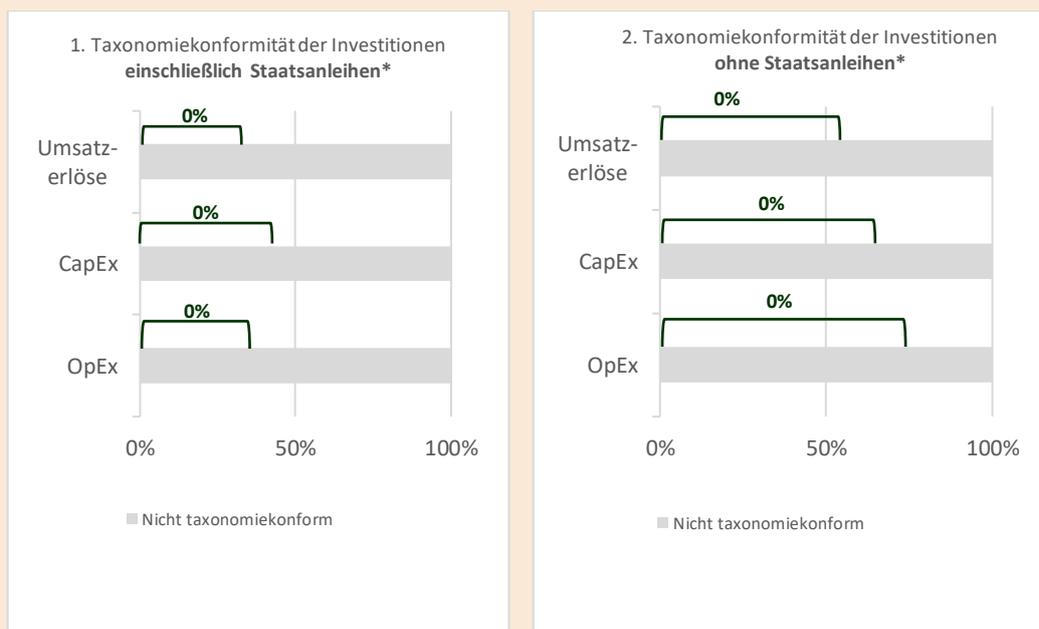
Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

● **Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert¹?**

Ja:
 In fossiles Gas In Kernenergie
 Nein

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Zum 31. Dezember 2022 betrug der Anteil der Investitionen des Fonds in Übergangs- und ermöglichende Tätigkeiten während des Bezugszeitraums 0 %.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil am:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Wie oben erwähnt, wurde zum 31. Dezember 2022 bei 100 % der Direktinvestitionen des Fonds davon ausgegangen, dass sie ökologische Merkmale bewerben, da die Ausschlussstrategie und das Ausschlusscreening des Fonds auf alle seine Direktinvestitionen angewendet wurden.

Ein ökologischer und sozialer Mindestschutz war nur für solche Direktinvestitionen vorgesehen und galt nicht für indirekte Investitionen.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Während des Berichtszeitraums hat sich der Anlageberater mit Unternehmen und Emittenten zu wesentlichen klimabezogenen Themen ausgetauscht. Dies beinhaltete die Motivation von Unternehmen, Konformität mit dem Pariser Abkommen anzustreben, sich wissenschaftlich fundierte Ziele für die Reduzierung von Kohlenstoffemissionen zu setzen und/oder ihre Nachhaltigkeitsverpflichtungen auf breiter Basis umzusetzen.

ANHANG IV

Vorlage — Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Euro Short-Term Fund Unternehmenskennung (LEI-Code): U9SVFXJNHFFXARCR1V87

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: ___%

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: ___%

Nein

Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es einen Anteil von ___% an nachhaltigen Investitionen

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Der Fonds bewarb die ökologischen Merkmale durch die Überprüfung aller Direktinvestitionen im Hinblick auf die Ausschlusspolitik des Fonds. Der Fonds hat ökologische Merkmale auch dadurch beworben, dass er sich aktiv mit Emittenten zu wesentlichen klimabezogenen Themen ausgetauscht hat. Dies beinhaltete die Motivation von Unternehmen, Konformität mit dem Pariser Abkommen anzustreben, sich wissenschaftlich fundierte Ziele für die Reduzierung von Kohlenstoffemissionen zu setzen und/oder ihre Nachhaltigkeitsverpflichtungen auf breiter Basis umzusetzen.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Die nachhaltigkeitsbezogenen Auswirkungen des Fonds wurden anhand der Umsetzung der Engagementpolitik des Anlageberaters in Bezug auf Emittenten und der Ausschlussstrategie gemessen. Die Ausschlussstrategie und das Ausschluss-Screening-Verfahren des Fonds gelten für 100 % seiner Direktanlagen.

Zum Beispiel führt das Screening-Verfahren des Fonds zum Ausschluss bestimmter Sektoren, darunter Emittenten, die in den Bereichen Kohle und nicht-konventionelles Öl (wie arktisches Öl und Ölsande) tätig sind. Darüber hinaus bezog sich der Anlageberater im Rahmen des Screening-Prozesses des Fonds auf weltweit anerkannte Normen wie die Prinzipien des Global Compact der Vereinten Nationen, wo dies angemessen war.



Welches sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Die Liste umfasst den **größten Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten **Investitionen** des Finanzprodukts (Stand: 31. Dezember 2022).

Größte Investitionen	Sektor	% des Nettovermögens	Land
Japanische Staatsanleihen (0,209) % fällig 01.06.2023	Regierungsbezogen	2,68 %	Japan
Japanische Staatsanleihen (0,159) % fällig am 23.01.2023	Regierungsbezogen	2,42 %	Japan
Sumitomo Mitsui Banking Corp. 0,550 % fällig 11.06.2023	Investment-Grade-Kredite	2,02 %	Japan
BNZ International Funding Ltd. 0,625 % fällig 07.03.2025	Investment-Grade-Kredite	1,66 %	Neuseeland
Bank of China Ltd. 3,772 % fällig 08.10.2023	Aufstrebende Märkte	1,59 %	China
Korea Housing Finance Corp. 0,723 % fällig 22.03.2025	Regierungsbezogen	1,51 %	Südkorea
Trinity Square PLC 3,729 % fällig 15.07.2059	Verbrieft	1,50 %	Vereinigtes Königreich
AMCO - Asset Management Co. SpA 1,500 % fällig 17.07.2023	Regierungsbezogen	1,18 %	Italien
Avon Finance PLC 4,331 % fällig 20.09.2048	Verbrieft	1,09 %	Vereinigtes Königreich
Dexia Credit Local S.A. 0,250 % fällig 06.01.2023	Regierungsbezogen	1,07 %	Frankreich
Bain Capital Euro CLO DAC 2,196 % fällig 20.01.2032	Verbrieft	1,05 %	Irland
Japanische Staatsanleihen (0,191) % fällig 01.06.2023	Regierungsbezogen	1,00 %	Japan
Freddie Mac 0,800 % fällig 28.10.2026	Regierungsbezogen	0,97 %	USA
Virgin Money UK PLC 0,375 % fällig 27.05.2024	Investment-Grade-Kredite	0,95 %	Vereinigtes Königreich
Stratton Mortgage Funding PLC 3,826 % fällig 20.07.2060	Verbrieft	0,94 %	Vereinigtes Königreich

Für die Zusammenstellung der oben genannten Informationen wurden die Investitionen des Fonds zum 31. Dezember 2022 verwendet.

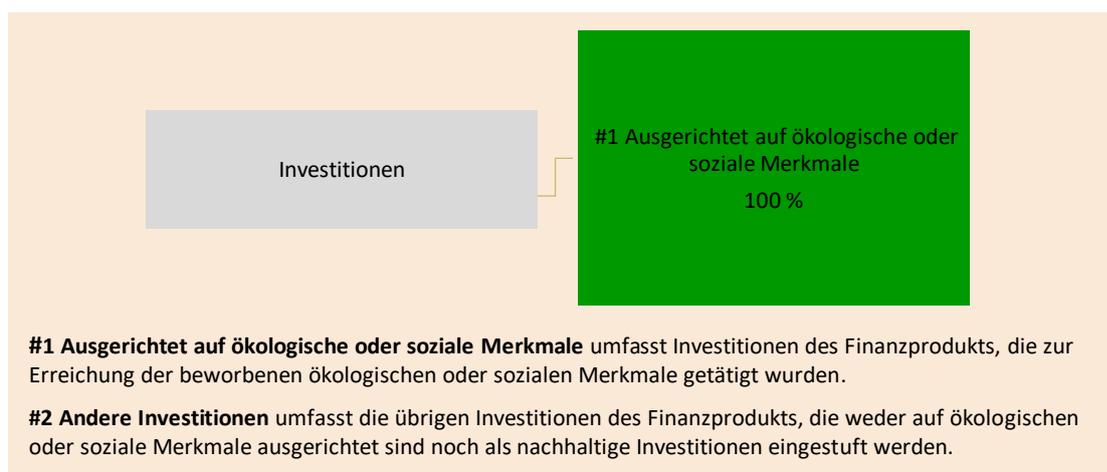


Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Nachfolgend finden Sie Informationen über den Anteil des Fonds, der zum 31. Dezember 2022 ökologische/soziale Merkmale beworben hat.

● **Wie sah die Vermögensallokation aus?**

Zum 31. Dezember 2022 wurde bei 100 % der Direktinvestitionen des Fonds davon ausgegangen, dass sie ökologische Merkmale bewerben, da die Ausschlussstrategie und das Ausschlusscreening des Fonds auf alle seine Direktinvestitionen angewendet wurden. Ein ökologischer und sozialer Mindestschutz war nur für solche Direktinvestitionen vorgesehen und galt nicht für indirekte Investitionen.



● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Sektor	% des Nettovermögens
Investment-Grade-Kredite	48,96 %
Verbriefte	21,53 %
Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	16,09 %
Regierungsbezogen	8,62 %
Hochzinskredite	2,77 %
Aufstrebende Märkte	2,03 %

Für die Zusammenstellung der oben genannten Informationen wurden die Bestände des Fonds zum 31. Dezember 2022 verwendet.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Zum 31. Dezember 2022 beträgt der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform sind, 0 %. Diese Zahl wurde weder von einem Wirtschaftsprüfer bestätigt noch von einer anderen dritten Partei überprüft.

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu einem Umweltziel leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

● **Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert¹?**

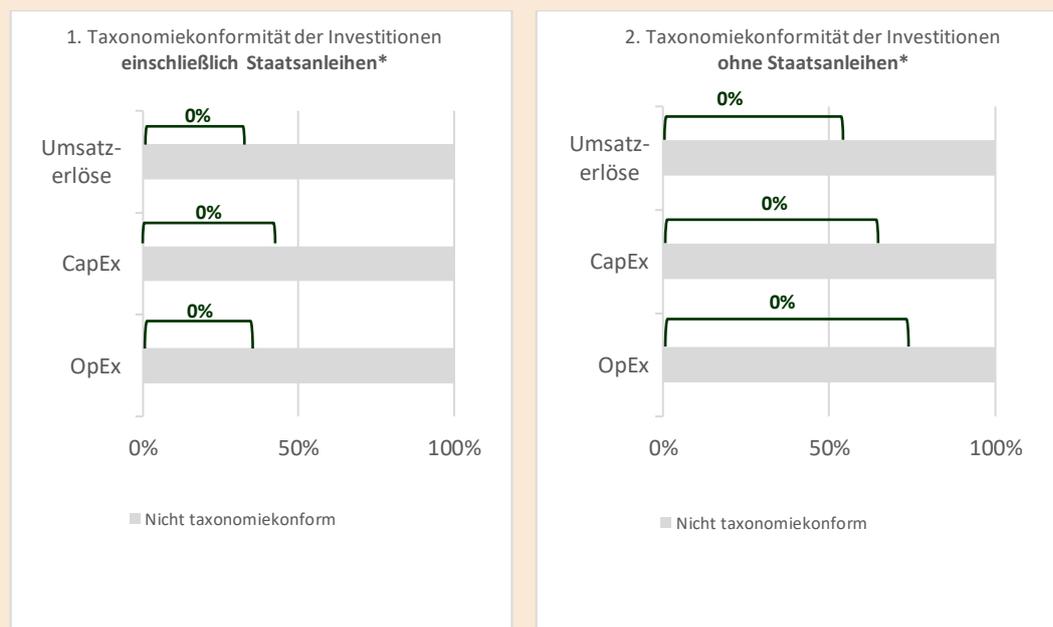


¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil am:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.*



* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Zum 31. Dezember 2022 betrug der Anteil der Investitionen des Fonds in Übergangs- und ermöglichende Tätigkeiten während des Bezugszeitraums 0 %.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Wie oben erwähnt, wurde zum 31. Dezember 2022 bei 100 % der Direktinvestitionen des Fonds davon ausgegangen, dass sie ökologische Merkmale bewerben, da die Ausschlussstrategie und das Ausschlusscreening des Fonds auf alle seine Direktinvestitionen angewendet wurden.

Ein ökologischer und sozialer Mindestschutz war nur für solche Direktinvestitionen vorgesehen und galt nicht für indirekte Investitionen.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Während des Berichtszeitraums hat sich der Anlageberater mit Unternehmen und Emittenten zu wesentlichen klimabezogenen Themen ausgetauscht. Dies beinhaltete die Motivation von Unternehmen, Konformität mit dem Pariser Abkommen anzustreben, sich wissenschaftlich fundierte Ziele für die Reduzierung von Kohlenstoffemissionen zu setzen und/oder ihre Nachhaltigkeitsverpflichtungen auf breiter Basis umzusetzen.

ANHANG IV

Vorlage — Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Global Bond ESG Fund

Unternehmenskennung (LEI-Code):

549300PFJAUUMMOPU079

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

●● <input type="checkbox"/> Ja	●○ <input checked="" type="checkbox"/> Nein
<p><input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: ___%</p> <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind 	<p><input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es einen Anteil von 15 % an nachhaltigen Investitionen</p> <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input checked="" type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel** <p><small>** Obwohl der Fonds während des Berichtszeitraums in nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel investiert hat, hat er sich nicht verpflichtet, in diese Anlagekategorie zu investieren, und daher sollten solche vom Fonds erworbenen Investitionen als nebensächliche Investitionen betrachtet werden.</small></p>
<p><input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: ___%</p>	<p><input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt</p>

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Der Ansatz des Fonds für nachhaltiges Investieren besteht im Bewerben ökologischer und sozialer Merkmale (der Fonds hat nachhaltiges Investieren zwar nicht als Anlageziel, ist aber bestrebt, einen Teil seiner Vermögenswerte in nachhaltige Anlagen zu investieren).

Wie unten beschrieben, trugen die nachhaltigen Investitionen des Fonds während des Bezugszeitraums zu den Umweltzielen der Anpassung an den Klimawandel und der Eindämmung des Klimawandels bei.

Die vom Fonds während des Berichtszeitraums gehaltenen Derivate wurden im Hinblick auf die vom Anlageberater umgesetzte Ausschlusspolitik geprüft und dementsprechend eingesetzt, um die vom Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale zu bewerten.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Der Einfluss des Fonds auf die Nachhaltigkeit wurde durch die Umsetzung der Emittenten-Engagement-Politik des Anlageberaters, die Ausschlussstrategie und die Anlage in bestimmte festverzinsliche ESG-Wertpapiere (wie im Abschnitt „**Festverzinsliche ESG-Wertpapiere**“ des Prospekts näher beschrieben) gemessen, die es Emittenten ermöglichen, Kapital zur Finanzierung von Projekten mit positivem Umweltnutzen zu beschaffen, sowie durch die Verschuldung von Emittenten, die bei der Bewältigung von Risiken und Chancen im Zusammenhang mit dem Klimawandel eine führende Rolle spielen.

Zum Beispiel führt das Screening-Verfahren des Fonds zum Ausschluss bestimmter Sektoren, darunter Emittenten, die in den Bereichen Kohle und Öl tätig sind. Darüber hinaus bezog sich der Anlageberater im Rahmen des Screening-Prozesses des Fonds auf weltweit anerkannte Normen wie die Prinzipien des Global Compact der Vereinten Nationen und die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte, wo dies angemessen war.

● **Welche Ziele wurden mit den nachhaltigen Investitionen, die das Finanzprodukt teilweise getätigt hat, verfolgt und wie haben die nachhaltigen Investitionen zu diesen Zielen beigetragen?**

Die zugrundeliegenden nachhaltigen Investitionen des Fonds trugen während des Berichtszeitraums in erster Linie zu den Umweltzielen Klimaschutz und Anpassung an den Klimawandel bei, was auf verschiedene Weise erreicht wurde, beispielsweise durch die Investition in festverzinsliche ESG-Wertpapiere (wie im Abschnitt „**Festverzinsliche ESG-Wertpapiere**“ des Prospekts näher beschrieben) einschließlich grüner Anleihen.

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Die nachhaltigen Investitionen des Fonds wurden daraufhin geprüft, ob sie ein Umweltziel oder ein soziales Ziel erheblich beeinträchtigen. Diese Bewertung erfolgte durch die Anwendung verschiedener negativer Nachhaltigkeitsindikatoren durch den Anlageberater, einschließlich, aber nicht beschränkt auf das Engagement in Kohle und Öl sowie Treibhausgasemissionen.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die Wertpapiere wurden nach dem internen Nachhaltigkeits-Screening-Verfahren des Anlageberaters ausgewählt. Dieser Screening-Prozess beinhaltet die Berücksichtigung negativer Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren, einschließlich des Engagements im Kohle- und Ölsektor und des Engagements in kontroversen Waffen. Der Anlageberater versuchte, die wesentlichen negativen Auswirkungen zu mindern, unter anderem durch Emittentenengagement und Ausschlussüberprüfung.

Waren die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte konform? Einzelheiten:

Der Anlageberater hat sich davon überzeugt, dass nachhaltige Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte konform sind, indem er das Kontroversen-Screening des UNGC (UN Global Compact) sowie andere Instrumente wie ESG-Scores und -Research als Teil des Due-Diligence-Prozesses für Investitionen angewandt hat.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Anlagen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unions-Kriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die Unions-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die Unions-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die wichtigsten negativen Auswirkungen werden als jene Auswirkungen von Investitionsentscheidungen beschrieben, die „zu negativen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren führen“, während Nachhaltigkeitsfaktoren als „ökologische, soziale und Arbeitnehmerbelange, Achtung der Menschenrechte, Bekämpfung von Korruption und Bestechung“ definiert werden.

Der Fonds berücksichtigte die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (einschließlich, aber nicht beschränkt auf das Engagement in Kohle und Öl sowie Treibhausgasemissionen und das Engagement in kontroversen Waffen) während des Bezugszeitraums.

Der Anlageberater war bestrebt, die wichtigsten negativen Auswirkungen als Teil des Investitionsprozesses zu berücksichtigen und nutzte eine Kombination von Methoden, um die wichtigsten negativen Auswirkungen zu mildern, einschließlich des Emittentenengagements und der Ausschlüsse.



Welches sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts** entfiel: zum 31. Dezember 2022

Größte Investitionen	Sektor	% des Nettovermögens	Land
US-Staatsanleihen 4,389 % fällig 30.03.2023	Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	6,68 %	USA
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,000 % fällig 01.01.2053	Verbrieft	3,51 %	USA
Japanische Staatsanleihen (0,146) % fällig 02.06.2023	Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	3,16 %	Japan
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig 01.01.2053	Verbrieft	2,94 %	USA
Japanische Staatsanleihen (0,111) % fällig 20.02.2023	Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	2,47 %	Japan
Japanische Staatsanleihen (0,118) % fällig 13.02.2023	Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	2,11 %	Japan
Japanische Staatsanleihen (0,209) % fällig 01.06.2023	Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	1,99 %	Japan
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,000 % fällig 01.01.2053	Verbrieft	1,95 %	USA
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig 01.02.2053	Verbrieft	1,70 %	USA
Bundesrepublik Deutschland 0,000 % fällig 15.08.2031	Regierungsbezogen	1,49 %	Deutschland
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,500 % fällig 01.01.2053	Verbrieft	1,49 %	USA
Japanische Staatsanleihen (0,129) % fällig 13.02.2023	Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	1,39 %	Japan
Japanische Staatsanleihen (0,182) % fällig 20.03.2023	Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	1,27 %	Japan
Israelische Staatsanleihen 0,532 % fällig 02.08.2023	Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	1,26 %	Israel
Japanische Staatsanleihen (0,203) % fällig 16.01.2023	Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	1,18 %	Japan

Für die Zusammenstellung der oben genannten Informationen wurden die Investitionen des Fonds zum 31. Dezember 2022 verwendet.

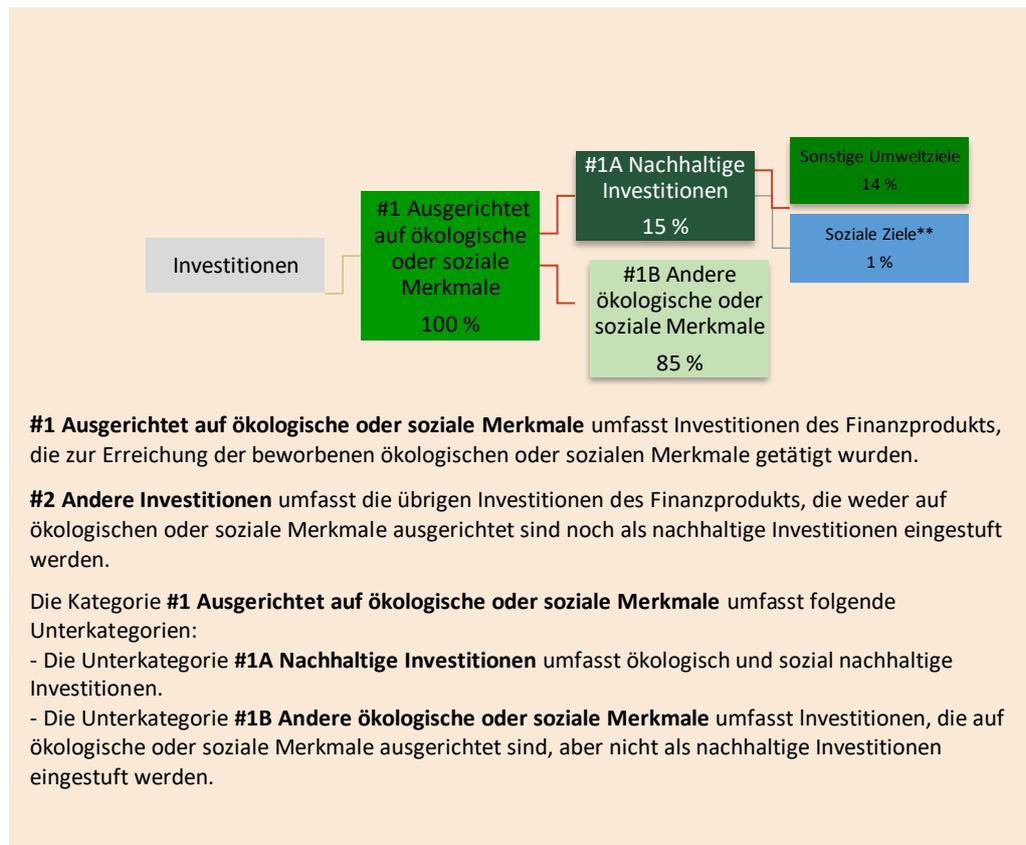


Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Nachfolgend finden Sie Informationen über den Anteil des Fonds, der ökologische/soziale Merkmale beworben hat, und den Anteil des Fonds, der zum 31. Dezember 2022 in nachhaltige Investitionen investiert wurde.

● Wie sah die Vermögensallokation aus?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.



Zum 31. Dezember 2022 wurde bei 100 % der Investitionen des Fonds davon ausgegangen, dass sie ökologische und soziale Merkmale bewerben, da alle Investitionen des Fonds anhand seiner Ausschlussstrategie geprüft wurden.

Zu diesem Zeitpunkt hatte der Fonds 15 % seines Nettovermögens in nachhaltige Investitionen investiert. 14 % des Nettovermögens waren in nachhaltige Investitionen investiert, die zu einem Umweltziel beitrugen.

** Darüber hinaus hielt der Fonds 1 % des Nettovermögens in nachhaltigen Investitionen, die zu einem sozialen Ziel beitragen. Es ist zu beachten, dass der Fonds keine Verpflichtung eingegangen ist, in nachhaltige Investitionen zu investieren, die zu einem sozialen Ziel beitragen, und dass solche Investitionen als unbeabsichtigt angesehen werden sollten.

● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Sektor	% des Nettovermögens
Regierungsbezogen	43,70 %
Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	16,61 %
Verbriefte	16,52 %
Investment-Grade-Kredite	11,27 %
Aufstrebender Markt – extern	5,19 %
Gedeckte Schuldverschreibungen (Covered Bonds) und Pfandbriefe	2,08 %
Inflationsgebunden	1,99 %
Emerging Market Local	1,57 %
Hochzinskredite	0,88 %
Kommunen	0,19 %

Für die Zusammenstellung der oben genannten Informationen wurden die Investitionen des Fonds zum 31. Dezember 2022 verwendet.



● **Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?**

Zum 31. Dezember 2022 beträgt der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform sind, 0 %. Diese Zahl wurde weder von einem Wirtschaftsprüfer bestätigt noch von einer anderen dritten Partei überprüft.

● **Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert¹?**

Ja:

In fossiles Gas In Kernenergie

Nein

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Mit Blick auf die EU-Taxonomekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

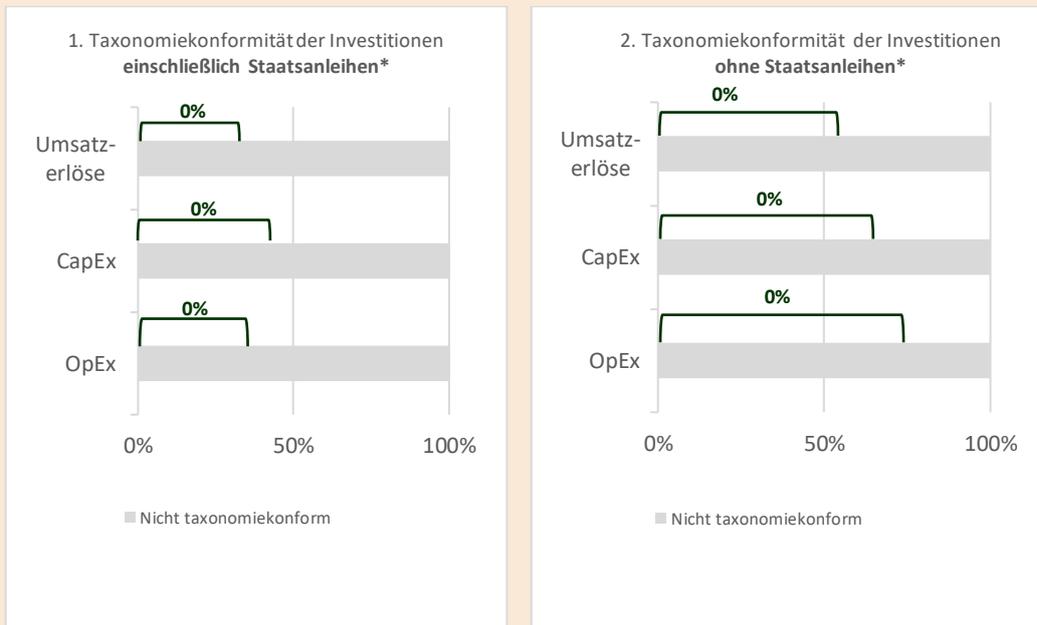
Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu einem Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionsswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil am:

- **Umsatz** spiegelt den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, wider
- **Investitionsausgaben** (CapEx) zeigen die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, zum Beispiel für den Übergang zu einer umweltfreundlichen Wirtschaft.
- **Operative Ausgaben** (OpEx) spiegeln die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, wider.

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxoniekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Zum 31. Dezember 2022 betrug der Anteil der Investitionen des Fonds in Übergangs- und ermöglichende Tätigkeiten während des Bezugszeitraums 0 %.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Der Fonds verpflichtet sich nicht, in Investitionen zu investieren, die mit der EU-Taxonomie konform sind, sondern verpflichtet sich, in nachhaltige Investitionen zu investieren, die zu einem Umweltziel beitragen. Zum 31. Dezember 2022 betrug der Anteil der nachhaltigen Investitionen des Fonds, die zu einem Umweltziel beitragen, die nicht anhand der EU-Taxonomie bewertet wurden und daher oben als Investitionen mit „Sonstigen Umweltzielen“ klassifiziert wurden, 14 %. Weitere Informationen über die Verfügbarkeit von Nachhaltigkeitsdaten und die damit verbundenen Herausforderungen finden Sie unter <https://europe.pimco.com/en-eu/our-firm/global-advisors-ireland>.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Wie oben erwähnt, hielt der Fonds 1 % des Nettovermögens in nachhaltigen Investitionen, die während des von diesem Jahresabschluss abgedeckten Zeitraums zu einem sozialen Ziel beitragen. Da der Fonds keine Verpflichtung eingegangen ist, in nachhaltige Investitionen zu investieren, die zu einem sozialen Ziel beitragen, sollten solche Investitionen als unbeabsichtigt angesehen werden.

 sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Wie oben erwähnt wurde zum 31. Dezember 2022 bei 100 % der Investitionen des Fonds davon ausgegangen, dass sie ökologische und soziale Merkmale bewerben, da alle Investitionen des Fonds anhand seiner Ausschlussstrategie geprüft wurden. Wie oben ausführlicher dargelegt, hatte der Fonds zu diesem Zeitpunkt 15 % seines Nettovermögens in nachhaltige Investitionen investiert.

Infolgedessen gab es zum 31. Dezember 2022 keine Investitionen im Portfolio, die nicht mit den vom Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen konform waren.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Während des Berichtszeitraums hat sich der Anlageberater mit Unternehmen und Emittenten zu wesentlichen klimabezogenen Themen ausgetauscht. Dies beinhaltete die Motivation von Unternehmen, Konformität mit dem Pariser Abkommen anzustreben, sich wissenschaftlich fundierte Ziele für die Reduzierung von Kohlenstoffemissionen zu setzen und/oder ihre Nachhaltigkeitsverpflichtungen auf breiter Basis umzusetzen.

ANHANG IV

Vorlage — Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts:
Global Investment Grade Credit ESG Fund

Unternehmenskennung (LEI-Code):
5493005HZUTWLN5JSJ59

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

●● <input type="checkbox"/> Ja	●○ <input checked="" type="checkbox"/> Nein
<p><input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: ___%</p> <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <p><input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: ___%</p>	<p><input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es einen Anteil von 60 % an nachhaltigen Investitionen</p> <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input checked="" type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel** <p><small>** Obwohl der Fonds während des Berichtszeitraums in nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel investiert hat, hat er sich nicht verpflichtet, in diese Anlagekategorie zu investieren, und daher sollten solche vom Fonds erworbenen Investitionen als nebensächliche Investitionen betrachtet werden.</small></p> <p><input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt</p>

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrenswesen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Der Ansatz des Fonds für nachhaltiges Investieren besteht im Bewerben ökologischer und sozialer Merkmale (der Fonds hat nachhaltiges Investieren zwar nicht als Anlageziel, ist aber bestrebt, einen Teil seiner Vermögenswerte in nachhaltige Anlagen zu investieren).

Wie unten beschrieben, trugen die nachhaltigen Investitionen des Fonds während des Bezugszeitraums zu den Umweltzielen der Anpassung an den Klimawandel und der Eindämmung des Klimawandels bei.

Die vom Fonds während des Berichtszeitraums gehaltenen Derivate wurden im Hinblick auf die vom Anlageberater umgesetzte Ausschlusspolitik geprüft und dementsprechend eingesetzt, um die vom Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale zu bewerten.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Der Einfluss des Fonds auf die Nachhaltigkeit wurde durch die Umsetzung der Emittenten-Engagement-Politik des Anlageberaters, die Ausschlussstrategie und die Anlage in bestimmte festverzinsliche ESG-Wertpapiere (wie im Abschnitt „**Festverzinsliche ESG-Wertpapiere**“ des Prospekts näher beschrieben) gemessen, die es Emittenten ermöglichen, Kapital zur Finanzierung von Projekten mit positivem Umweltnutzen zu beschaffen, sowie durch die Verschuldung von Emittenten, die bei der Bewältigung von Risiken und Chancen im Zusammenhang mit dem Klimawandel eine führende Rolle spielen.

Zum Beispiel führt das Screening-Verfahren des Fonds zum Ausschluss bestimmter Sektoren, darunter Emittenten, die in den Bereichen Kohle und Öl tätig sind. Darüber hinaus bezog sich der Anlageberater im Rahmen des Screening-Prozesses des Fonds auf weltweit anerkannte Normen wie die Prinzipien des Global Compact der Vereinten Nationen und die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte, wo dies angemessen war.

● **Welche Ziele wurden mit den nachhaltigen Investitionen, die das Finanzprodukt teilweise getätigt hat, verfolgt und wie haben die nachhaltigen Investitionen zu diesen Zielen beigetragen?**

Die zugrundeliegenden nachhaltigen Investitionen des Fonds trugen während des Berichtszeitraums in erster Linie zu den Umweltzielen Klimaschutz und Anpassung an den Klimawandel bei, was auf verschiedene Weise erreicht wurde, beispielsweise durch die Investition in festverzinsliche ESG-Wertpapiere (wie im Abschnitt „**Festverzinsliche ESG-Wertpapiere**“ des Prospekts näher beschrieben) einschließlich grüner Anleihen.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Die nachhaltigen Investitionen des Fonds wurden daraufhin geprüft, ob sie ein Umweltziel oder ein soziales Ziel erheblich beeinträchtigen. Diese Bewertung erfolgte durch die Anwendung verschiedener negativer Nachhaltigkeitsindikatoren durch den Anlageberater, einschließlich, aber nicht beschränkt auf das Engagement in Kohle und Öl sowie Treibhausgasemissionen.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die Wertpapiere wurden nach dem internen Nachhaltigkeits-Screening-Verfahren des Anlageberaters ausgewählt. Dieser Screening-Prozess beinhaltet die Berücksichtigung negativer Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren, einschließlich des Engagements im Kohle- und Ölsektor und des Engagements in kontroversen Waffen. Der Anlageberater versuchte, die wesentlichen negativen Auswirkungen zu mindern, unter anderem durch Emittentenengagement und Ausschlussüberprüfung.

Waren die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte konform? Einzelheiten:

Der Anlageberater hat sich davon überzeugt, dass nachhaltige Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte konform sind, indem er das Kontroversen-Screening des UNGC (UN Global Compact) sowie andere Instrumente wie ESG-Scores und -Research als Teil des Due-Diligence-Prozesses für Investitionen angewandt hat.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Anlagen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unions-Kriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die Unions-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die Unions-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

Die wichtigsten negativen Auswirkungen werden als jene Auswirkungen von Investitionsentscheidungen beschrieben, die „zu negativen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren führen“, während Nachhaltigkeitsfaktoren als „ökologische, soziale und Arbeitnehmerbelange, Achtung der Menschenrechte, Bekämpfung von Korruption und Bestechung“ definiert werden.

Der Fonds berücksichtigte die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (einschließlich, aber nicht beschränkt auf das Engagement in Kohle und Öl sowie Treibhausgasemissionen und das Engagement in kontroversen Waffen) während des Bezugszeitraums.

Der Anlageberater war bestrebt, die wichtigsten negativen Auswirkungen als Teil des Investitionsprozesses zu berücksichtigen und nutzte eine Kombination von Methoden, um die wichtigsten negativen Auswirkungen zu mildern, einschließlich des Emittentenengagements und der Ausschlüsse.



Welches sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Größte Investitionen	Sektor	% des Nettovermögens	Land
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,000 % fällig 02.01.2053	Verbriefte	3,64 %	USA
US-Staatsanleihen 2,375 % fällig 15.02.2042	Regierungsbezogen	3,19 %	USA
US-Staatsanleihen 3,250 % fällig 15.05.2042	Regierungsbezogen	2,88 %	USA
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig 15.07.2032	Regierungsbezogen	2,07 %	USA
US-Staatsanleihen 2,000 % fällig 15.11.2041	Regierungsbezogen	2,06 %	USA
US-Staatsanleihen 2,250 % fällig 15.05.2041	Regierungsbezogen	1,95 %	USA
US-Staatsanleihen 4,000 % fällig 15.11.2042	Regierungsbezogen	1,67 %	USA
US-Staatsanleihen 1,750 % fällig 15.08.2041	Regierungsbezogen	1,66 %	USA
US-Staatsanleihen 0,500 % fällig 30.11.2023	Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	1,60 %	USA
US-Staatsanleihen 4,250 % fällig 15.10.2025	Regierungsbezogen	1,58 %	USA
Humana, Inc. 4,850 % fällig 19.01.2023	Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	1,30 %	USA
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,500 % fällig 02.01.2053	Verbriefte	0,99 %	USA
Bundesrepublik Deutschland 0,000 % fällig 15.08.2031	Regierungsbezogen	0,93 %	Deutschland
Österreichische Staatsanleihen 1,267 % fällig 23.02.2023	Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	0,91 %	Österreich
US-Staatsanleihen 1,875 % fällig 15.02.2041	Regierungsbezogen	0,90 %	USA

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: zum 31. Dezember 2022

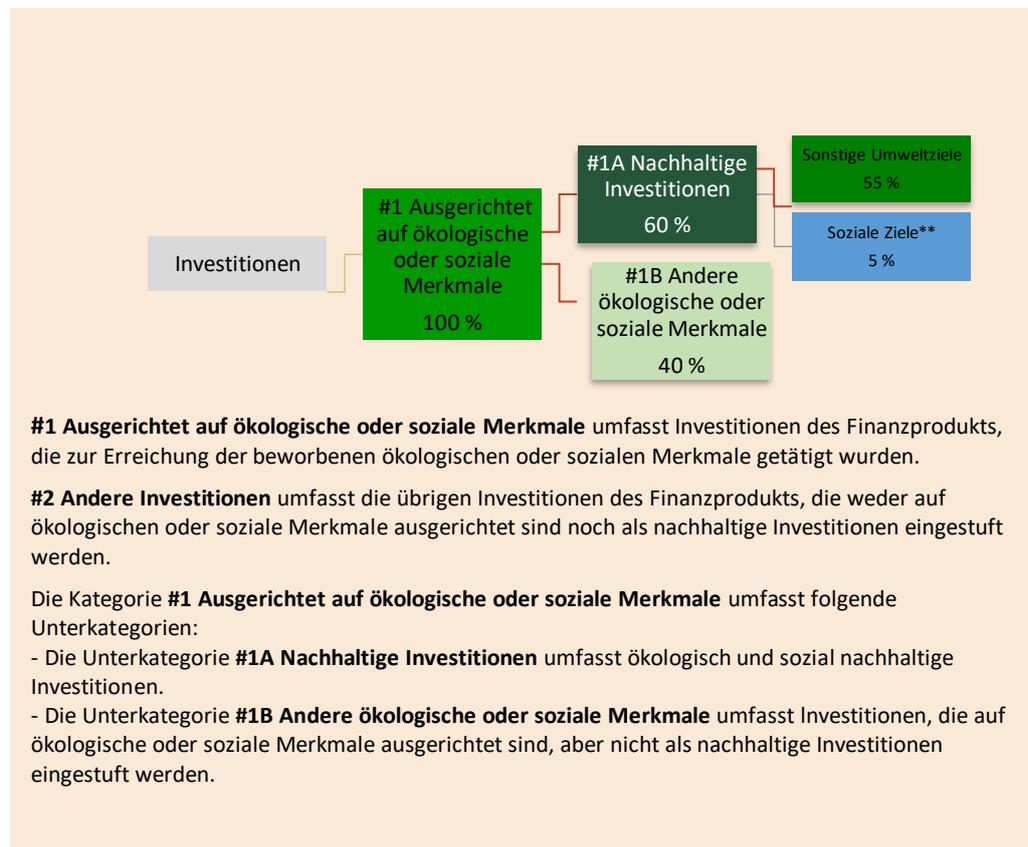
Für die Zusammenstellung der oben genannten Informationen wurden die Investitionen des Fonds zum 31. Dezember 2022 verwendet.



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Nachfolgend finden Sie Informationen über den Anteil des Fonds, der ökologische/soziale Merkmale beworben hat, und den Anteil des Fonds, der zum 31. Dezember 2022 in nachhaltige Investitionen investiert wurde.

● *Wie sah die Vermögensallokation aus?*



Zum 31. Dezember 2022 wurde bei 100 % der Investitionen des Fonds davon ausgegangen, dass sie ökologische und soziale Merkmale bewerben, da alle Investitionen des Fonds anhand seiner Ausschlussstrategie geprüft wurden.

Zu diesem Zeitpunkt hatte der Fonds 60 % seines Nettovermögens in nachhaltige Investitionen investiert. 55 % des Nettovermögens waren in nachhaltige Investitionen investiert, die zu einem Umweltziel beitragen.

** Darüber hinaus hielt der Fonds 5 % des Nettovermögens in nachhaltigen Investitionen, die zu einem sozialen Ziel beitragen. Es ist zu beachten, dass der Fonds keine Verpflichtung eingegangen ist, in nachhaltige Investitionen zu investieren, die zu einem sozialen Ziel beitragen, und dass solche Investitionen als unbeabsichtigt angesehen werden sollten.

● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Sektor	% des Nettovermögens
Investment-Grade-Kredite	59,48 %
Regierungsbezogen	21,19 %
Verbrieft	6,32 %
Aufstrebende Märkte	5,71 %
Hochzinskredite	4,41 %
Kommunal/Sonstige	1,53 %
Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	1,36 %

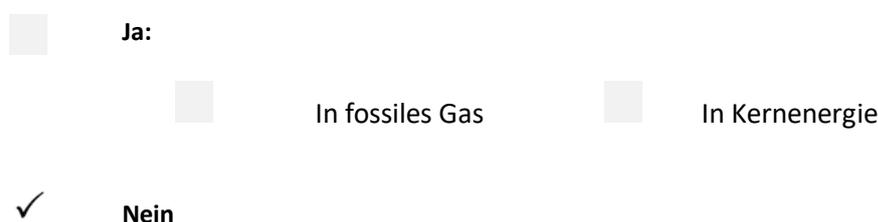
Für die Zusammenstellung der oben genannten Informationen wurden die Investitionen des Fonds zum 31. Dezember 2022 verwendet.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Zum 31. Dezember 2022 beträgt der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform sind, 0 %. Diese Zahl wurde weder von einem Wirtschaftsprüfer bestätigt noch von einer anderen dritten Partei überprüft.

● **Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert¹?**



¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Mit Blick auf die EU-Taxonomie-konformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für Kernenergie beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

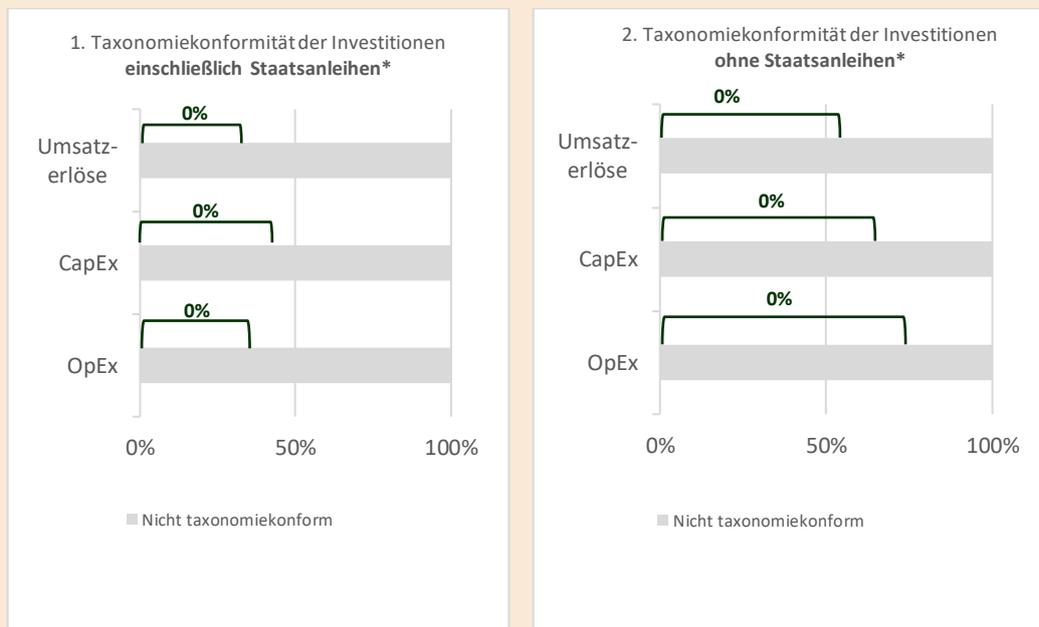
Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu einem Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil am:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxoniekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Zum 31. Dezember 2022 betrug der Anteil der Investitionen des Fonds in Übergangs- und ermöglichende Tätigkeiten während des Bezugszeitraums 0 %.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Der Fonds verpflichtet sich nicht, in Investitionen zu investieren, die mit der EU-Taxonomie konform sind, sondern verpflichtet sich, in nachhaltige Investitionen zu investieren, die zu einem Umweltziel beitragen. Zum 31. Dezember 2022 betrug der Anteil der nachhaltigen Investitionen des Fonds, die zu einem Umweltziel beitrugen, die nicht anhand der EU-Taxonomie bewertet wurden und daher oben als Investitionen mit „Sonstigen Umweltzielen“ klassifiziert wurden, 55%. Weitere Informationen über die Verfügbarkeit von Nachhaltigkeitsdaten und die damit verbundenen Herausforderungen finden Sie unter <https://europe.pimco.com/en-eu/our-firm/global-advisors-ireland>.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Wie oben erwähnt, hielt der Fonds 5 % des Nettovermögens in nachhaltigen Investitionen, die während des von diesem Jahresabschluss abgedeckten Zeitraums zu einem sozialen Ziel beitrugen. Da der Fonds keine Verpflichtung eingegangen ist, in nachhaltige Investitionen zu investieren, die zu einem sozialen Ziel beitragen, sollten solche Investitionen als unbeabsichtigt angesehen werden.

 sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die **Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Wie oben erwähnt wurde zum 31. Dezember 2022 bei 100 % der Investitionen des Fonds davon ausgegangen, dass sie ökologische und soziale Merkmale bewerben, da alle Investitionen des Fonds anhand seiner Ausschlussstrategie geprüft wurden. Wie oben ausführlicher dargelegt, hatte der Fonds zu diesem Zeitpunkt 60 % seines Nettovermögens in nachhaltige Investitionen investiert.

Infolgedessen gab es zum 31. Dezember 2022 keine Investitionen im Portfolio, die nicht mit den vom Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen konform waren.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Während des Berichtszeitraums hat sich der Anlageberater mit Unternehmen und Emittenten zu wesentlichen klimabezogenen Themen ausgetauscht. Dies beinhaltete die Motivation von Unternehmen, Konformität mit dem Pariser Abkommen anzustreben, sich wissenschaftlich fundierte Ziele für die Reduzierung von Kohlenstoffemissionen zu setzen und/oder ihre Nachhaltigkeitsverpflichtungen auf breiter Basis umzusetzen.

ANHANG IV

Vorlage — Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Global Low Duration Real Return Fund

Unternehmenskennung (LEI-Code):

5493004EUSX3DN7B3B79

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

●● <input type="checkbox"/> Ja	● <input checked="" type="checkbox"/> Nein
<p><input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: ___%</p> <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <p><input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: ___%</p>	<p><input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es einen Anteil von ___% an nachhaltigen Investitionen</p> <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel <p><input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt</p>

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Der Fonds bewarb die ökologischen Merkmale durch die Überprüfung aller Direktinvestitionen im Hinblick auf die Ausschlusspolitik des Fonds. Der Fonds hat ökologische Merkmale auch dadurch beworben, dass er sich aktiv mit Emittenten zu wesentlichen klimabezogenen Themen ausgetauscht hat. Dies beinhaltete die Motivation von Unternehmen, Konformität mit dem Pariser Abkommen anzustreben, sich wissenschaftlich fundierte Ziele für die Reduzierung von Kohlenstoffemissionen zu setzen und/oder ihre Nachhaltigkeitsverpflichtungen auf breiter Basis umzusetzen.

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Die nachhaltigkeitsbezogenen Auswirkungen des Fonds wurden anhand der Umsetzung der Engagementpolitik des Anlageberaters in Bezug auf Emittenten und der Ausschlussstrategie gemessen. Die Ausschlussstrategie und das Ausschluss-Screening-Verfahren des Fonds gelten für 100 % seiner Direktanlagen.

Zum Beispiel führt das Screening-Verfahren des Fonds zum Ausschluss bestimmter Sektoren, darunter Emittenten, die in den Bereichen Kohle und nicht-konventionelles Öl (wie arktisches Öl und Ölsande) tätig sind. Darüber hinaus bezog sich der Anlageberater im Rahmen des Screening-Prozesses des Fonds auf weltweit anerkannte Normen wie die Prinzipien des Global Compact der Vereinten Nationen, wo dies angemessen war.



Welches sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Die Liste umfasst den **größten Anteil der** im Bezugszeitraum getätigten **Investitionen** des Finanzprodukts (Stand: 31. Dezember 2022).

Größte Investitionen	Sektor	% des Nettovermögens	Land
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig 15.10.2024	Inflationsgebunden	5,69 %	USA
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig 15.07.2026	Inflationsgebunden	5,69 %	USA
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,500 % fällig 15.01.2028	Inflationsgebunden	4,98 %	USA
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig 15.10.2025	Inflationsgebunden	4,89 %	USA
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig 15.10.2026	Inflationsgebunden	4,74 %	USA
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,375 % fällig 15.07.2025	Inflationsgebunden	4,32 %	USA
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig 15.01.2026	Inflationsgebunden	4,31 %	USA
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,375 % fällig 15.01.2027	Inflationsgebunden	4,20 %	USA
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,500 % fällig 15.04.2024	Inflationsgebunden	4,16 %	USA
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,250 % fällig 15.01.2025	Inflationsgebunden	3,90 %	USA
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig 15.04.2026	Inflationsgebunden	3,86 %	USA
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig 15.04.2025	Inflationsgebunden	3,75 %	USA
United Kingdom Gilt 0,125 % fällig 22.03.2024	Inflationsgebunden	3,74 %	Vereinigtes Königreich
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig 15.01.2024	Inflationsgebunden	3,22 %	USA
United Kingdom Gilt 0,125 % fällig 22.03.2026	Inflationsgebunden	3,09 %	Vereinigtes Königreich

Für die Zusammenstellung der oben genannten Informationen wurden die Investitionen des Fonds zum 31. Dezember 2022 verwendet.

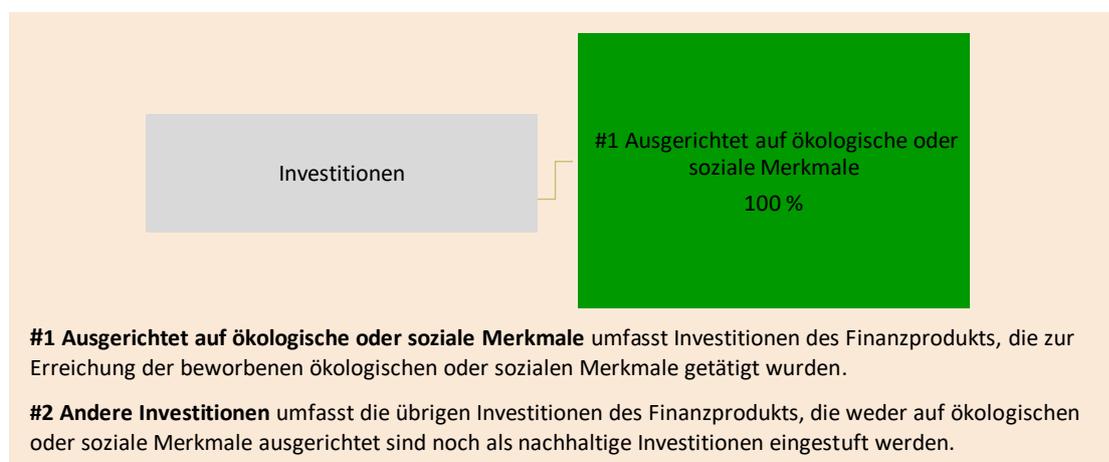


Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Nachfolgend finden Sie Informationen über den Anteil des Fonds, der zum 31. Dezember 2022 ökologische/soziale Merkmale beworben hat.

● **Wie sah die Vermögensallokation aus?**

Zum 31. Dezember 2022 wurde bei 100 % der Direktinvestitionen des Fonds davon ausgegangen, dass sie ökologische Merkmale beworben, da die Ausschlussstrategie und das Ausschlusscreening des Fonds auf alle seine Direktinvestitionen angewendet wurden. Ein ökologischer und sozialer Mindestschutz war nur für solche Direktinvestitionen vorgesehen und galt nicht für indirekte Investitionen.



● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Sektor	% des Nettovermögens
Inflationsgebunden	96,03 %
Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	13,59 %
Verbriefte	4,99 %
Gedeckte Schuldverschreibungen (Covered Bonds) und Pfandbriefe	2,99 %
Investment-Grade-Kredite	0,30 %
Emerging Market Local	0,07 %
Hochzinskredite	0,04 %
Regierungsbezogen	-18,01 %

Für die Zusammenstellung der oben genannten Informationen wurden die Bestände des Fonds zum 31. Dezember 2022 verwendet.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Zum 31. Dezember 2022 beträgt der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform sind, 0 %. Diese Zahl wurde weder von einem Wirtschaftsprüfer bestätigt noch von einer anderen dritten Partei überprüft.

Mit Blick auf die EU-Taxonomie-konformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu einem Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

● **Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert¹?**

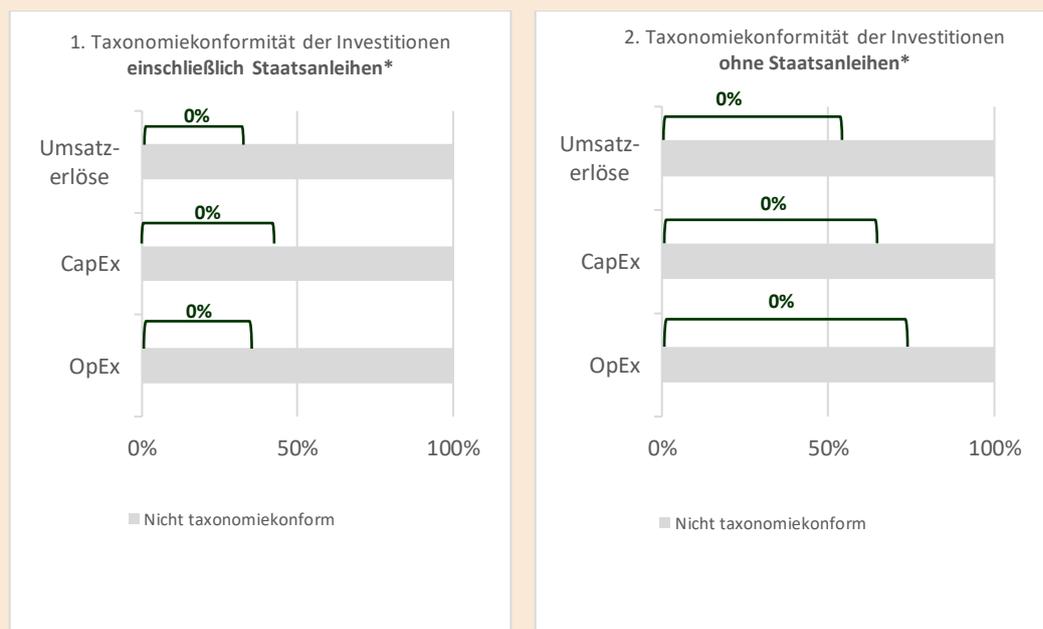
Ja:
 In fossiles Gas In Kernenergie
 Nein

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil am:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Zum 31. Dezember 2022 betrug der Anteil der Investitionen des Fonds in Übergangs- und ermöglichende Tätigkeiten während des Bezugszeitraums 0 %.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Wie oben erwähnt, wurde zum 31. Dezember 2022 bei 100 % der Direktinvestitionen des Fonds davon ausgegangen, dass sie ökologische Merkmale bewerben, da die Ausschlussstrategie und das Ausschlusscreening des Fonds auf alle seine Direktinvestitionen angewendet wurden.

Ein ökologischer und sozialer Mindestschutz war nur für solche Direktinvestitionen vorgesehen und galt nicht für indirekte Investitionen.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Während des Berichtszeitraums hat sich der Anlageberater mit Unternehmen und Emittenten zu wesentlichen klimabezogenen Themen ausgetauscht. Dies beinhaltete die Motivation von Unternehmen, Konformität mit dem Pariser Abkommen anzustreben, sich wissenschaftlich fundierte Ziele für die Reduzierung von Kohlenstoffemissionen zu setzen und/oder ihre Nachhaltigkeitsverpflichtungen auf breiter Basis umzusetzen.

ANHANG IV

Vorlage — Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Global Real Return Fund Unternehmenskennung (LEI-Code): TJC21SOQHOBNQ288A280

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

●● <input type="checkbox"/> Ja	●○ <input checked="" type="checkbox"/> Nein
<input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: ___% <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: ___%	<input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es einen Anteil von ___% an nachhaltigen Investitionen <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel <input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Der Fonds bewarb die ökologischen Merkmale durch die Überprüfung aller Direktinvestitionen im Hinblick auf die Ausschlusspolitik des Fonds. Der Fonds hat ökologische Merkmale auch dadurch beworben, dass er sich aktiv mit Emittenten zu wesentlichen klimabezogenen Themen ausgetauscht hat. Dies beinhaltete die Motivation von Unternehmen, Konformität mit dem Pariser Abkommen anzustreben, sich wissenschaftlich fundierte Ziele für die Reduzierung von Kohlenstoffemissionen zu setzen und/oder ihre Nachhaltigkeitsverpflichtungen auf breiter Basis umzusetzen.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Die nachhaltigkeitsbezogenen Auswirkungen des Fonds wurden anhand der Umsetzung der Engagementpolitik des Anlageberaters in Bezug auf Emittenten und der Ausschlussstrategie gemessen. Die Ausschlussstrategie und das Ausschluss-Screening-Verfahren des Fonds gelten für 100 % seiner Direktanlagen.

Zum Beispiel führt das Screening-Verfahren des Fonds zum Ausschluss bestimmter Sektoren, darunter Emittenten, die in den Bereichen Kohle und nicht-konventionelles Öl (wie arktisches Öl und Ölsande) tätig sind. Darüber hinaus bezog sich der Anlageberater im Rahmen des Screening-Prozesses des Fonds auf weltweit anerkannte Normen wie die Prinzipien des Global Compact der Vereinten Nationen, wo dies angemessen war.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.



Welches sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Größte Investitionen	Sektor	% des Nettovermögens	Land
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig 15.07.2031	Inflationsgebunden	6,72 %	USA
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,500 % fällig 15.01.2028	Inflationsgebunden	4,05 %	USA
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig 15.04.2025	Inflationsgebunden	3,56 %	USA
United Kingdom Gilt 1,250 % fällig 22.11.2032	Inflationsgebunden	3,18 %	Vereinigtes Königreich
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,400 % fällig 26.05.2025	Inflationsgebunden	2,82 %	Italien
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig 15.04.2023	Inflationsgebunden	2,65 %	USA
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig 15.01.2030	Inflationsgebunden	2,61 %	USA
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,250 % fällig 15.07.2029	Inflationsgebunden	2,56 %	USA
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,625 % fällig 15.10.2027	Inflationsgebunden	2,52 %	USA
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,300 % fällig 15.05.2028	Inflationsgebunden	2,31 %	Italien
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 3,625 % fällig 15.04.2028	Inflationsgebunden	2,29 %	USA
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig 15.04.2026	Inflationsgebunden	2,01 %	USA
Internationale Staatsanleihe Japan 0,100 % fällig 03.10.2029	Inflationsgebunden	1,79 %	Japan
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,000 % fällig 02.01.2053	Verbriefte	1,71 %	USA
Internationale Staatsanleihe Neuseeland 2,000 % fällig 20.09.2025	Inflationsgebunden	1,63 %	Neuseeland

Für die Zusammenstellung der oben genannten Informationen wurden die Investitionen des Fonds zum 31. Dezember 2022 verwendet.

Die Liste umfasst den **größten Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten **Investitionen** des Finanzprodukts (Stand: 31. Dezember 2022).

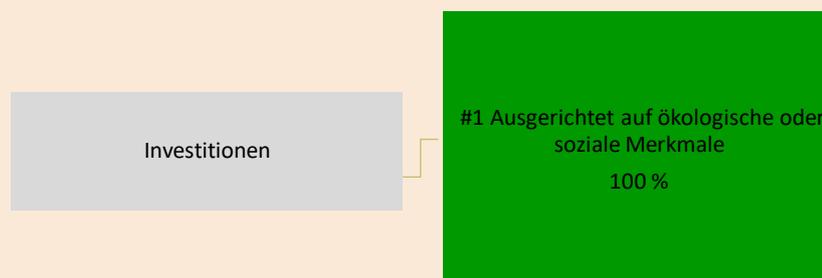


Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Nachfolgend finden Sie Informationen über den Anteil des Fonds, der zum 31. Dezember 2022 ökologische/soziale Merkmale beworben hat.

● **Wie sah die Vermögensallokation aus?**

Zum 31. Dezember 2022 wurde bei 100 % der Direktinvestitionen des Fonds davon ausgegangen, dass sie ökologische Merkmale bewerben, da die Ausschlussstrategie und das Ausschlusscreening des Fonds auf alle seine Direktinvestitionen angewendet wurden. Ein ökologischer und sozialer Mindestschutz war nur für solche Direktinvestitionen vorgesehen und galt nicht für indirekte Investitionen.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologischen oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Sektor	% des Nettovermögens
Inflationsgebunden	100,97 %
Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	15,95 %
Verbrieft	8,56 %
Gedeckte Schuldverschreibungen (Covered Bonds) und Pfandbriefe	3,62 %
Investment-Grade-Kredite	0,17 %
Emerging Market Local	0,07 %
Hochzinskredite	0,04 %
Regierungsbezogen	-29,38 %

Für die Zusammenstellung der oben genannten Informationen wurden die Bestände des Fonds zum 31. Dezember 2022 verwendet.

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu einem Umweltziel leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil am:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

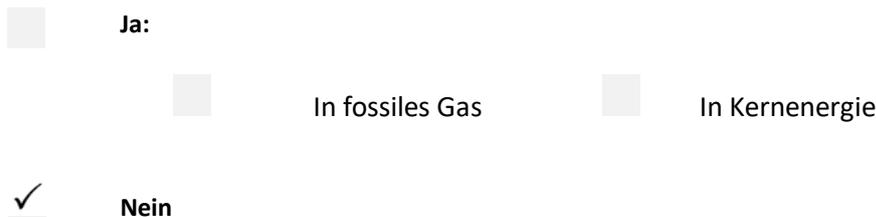


Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Zum 31. Dezember 2022 beträgt der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform sind, 0 %. Diese Zahl wurde weder von einem Wirtschaftsprüfer bestätigt noch von einer anderen dritten Partei überprüft.

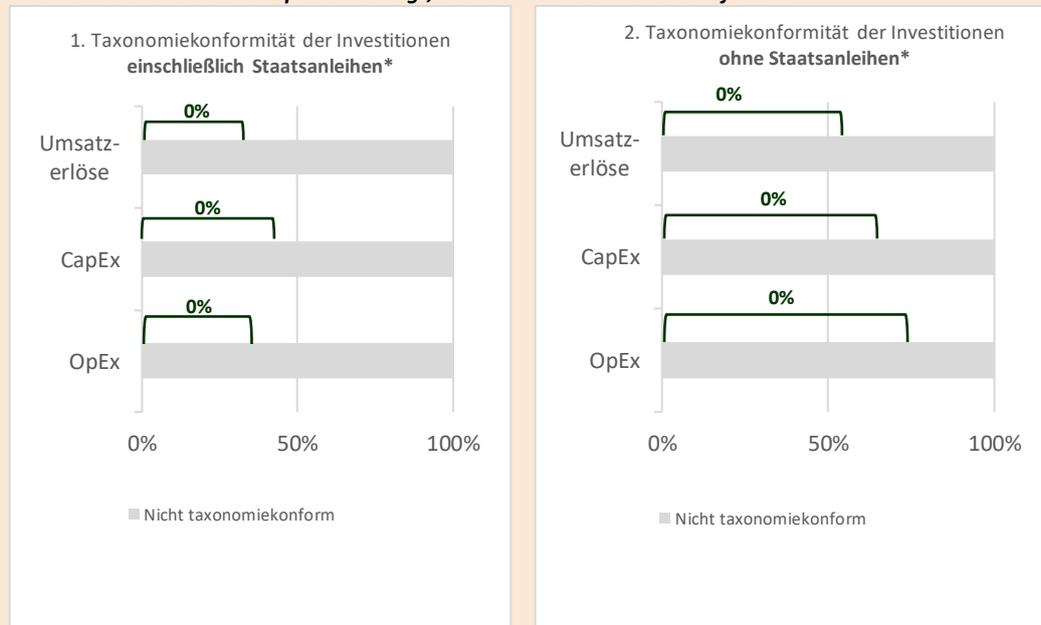


Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert¹?



¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Zum 31. Dezember 2022 betrug der Anteil der Investitionen des Fonds in Übergangs- und ermöglichende Tätigkeiten während des Bezugszeitraums 0 %.

Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Wie oben erwähnt, wurde zum 31. Dezember 2022 bei 100 % der Direktinvestitionen des Fonds davon ausgegangen, dass sie ökologische Merkmale bewerben, da die Ausschlussstrategie und das Ausschlusscreening des Fonds auf alle seine Direktinvestitionen angewendet wurden.

Ein ökologischer und sozialer Mindestschutz war nur für solche Direktinvestitionen vorgesehen und galt nicht für indirekte Investitionen.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Während des Berichtszeitraums hat sich der Anlageberater mit Unternehmen und Emittenten zu wesentlichen klimabezogenen Themen ausgetauscht. Dies beinhaltete die Motivation von Unternehmen, Konformität mit dem Pariser Abkommen anzustreben, sich wissenschaftlich fundierte Ziele für die Reduzierung von Kohlenstoffemissionen zu setzen und/oder ihre Nachhaltigkeitsverpflichtungen auf breiter Basis umzusetzen.

ANHANG IV

Vorlage — Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Low Duration Opportunities ESG Fund Unternehmenskennung (LEI-Code): 549300M7ZPBX56GB2C41

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?	
●● <input type="checkbox"/> Ja	●○ <input checked="" type="checkbox"/> Nein
<input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: ___% <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	<input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es einen Anteil von 29 % an nachhaltigen Investitionen <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input checked="" type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel**
<input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: ___%	<input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt

** Obwohl der Fonds während des Berichtszeitraums in nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel investiert hat, hat er sich nicht verpflichtet, in diese Anlagekategorie zu investieren, und daher sollten solche vom Fonds erworbenen Investitionen als nebensächliche Investitionen betrachtet werden.

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Der Ansatz des Fonds für nachhaltiges Investieren besteht im Bewerben ökologischer und sozialer Merkmale (der Fonds hat nachhaltiges Investieren zwar nicht als Anlageziel, ist aber bestrebt, einen Teil seiner Vermögenswerte in nachhaltige Anlagen zu investieren).

Wie unten beschrieben, trugen die nachhaltigen Investitionen des Fonds während des Bezugszeitraums zu den Umweltzielen der Anpassung an den Klimawandel und der Eindämmung des Klimawandels bei.

Die vom Fonds während des Berichtszeitraums gehaltenen Derivate wurden im Hinblick auf die vom Anlageberater umgesetzte Ausschlusspolitik geprüft und dementsprechend eingesetzt, um die vom Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale zu bewerten.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Der Einfluss des Fonds auf die Nachhaltigkeit wurde durch die Umsetzung der Emittenten-Engagement-Politik des Anlageberaters, die Ausschlussstrategie und die Anlage in bestimmte festverzinsliche ESG-Wertpapiere (wie im Abschnitt „**Festverzinsliche ESG-Wertpapiere**“ des Prospekts näher beschrieben) gemessen, die es Emittenten ermöglichen, Kapital zur Finanzierung von Projekten mit positivem Umweltnutzen zu beschaffen, sowie durch die Verschuldung von Emittenten, die bei der Bewältigung von Risiken und Chancen im Zusammenhang mit dem Klimawandel eine führende Rolle spielen.

Zum Beispiel führt das Screening-Verfahren des Fonds zum Ausschluss bestimmter Sektoren, darunter Emittenten, die in den Bereichen Kohle und Öl tätig sind. Darüber hinaus bezog sich der Anlageberater im Rahmen des Screening-Prozesses des Fonds auf weltweit anerkannte Normen wie die Prinzipien des Global Compact der Vereinten Nationen und die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte, wo dies angemessen war.

● **Welche Ziele wurden mit den nachhaltigen Investitionen, die das Finanzprodukt teilweise getätigt hat, verfolgt und wie haben die nachhaltigen Investitionen zu diesen Zielen beigetragen?**

Die zugrundeliegenden nachhaltigen Investitionen des Fonds trugen während des Berichtszeitraums in erster Linie zu den Umweltzielen Klimaschutz und Anpassung an den Klimawandel bei, was auf verschiedene Weise erreicht wurde, beispielsweise durch die Investition in festverzinsliche ESG-Wertpapiere (wie im Abschnitt „**Festverzinsliche ESG-Wertpapiere**“ des Prospekts näher beschrieben) einschließlich grüner Anleihen.

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Die nachhaltigen Investitionen des Fonds wurden daraufhin geprüft, ob sie ein Umweltziel oder ein soziales Ziel erheblich beeinträchtigen. Diese Bewertung erfolgte durch die Anwendung verschiedener negativer Nachhaltigkeitsindikatoren durch den Anlageberater, einschließlich, aber nicht beschränkt auf das Engagement in Kohle und Öl sowie Treibhausgasemissionen.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die Wertpapiere wurden nach dem internen Nachhaltigkeits-Screening-Verfahren des Anlageberaters ausgewählt. Dieser Screening-Prozess beinhaltet die Berücksichtigung negativer Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren, einschließlich des Engagements im Kohle- und Ölsektor und des Engagements in kontroversen Waffen. Der Anlageberater versuchte, die wesentlichen negativen Auswirkungen zu mindern, unter anderem durch Emittentenengagement und Ausschlussüberprüfung.

Waren die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte konform? Einzelheiten:

Der Anlageberater hat sich davon überzeugt, dass nachhaltige Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte konform sind, indem er das Kontroversen-Screening des UNGC (UN Global Compact) sowie andere Instrumente wie ESG-Scores und -Research als Teil des Due-Diligence-Prozesses für Investitionen angewandt hat.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Anlagen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unions-Kriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die Unions-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die Unions-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die wichtigsten negativen Auswirkungen werden als jene Auswirkungen von Investitionsentscheidungen beschrieben, die „zu negativen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren führen“, während Nachhaltigkeitsfaktoren als „ökologische, soziale und Arbeitnehmerbelange, Achtung der Menschenrechte, Bekämpfung von Korruption und Bestechung“ definiert werden.

Der Fonds berücksichtigte die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (einschließlich, aber nicht beschränkt auf das Engagement in Kohle und Öl sowie Treibhausgasemissionen und das Engagement in kontroversen Waffen) während des Bezugszeitraums.

Der Anlageberater war bestrebt, die wichtigsten negativen Auswirkungen als Teil des Investitionsprozesses zu berücksichtigen und nutzte eine Kombination von Methoden, um die wichtigsten negativen Auswirkungen zu mildern, einschließlich des Emittentenengagements und der Ausschlüsse.



Welches sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Größte Investitionen	Sektor	% Vermögenswerte	Land
US-Staatsanleihen 4,290 % fällig 03.09.2023	Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	28,19 %	USA
US-Staatsanleihen 4,245 % fällig 03.02.2023	Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	16,13 %	USA
Japanische Staatsanleihen (0,198) % fällig 27.03.2023	Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	6,31 %	Japan
Japanische Staatsanleihen (0,179) % fällig 27.03.2023	Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	4,46 %	Japan
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,500 % fällig 02.01.2053	Verbrieft	4,06 %	USA
Österreichische Staatsanleihen 1,267 % fällig 23.02.2023	Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	2,16 %	Österreich
St. Paul's CLO DAC 2,128 % fällig 15.01.2032	Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	2,12 %	Irland
NatWest Group PLC 4,067 % fällig 09.06.2028	Investment-Grade-Kredite	2,11 %	Vereinigtes Königreich
Mizuho Financial Group, Inc. 3,490 % fällig 09.05.2027	Investment-Grade-Kredite	2,11 %	Japan
US-Staatsanleihen 4,397 % fällig 23.03.2023	Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	2,01 %	USA
Mizuho Financial Group, Inc. 0,214 % fällig 10.07.2025	Investment-Grade-Kredite	1,99 %	Japan
NTT Finance Corp. 0,082 % fällig 13.12.2025	Investment-Grade-Kredite	1,97 %	Japan
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,000 % fällig 02.01.2053	Verbrieft	1,43 %	USA
European Investment Bank 2,375 % fällig 24.05.2027	Regierungsbezogen	1,26 %	Supranational
Bank of America Corp. 2,456 % fällig 22.10.2025	Investment-Grade-Kredite	1,00 %	USA

Für die Zusammenstellung der oben genannten Informationen wurden die Investitionen des Fonds zum 31. Dezember 2022 verwendet.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten **Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: zum 31. Dezember 2022



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Nachfolgend finden Sie Informationen über den Anteil des Fonds, der ökologische/soziale Merkmale beworben hat, und den Anteil des Fonds, der zum 31. Dezember 2022 in nachhaltige Investitionen investiert wurde.

● *Wie sah die Vermögensallokation aus?*



Zum 31. Dezember 2022 wurde bei 100 % der Investitionen des Fonds davon ausgegangen, dass sie ökologische und soziale Merkmale bewerben, da alle Investitionen des Fonds anhand seiner Ausschlussstrategie geprüft wurden.

Zu diesem Zeitpunkt hatte der Fonds 29 % seines Nettovermögens in nachhaltige Investitionen investiert. 28 % des Nettovermögens waren in nachhaltige Investitionen investiert, die zu einem Umweltziel beitragen.

** Darüber hinaus hielt der Fonds 1 % des Nettovermögens in nachhaltigen Investitionen, die zu einem sozialen Ziel beitragen. Es ist zu beachten, dass der Fonds keine Verpflichtung eingegangen ist, in nachhaltige Investitionen zu investieren, die zu einem sozialen Ziel beitragen, und dass solche Investitionen als unbeabsichtigt angesehen werden sollten.

● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Sektor	% der Investition
Sonstige kurzfristige Netto-Instrumente	34,60 %
Investment-Grade-Kredite	29,83 %
Regierungsbezogen	26,08 %
Verbriefte	5,50 %
Hochzinskredite	4,00 %

Für die Zusammenstellung der oben genannten Informationen wurden die Investitionen des Fonds zum 31. Dezember 2022 verwendet.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Zum 31. Dezember 2022 beträgt der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform sind, 0 %. Diese Zahl wurde weder von einem Wirtschaftsprüfer bestätigt noch von einer anderen dritten Partei überprüft.

● **Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxoniekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert¹?**



¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxoniekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxoniekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Mit Blick auf die EU-Taxoniekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

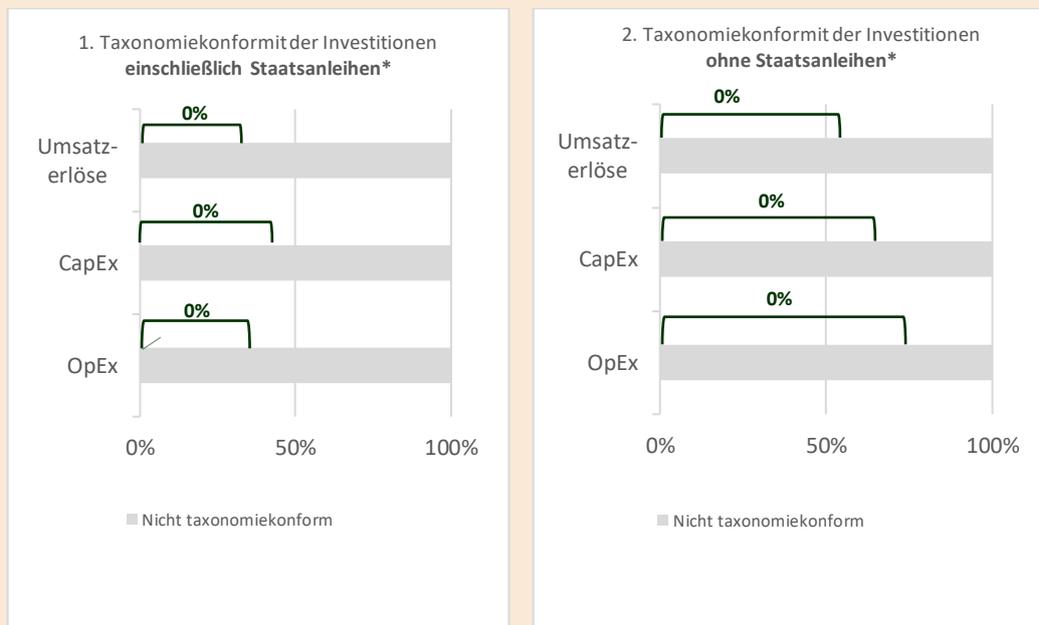
Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu einem Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil am:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Zum 31. Dezember 2022 betrug der Anteil der Investitionen des Fonds in Übergangs- und ermöglichende Tätigkeiten während des Bezugszeitraums 0 %.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Der Fonds verpflichtet sich nicht, in Investitionen zu investieren, die mit der EU-Taxonomie konform sind, sondern verpflichtet sich, in nachhaltige Investitionen zu investieren, die zu einem Umweltziel beitragen. Zum 31. Dezember 2022 betrug der Anteil der nachhaltigen Investitionen des Fonds, die zu einem Umweltziel beitragen, die nicht anhand der EU-Taxonomie bewertet wurden und daher oben als Investitionen mit „Sonstigen Umweltzielen“ klassifiziert wurden, 28 %. Weitere Informationen über die Verfügbarkeit von Nachhaltigkeitsdaten und die damit verbundenen Herausforderungen finden Sie unter <https://europe.pimco.com/en-eu/our-firm/global-advisors-ireland>.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Wie oben erwähnt, hielt der Fonds 1 % des Nettovermögens in nachhaltigen Investitionen, die während des von diesem Jahresabschluss abgedeckten Zeitraums zu einem sozialen Ziel beitragen. Da der Fonds keine Verpflichtung eingegangen ist, in nachhaltige Investitionen zu investieren, die zu einem sozialen Ziel beitragen, sollten solche Investitionen als unbeabsichtigt angesehen werden.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Wie oben erwähnt wurde zum 31. Dezember 2022 bei 100 % der Investitionen des Fonds davon ausgegangen, dass sie ökologische und soziale Merkmale bewerben, da alle Investitionen des Fonds anhand seiner Ausschlussstrategie geprüft wurden. Wie oben ausführlicher dargelegt, hatte der Fonds zu diesem Zeitpunkt 29 % seines Nettovermögens in nachhaltige Investitionen investiert.

Infolgedessen gab es zum 31. Dezember 2022 keine Investitionen im Portfolio, die nicht mit den vom Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen konform waren.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Während des Berichtszeitraums hat sich der Anlageberater mit Unternehmen und Emittenten zu wesentlichen klimabezogenen Themen ausgetauscht. Dies beinhaltete die Motivation von Unternehmen, Konformität mit dem Pariser Abkommen anzustreben, sich wissenschaftlich fundierte Ziele für die Reduzierung von Kohlenstoffemissionen zu setzen und/oder ihre Nachhaltigkeitsverpflichtungen auf breiter Basis umzusetzen.

Abkürzungen der Kontrahenten:

AZD	Australia and New Zealand Banking Group	FAR	Wells Fargo Bank National Association	MYI	Morgan Stanley & Co. International PLC
BOA	Bank of America N.A.	FBF	Credit Suisse International	NAB	National Australia Bank Ltd.
BOM	Bank of Montreal	FCT	Credit Suisse Capital LLC	NOM	Nomura Securities International, Inc.
BOS	BofA Securities, Inc.	FICC	Fixed Income Clearing Corporation	NXN	Natixis New York
BPG	Paribas Securities Corp.	GLM	Goldman Sachs Bank USA	PER	Pershing LLC
BPS	Paribas S.A.	GRE	NatWest Markets Securities, Inc.	RBC	Royal Bank of Canada
BRC	Barclays Bank PLC	GSC	Goldman Sachs & Co. LLC	RCY	Royal Bank of Canada
BSH	Banco Santander S.A. - New York Branch	GST	Goldman Sachs International	RDR	RBC Capital Markets LLC
BSN	The Bank of Nova Scotia - Toronto	HUS	HSBC Bank USA N.A.	RVM	Barclays Capital, Inc.
BSS	Banco Santander S.A.	IND	Crédit Agricole Corporate and Investment Bank S.A.	RYL	NatWest Markets Plc
BYL	Barclays Bank PLC London Branch	JLN	JP Morgan Chase Bank N.A. London	SAL	Citigroup Global Markets, Inc.
BYR	The Bank of Nova Scotia - Toronto	JML	JP Morgan Securities Plc	SCX	Standard Chartered Bank, London
CBK	Citibank N.A.	JPM	JP Morgan Chase Bank N.A.	SGY	Societe Generale, NY
CDI	Natixis Singapore	JPS	J.P. Morgan Securities LLC	SOG	Societe Generale Paris
CIB	Canadian Imperial Bank of Commerce	MAC	Macquarie Bank Limited	SSB	State Street Bank and Trust Co.
CKL	Citibank N.A. London	MBC	HSBC Bank Plc	TDM	TD Securities (USA) LLC
CLY	Crédit Agricole Corporate and Investment Bank	MEI	Merrill Lynch International	TOR	The Toronto-Dominion Bank
COM	Commerzbank AG	MFK	Barclays Capital, Inc.	UAG	UBS AG Stamford
CSN	Credit Suisse AG (New York)	MSC	Morgan Stanley & Co. LLC.	UBS	UBS Securities LLC
DBL	Deutsche Bank AG London	MYC	Morgan Stanley Capital Services LLC	WST	Westpac Banking Corp.
DEU	Deutsche Bank Securities, Inc.				
DUB	Deutsche Bank AG				

Währungskürzel:

AED	Dirham der Vereinigten Arabischen Emirate	HKD	Hongkong-Dollar	PLN	Polnischer Zloty
ARS	Argentinischer Peso	HUF	Ungarischer Forint	RON	Rumänischer neuer Leu
AUD	Australischer Dollar	IDR	Indonesische Rupie	RSD	Serbischer Dinar
BRL	Brasilianischer Real	ILS	Israelischer Shekel	RUB	Russischer Rubel
CAD	Kanadischer Dollar	INR	Indische Rupie	SEK	Schwedische Krone
CHF	Schweizer Franken	JPY (oder ¥)	Japanischer Yen	SGD	Singapur-Dollar
CLP	Chilenischer Peso	KES	Kenia-Schilling	THB	Thailändischer Baht
CNH	Chinesischer Renminbi (Ausland)	KRW	Südkoreanischer Won	TRY	Türkische neue Lira
CNY	Chinesischer Renminbi (Festland)	KZT	Kasachischer Tenge	TWD	Taiwanesischer Dollar
COP	Kolumbianischer Peso	MXN	Mexikanischer Peso	UAH	Ukrainische Hrywnja
CZK	Tschechische Krone	MYR	Malaysischer Ringgit	UGX	Ugandan Shilling
DKK	Dänische Krone	NGN	Nigerianische Naira	USD (oder \$)	US-Dollar
DOP	Dominikanischer Peso	NOK	Norwegische Krone	UYU	Uruguayischer Peso
EGP	Ägyptisches Pfund	NZD	Neuseeländischer Dollar	VND	Vietnamesischer Dong
EUR (oder €)	Euro	PEN	Peruanischer neuer Sol	ZAR	Südafrikanischer Rand
GBP (oder £)	Britisches Pfund	PHP	Philippinischer Peso	ZMW	Sambischer Kwacha
GHS	Ghanaischer Cedi				

Börsenkürzel:

BIST	Borsa Istanbul Exchange	CME	Chicago Mercantile Exchange	OTC	Over the Counter
CBOE	Chicago Board Options Exchange	FTSE	Financial Times Stock Exchange		

Index-/Spread-Kürzel:

ABX.HE	Asset-Backed Securities Index - Home Equity	DAX	Deutscher Aktien Index 30	PIMCOBDBU	PIMCO Custom Commodity Basket
ACS	Algonquin Cityfates Natural Gas Basis Futures Index	FRCPXTOB	Französischer Verbraucherpreisindex ohne Tabak	PrimeX.ARM	Prime Mortgage-Backed Securities Index - Adjustable Rate Mortgage
BCOMF1TC	Bloomberg Commodity Index 1-Month Forward Total Return	FTSE/JSE	South African Performance Index	S&P 500	Standard & Poor's 500 Index
BCOMTR	Bloomberg Commodity Index Total Return	FTSE/MIB	Index der 40 italienischen Aktien mit der höchsten Liquidität/Marktkapitalisierung der Borsa Italiana	S&P CNX Nifty	Standard & Poor's Nifty 50 Index
BCOMTR2	Bloomberg Custom Commodity Index	IBEX 35	Spanish Continuous Exchange Index	SIBCSORA	Singapore Overnight Rate Average
CAC	Cotation Assistée en Continu	IBR	Indicador Bancario de Referencia	SOFR	Secured Overnight Financing Rate
CDX.EM	Credit Derivatives Index - Emerging Markets	JMABDEWU/JPPMGSH	J.P. Morgan Custom Commodity Index	SONIO	Sterling Overnight Interbank Average Rate
CDX.HY	Credit Derivatives Index - High Yield	JMABNIU5	J.P. Morgan Custom Commodity Index	SPI 200	Australian Equity Futures Index
CDX.IG	Credit Derivatives Index - Investment Grade	JPPMGSH	JP Morgan Custom Commodity Index	SFRXON3	Swiss Overnight Rate Average (6PM)
CIXBSTR3	Individuell zusammengestellter Rohstoffindex	KOSPI	Korea Composite Stock Price Index	SX4T	EURO STOXX Chemicals Index
CMBX	Commercial Mortgage-Backed Index	KOSPI2	Korea Stock Exchange KOSPI 200 Index	TOPIX	Tokyo Price Index
CNREPOFIX	China Fixing Repo Rates 7-Day	MUTKCALM	Tokyo Overnight Average Rate	TRNGLU	FTSE EPRA/NAREIT Developed Index Net TRI USD
CPALEMU	Euro Area All Items Non-Seasonally Adjusted Index	NASDAQ	National Association of Securities Dealers Automated Quotations	UKRPI	United Kingdom Retail Prices Index
CPTFEMU	Eurozone HICP ex-Tobacco Index	NDUEACWF	MSCI ACWI Index Future	VSTOXX	Euro Stoxx 50 Volatility Index
CPURNSA	Consumer Price All Urban Non-Seasonally Adjusted Index	OMXS30	Stockholm 30 Index	WIG20	Capitalization-weighted Stock Market Index of the 20 largest companies on the Warsaw Stock Exchange

Municipal Bond or Agency Abbreviations:

AGM	Assured Guaranty Municipal
-----	----------------------------

Sonstige Kürzel:

ABS	Asset-Backed Security (forderungsbesichertes Wertpapier)	EUR-ESTRON	Euro Short-Term Rate	PRIBOR	Prague Interbank Offered Rate
ALT	Alternate Loan Trust	EURIBOR	Euro Interbank Offered Rate	REIT	Real Estate Investment Trust (Immobilieninvestmentfonds)
ATM	At-the-money	HIBOR	Hong Kong Interbank Offered Rate	REMIC	Real Estate Mortgage Investment Conduit
BABs	Build America Bonds	JIBAR	Johannesburg Interbank Agreed Rate	RMBS	Residential Mortgage-Backed Security
BBR	Bank Bill Rate	JSC	Joint Stock Company	STIBOR	Stockholm Interbank Offered Rate
BBSW	Bank Bill Swap Reference Rate	KLIBOR	Kuala Lumpur Interbank Offered Rate	TAIBOR	Taipei Interbank Offered Rate
BRL-CDI	Brazil Interbank Deposit Rate	KORIBOR	Korea Interbank Offered Rate	TBA	To-Be-Announced
BTP	Buoni del Tesoro Poliennali "Long-term Treasury Bond"	LIBOR	London Interbank Offered Rate	TBD	To-Be-Determined
CBO	Collateralized Bond Obligation	MIBOR	Mumbai Interbank Offered Rate	TBD%	Bei Abrechnung des Darlehens oder zum Zeitpunkt der Finanzierung zu ermittelnder Zinssatz
CDI	Brazil Interbank Deposit Rate	MSCI	Morgan Stanley Capital International	TELBOR	Tel Aviv Inter-Bank Offered Rate
CDO	Collateralised Debt Obligation (besicherte Schuldverschreibungen)	NIBOR	Norwegian Interbank Offered Rate	THBFIX	Thai Baht Floating-Rate Fix
CHILIBOR	Chile Interbank Offered Rate	OAT	Obligations Assimilables du Trésor	THB-THORON	Thai Overnight Repurchase Rate
CLO	Collateralised Loan Obligation (durch Kreditportfolio besicherte Wertpapiere)	OIS	Overnight Index Swap	TIIE	Tasa de Interés Interbancaria de Equilibrio „Gleichgewichtszinssatz im Interbankengeschäft“
CMBS	Collateralised Mortgage-Backed Security	PIK	Payment-in-Kind (Sachauschüttung)	WIBOR	Warsaw Interbank Offered Rate
DAC	Designated Activity Company				

VERWALTUNGSGESELLSCHAFT

PIMCO Global Advisors (Ireland) Limited,
Third Floor,
Harcourt Building,
Harcourt Street,
Dublin,
D02 F721,
Irland.

ANLAGEBERATUNGSGESELLSCHAFT

Pacific Investment Management
Company LLC,
650 Newport Center Drive,
Newport Beach, California 92660,
USA.

PIMCO Europe Ltd.,
11 Baker Street,
London W1U 3AH,
Großbritannien.

PIMCO Asia Pte Ltd.,
8 Marina View, #30-01,
Asia Square Tower 1,
Singapur 018960.

PIMCO Europe GmbH,
Seidlstraße 24-24a,
80335 München
Deutschland.

ADMINISTRATOR

State Street Fund Services (Ireland) Limited,
78 Sir John Rogerson's Quay,
Dublin 2,
D02 HD32,
Irland.

VERWAHRSTELLE

State Street Custodial Services (Ireland)
Limited,
78 Sir John Rogerson's Quay,
Dublin 2,
D02 HD32,
Irland.

VERTRIEBSSTELLEN

PIMCO Europe GmbH,
Seidlstraße 24-24a,
80335 München
Deutschland.

PIMCO Europe Ltd.,
11 Baker Street,
London W1U 3AH,
Großbritannien.

PIMCO Asia Pte Ltd.,
8 Marina View, #30-01,
Asia Square Tower 1,
Singapur 018960.

PIMCO Asia Limited,
22nd Floor, Suite 2201,
Two International Finance Centre,
8 Finance Street, Central,
Hongkong.

PIMCO Australia Pty Ltd.,
Level 19, 5 Martin Place,
363 George Street,
Sydney, New South Wales 2000,
Australien.

ÖSTERREICHISCHE ZAHLSTELLE

UniCredit Bank Austria,
Schottengasse 6-8,
1010 Wien,
Österreich.

REPRÄSENTANT IN SINGAPUR

PIMCO Asia Pte Ltd.,
8 Marina View, #30-01,
Asia Square Tower 1,
Singapur 018960.

ITALIENISCHE KORRESPONDENZBANKEN

Allianz Bank Financial Advisors S.p.A.,
Piazza Velasca, 7/9,
20122 Mailand,
Italien.

State Street Bank International GmbH
– Succursale Italia,
Via Ferrante Aporti, 10,
Mailand,
Italien.

Société Générale Securities Services
S.p.A. („SGSS“),
Via Santa Chiara, 19,
Turin,
Italien.

AllFunds Bank S.A.U.,
Succursale di Milano,
Via Bocchetto, 6,
20123 Mailand,
Italien.

Banca Sella Holding S.p.A.,
Piazza Gaudenzio Sella, 1,
13900 Biella,
Italien.

Monte dei Paschi di Siena S.p.A.,
Via Verii, 14,
Mantova,
Italien.

RBC Investor Services Bank S.A.,
Niederlassung Mailand,
Via Vittor Pisani, 26,
20124 Mailand,
Italien.

CACEIS Bank, Niederlassung Italien,
Piazza Cavour 2,
20121 Mailand,
Italien.

REPRÄSENTANT IN HONGKONG

PIMCO Asia Limited,
22nd Floor, Suite 2201,
Two International Finance Centre,
8 Finance Street,
Hongkong.

LUXEMBURGER ZAHLSTELLE UND VERTRETUNGSSTELLE

Société Générale Luxembourg,
(Centre opérationel / FED),
28-32, Place de la Gare,
L-1616, Luxemburg.

SCHWEIZER ZAHLSTELLE UND REPRÄSENTANT

BNP PARIBAS Paris,
Niederlassung Zürich,
Selnaustrasse 16,
8002 Zürich,
Schweiz.

BRITISCHER REPRÄSENTANT

PIMCO Europe Ltd.,
11 Baker Street,
London W1U 3AH,
Großbritannien.

BELGISCHE ZAHLSTELLE

ABN AMRO BANK S.A.,
Borsbeeksebrug 30,
2600 Antwerpen,
Belgien.

DEUTSCHE ZAHL- UND INFORMATIONSSTELLE

Marcard, Stein & Co AG,
Ballindamm 36,
20095 Hamburg,
Deutschland.

PORTUGIESISCHE ZAHLSTELLE

Banco Activobank (Portugal) S.A.,
Rua Augusta 86,
1149-023, Lissabon,
Portugal.

SCHWEDISCHE ZAHLSTELLE

SEB Merchant Banking,
SE-106 40,
Stockholm,
Schweden.

GRIECHISCHE ZAHLSTELLE

Eurobank Asset Management M.F.M.C.,
10 Stadiou Street,
GR 10564 Athens,
Griechenland.

UNGARISCHE ZAHLSTELLE

European Investment Centre,
Tomasikova 64,
831 04 Bratislava,
Slowakische Republik.

ZAHLSTELLE IN DER TSCHECHISCHEN REPUBLIK

European Investment Centre,
Veveří 2581/102,
616 00 Brno,
Tschechische Republik.

FRANZÖSISCHE ZENTRALISIERUNGS- UND FINANZSTELLE

Société Générale,
29, Boulevard Haussmann,
75009 Paris,
Frankreich.

ZAHLSTELLE IN LIECHTENSTEIN

LGT Bank Ltd.,
Herrengasse 12,
FL-9490 Vaduz,
Liechtenstein.

ZAHLSTELLE IN ZYPERN

EUROBANK CYPRUS LTD.,
28, Spyrou Kyprianou Avenue,
1075 Nicosia,
Zypern.

RECHTSBERATER FÜR IRISCHES RECHT

Dillon Eustace LLP,
33 Sir John Rogerson's Quay,
Dublin 2,
D02 XK09,
Irland.

RECHTSBERATER FÜR US-RECHT

Dechert LLP,
1900 K Street N.W.,
Washington, D.C. 20006,
USA.

UNABHÄNGIGE ABSCHLUSSPRÜFER

PricewaterhouseCoopers
Chartered Accountants und Statutory
Audit Firm,
One Spencer Dock,
North Wall Quay,
Dublin 1,
D01 X9R7,
Irland.

SEKRETÄR

State Street Fund Services (Ireland) Limited,
78 Sir John Rogerson's Quay,
Dublin 2,
D02 HD32,
Irland.

BETREUENDER MAKLER

Dillon Eustace LLP,
33 Sir John Rogerson's Quay,
Dublin 2,
D02 XK09,
Irland.

EINGETRAGENER GESCHÄFTSSITZ

PIMCO Funds: Global Investors
Series plc,
78 Sir John Rogerson's Quay,
Dublin 2,
D02 HD32,
Irland.

VERWALTUNGSRAT DER GESELLSCHAFT UND VERWALTUNGSGESELLSCHAFT

V. Mangala Ananthanarayanan (Indien)
Ryan P. Blute (USA)
John Bruton (unabhängiges
Verwaltungsratsmitglied) (Irland)
Craig A. Dawson (USA)
David M. Kennedy (unabhängiges
Verwaltungsratsmitglied) (Irland)
Frances Ruane (unabhängiges
Verwaltungsratsmitglied) (Irland)

Der Verkaufsprospekt, seine Nachträge, das Memorandum und die Satzung, die wesentlichen Anlegerinformationen sowie die Jahres- und Halbjahresberichte sind kostenlos beim Vertreter oder Bevollmächtigten für das jeweilige Land erhältlich.

Eine Kopie der Liste der Portfolioveränderungen in dem am 31. Dezember 2022 abgelaufenen Geschäftsjahr kann von den Anteilhabern kostenlos bei der Verwahrstelle oder den Zahlstellen sowie bei der Zahl- und Informationsstelle in Deutschland und der Vertretungsstelle in der Schweiz bezogen werden.

¹ Mitarbeiter von PIMCO.

PIMCO Europe Ltd (Registernummer 2604517) wurde von der britischen Financial Conduct Authority (12 Endeavour Square, London, E20 1JN) zugelassen und steht unter deren Aufsicht. Die von PIMCO Europe Ltd erbrachten Dienstleistungen sind nicht für Privatanleger verfügbar. Diese sollten sich nicht auf diese Unterlagen verlassen, sondern ihre Finanzberater kontaktieren.

PIMCO Europe GmbH (Registernummer 192083, Seidlstr. 24-24a, 80335 München, Deutschland), PIMCO Europe GmbH, Zweigniederlassung Italien (Registernummer 10005170963), PIMCO Europe GmbH, Zweigniederlassung Irland (Registernummer 909462), PIMCO Europe GmbH, Zweigniederlassung Vereinigtes Königreich (Registernummer 2604517), und PIMCO Europe GmbH, Zweigniederlassung Spanien (N.I.F. W2765338E) sind von der Bundesanstalt für Finanzdienstleistungsaufsicht (BaFin) (Marie-Curie-Str. 24-28, 60439 Frankfurt am Main) in Deutschland zugelassen und werden von dieser gemäß § 15 des deutschen Wertpapierinstitutsgesetzes (WpIG) reguliert. Die Zweigniederlassungen Italien, Irland, Vereinigtes Königreich und Spanien werden zusätzlich von folgenden Behörden überwacht: (1) Niederlassung Italien: der Commissione Nazionale per le Società e la Borsa (CONSOB) gemäß Artikel 27 des italienischen konsolidierten Finanzgesetzes; (2) Niederlassung Irland: der Zentralbank von Irland gemäß Verordnung 43 der European Union (Markets in Financial Instruments) Regulations 2017 in der jeweils gültigen Fassung; (3) Niederlassung Vereinigtes Königreich: der Financial Conduct Authority und (4) Niederlassung Spanien: der Comisión Nacional del Mercado de Valores (CNMV) gemäß den in den Artikeln 168 und 203 bis 224 festgelegten Verpflichtungen sowie den in Teil V, Abschnitt I des Gesetzes über den Wertpapiermarkt (LSM) und in den Artikeln 111, 114 und 117 des Königlichen Erlasses 217/2008 enthaltenen Verpflichtungen. Die von PIMCO Europe GmbH erbrachten Dienstleistungen stehen nur professionellen Kunden im Sinne von § 67 Abs. 2 WpHG (Wertpapierhandelsgesetz) zur Verfügung. Sie sind nicht für Privatanleger verfügbar, die sich nicht auf diese Unterlagen verlassen sollten.

PIMCO (Schweiz) GmbH (eingetragen in der Schweiz, Registernummer CH-020.4.038.582-2). Die von PIMCO (Schweiz) GmbH erbrachten Dienstleistungen sind nicht für Privatanleger verfügbar. Diese sollten sich nicht auf diese Unterlagen verlassen, sondern ihren Finanzberater kontaktieren.